

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年5月14日提出
【計算期間】	第1期(自 令和1年6月28日至 令和2年2月18日)
【ファンド名】	三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型） 三井住友D S ・年金バランス50（標準型） 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）
【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 猿田 隆
【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
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0784
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・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。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(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）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(合成指数)	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル			
一般		(日本を含む)			
大型株	年2回	日本			日経225
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			
一般	年12回(毎月)	アジア			
公債	日々	オセアニア			TOPIX
社債	その他()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他債券		アフリカ			
クレジット属性()		中近東(中東)			
不動産投信					
その他資産					その他
(投資信託証券(資産複合(株式債券)資産配分固定型))					(合成指数)
資産複合					

() 資産配分固定 型 資産配分変更 型		エマージング			
-----------------------------------	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2019年6月28日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

^{*}日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に2020年7月27日に資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

(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。

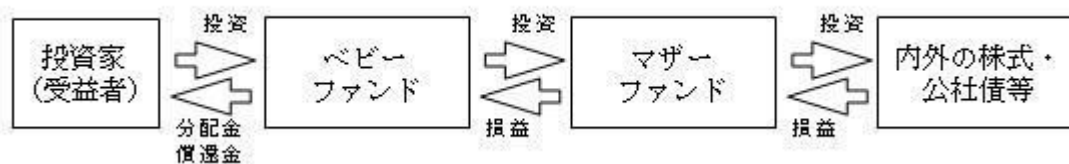
運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまと

めて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2020年2月28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

(ハ) 大株主の状況

(2020年2月28日現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

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

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
------	------------------------

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

ロ 投資態度

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

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

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
株 式	30%	50%	70%
国内株式	20%	35%	50%
外国株式	10%	15%	20%
債 券	65%	45%	25%
国内債券	55%	35%	15%
外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

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

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

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

(二) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージNEXT30

制限はありません。

b. マイパッケージNEXT50

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

c. マイパッケージNEXT70

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

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

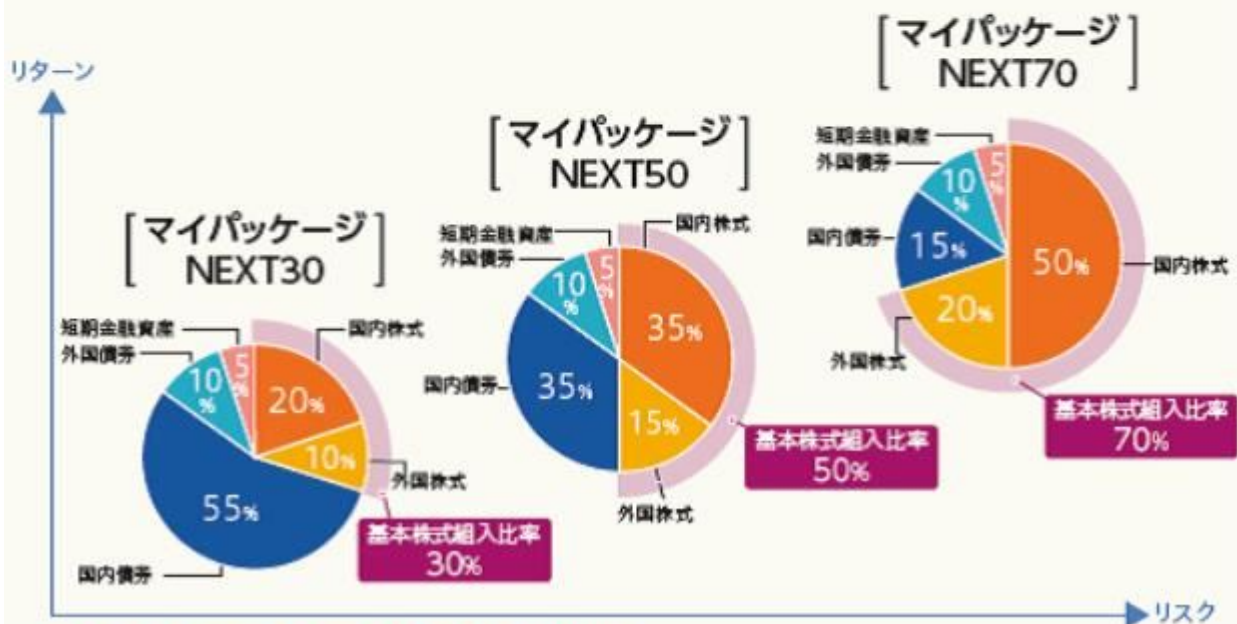
ファンドの特色

1 内外の株式、公社債に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。

2 国内株式、外国株式、国内債券および外国債券への投資割合が異なる3つのファンドからお選びいただけます。

- 各ファンドの基本資産配分は、下記の通りとします。
- 時価変動等に伴う各資産への投資比率の変化については、一定の範囲(±3%)を超えた場合、調整します。

[各ファンドの基本資産配分イメージ]



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

3 委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。

〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

	投資対象資産	マイパッケージ NEXT30	マイパッケージ NEXT50	マイパッケージ NEXT70
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%

TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の代表的な指数であり、各ファンドの合成指数を構成するものです。なお、外国株式および外国債券のベンチマークは、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により委託会社が円換算したものです。

※指数を公表する各社は各ファンドの運用と何ら関係ありません。

4 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

■ 基準価額は為替変動の影響を受けます。

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

ファンドのしくみ

■ ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入を通じて、実際の運用を行います。



各マザーファンドの投資方針等

▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

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

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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



最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

層化抽出法とは

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

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

(2)【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利

3. 約束手形

4. 金銭債権

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
14. 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。)
15. 投資証券もしくは新投資口予約権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。次号において同じ。))で次号に定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券(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。以下本号において同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証

書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

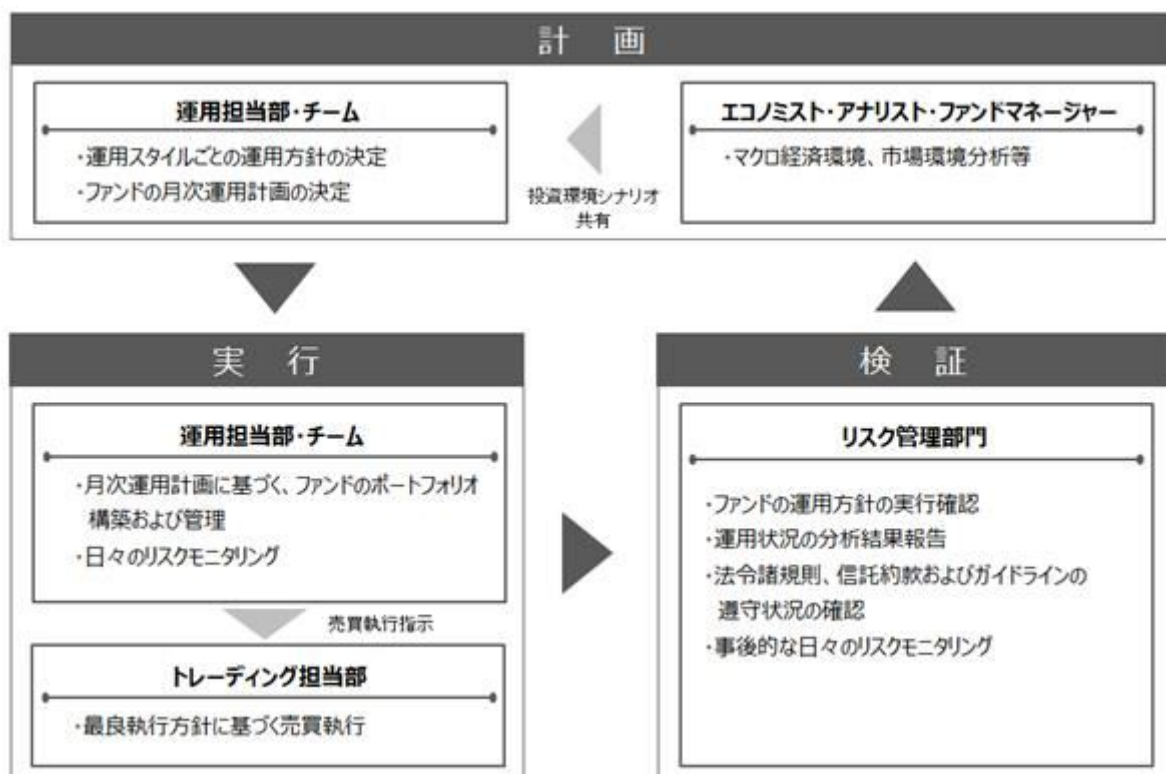
八 投資対象とする金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（4）【分配方針】

年1回(原則として毎年2月18日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。)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。
- ロ 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、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主要な投資制限

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

マイパッケージNEXT30	50%未満
マイパッケージNEXT50	25%以上
マイパッケージNEXT70	50%以上

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)
- ロ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 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。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ デリバティブ取引等にかかる投資制限
委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ 投資する株式等の範囲
 - (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ハ 信用取引の指図
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプцион取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプцион取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプцион取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプцион取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本項において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (二) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクお

よび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンド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。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ヲ 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、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

(ハ)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。

(参考情報: マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

(イ) 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指

数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 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。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) NOMURA - BPI(総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １２．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- １３．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- １４．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
- １５．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
- １６．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １９．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- ２０．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ２１．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
5. コマーシャル・ペーパー
6. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
および新株予約権証券
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. 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。)

9. 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。)
10. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
11. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １２．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- １３．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- １４．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
- １５．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
- １６．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １９．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- ２０．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ２１．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資

産総額の10%以内とします。

- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、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、投資元本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) 信用リスク

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

(ニ) 為替変動リスク

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

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の

国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物等とインデックスの動きとの不一致等から、上記合成指数の動きに連動しないことがあります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出が生じた場合、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。

■マイパッケージNEXT30

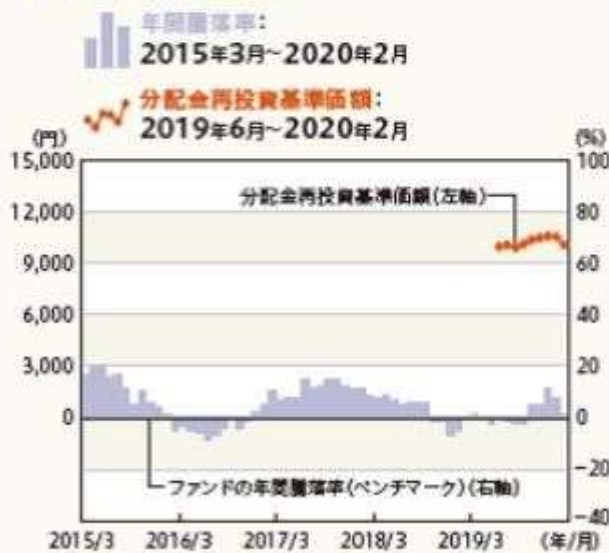


「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



■マイパッケージNEXT50



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

※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。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

■マイパッケージNEXT70



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

※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。



※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※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ロクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.154%（税抜き0.14%）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0.06%	ファンドの運用等の対価
販売会社	年0.06%	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0.02%	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。

(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つたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われま

す。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

- (八) 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。

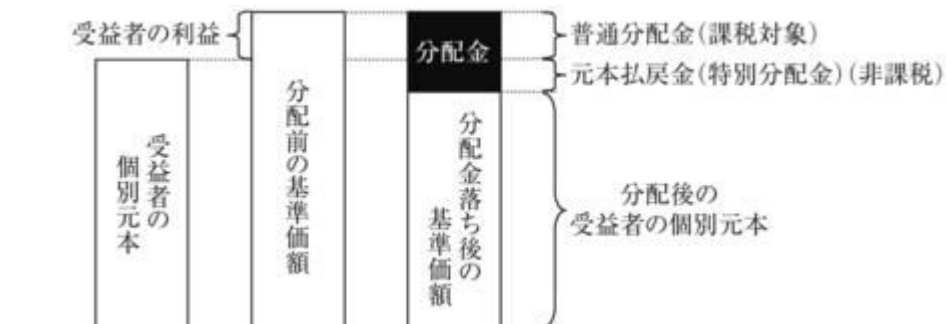
ハ 収益分配金の課税について

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。

※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)

< 配当控除の適用の可否 >

a. マイパッケージNEXT30

配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

b. マイパッケージNEXT50

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

c. マイパッケージNEXT70

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした

部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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、2020年2月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

2020年 2月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	959,938	94.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		52,002	5.14
合計(純資産総額)		1,011,940	100.00

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

三井住友DS・年金バランス50(標準型)

2020年 2月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,063,943	94.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		113,715	5.22
合計(純資産総額)		2,177,658	100.00

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

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

2020年 2月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	953,451	94.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		53,992	5.36
合計(純資産総額)		1,007,443	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】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

イ 主要投資銘柄

2020年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	442,976	1.2957	573,964	1.3056	578,349	57.15
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）	76,547	2.6600	203,617	2.4151	184,868	18.27
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	56,364	1.8413	103,783	1.8646	105,096	10.39
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	24,753	4.1587	102,941	3.7016	91,625	9.05

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

2020年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	94.86
合計	94.86

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

イ 主要投資銘柄

2020年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	620,211	1.2957	803,608	1.3056	809,747	37.18
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）	299,639	2.6609	797,323	2.4151	723,658	33.23
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	81,302	4.1587	338,111	3.7016	300,947	13.82
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	123,132	1.8413	226,723	1.8646	229,591	10.54

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

2020年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.78
合計	94.78

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)

イ 主要投資銘柄

2020年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	202,954	2.6592	539,699	2.4151	490,154	48.65
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	51,285	4.1587	213,279	3.7016	189,836	18.84
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	125,803	1.2957	163,003	1.3056	164,248	16.30
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	58,572	1.8413	107,849	1.8646	109,213	10.84

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

2020年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.64
合計	94.64

【投資不動産物件】

三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス5 0（標準型）

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス7 0（株式重点型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友D S ・年金バランス3 0（債券重点型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2020年 2月18日)	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
2019年 6月末日	1,000,903		10,009	
7月末日	1,006,301		10,063	
8月末日	1,002,470		10,025	
9月末日	1,012,608		10,126	
10月末日	1,025,510		10,255	
11月末日	1,031,406		10,314	
12月末日	1,036,361		10,364	
2020年 1月末日	1,035,177		10,352	
2月末日	1,011,940		10,119	

三井住友D S ・年金バランス5 0（標準型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
2019年 6月末日	1,000,383		10,004	
7月末日	1,008,271		10,083	
8月末日	994,084		9,941	
9月末日	1,016,793		10,168	
10月末日	1,040,173		10,402	
11月末日	1,051,808		10,518	

12月末日	1,061,418		10,614	
2020年 1月末日	1,055,970		10,560	
2月末日	2,177,658		10,098	

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
2019年 6月末日	999,862		9,999	
7月末日	1,010,243		10,102	
8月末日	985,643		9,856	
9月末日	1,020,606		10,206	
10月末日	1,054,554		10,546	
11月末日	1,072,082		10,721	
12月末日	1,086,439		10,864	
2020年 1月末日	1,076,546		10,765	
2月末日	1,007,443		10,074	

【分配の推移】

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0

三井住友D S・年金バランス50(標準型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0

【収益率の推移】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

	収益率（％）
第1期	3.7

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

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

	収益率（％）
第1期	5.7

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

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

	収益率（％）
第1期	7.9

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

（4）【設定及び解約の実績】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,156,528	0

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）

第1期	1,000,000	0
-----	-----------	---

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年 2月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	149,805,212,390	97.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,628,497,074	2.36
合計(純資産総額)		153,433,709,464	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	3,658,780,000	2.38
合計	買建		3,658,780,000	2.38

国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年 2月28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	109,015,596,600	75.95
地方債証券	日本	8,598,702,550	5.99
特殊債券	日本	14,910,295,171	10.39
社債券	日本	6,354,034,000	4.43
	フランス	201,868,000	0.14
	オーストラリア	200,280,000	0.14
	小計	6,756,182,000	4.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,247,622,343	2.96
合計(純資産総額)		143,528,398,664	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 2月28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	134,980,905,745	62.95
	イギリス	11,682,847,729	5.45
	スイス	8,083,663,980	3.77
	カナダ	8,045,279,584	3.75
	フランス	7,758,009,532	3.62
	ドイツ	6,477,927,674	3.02
	オーストラリア	4,567,794,510	2.13
	オランダ	4,021,963,982	1.88
	アイルランド	3,892,028,870	1.82
	スペイン	2,179,066,387	1.02
	香港	1,930,373,589	0.90
	スウェーデン	1,921,004,935	0.90
	イタリア	1,529,854,403	0.71
	デンマーク	1,497,874,846	0.70
	フィンランド	905,117,382	0.42
	シンガポール	900,915,844	0.42
	バミューダ	812,774,385	0.38
	ジャージー	724,611,393	0.34
	ベルギー	696,449,002	0.32
	ケイマン諸島	492,552,541	0.23
	イスラエル	462,386,577	0.22
	ノルウェー	440,024,950	0.21
	ルクセンブルグ	221,657,829	0.10
	ニュージーランド	220,715,921	0.10
	キュラソー	205,661,700	0.10
	オーストリア	156,043,941	0.07
	ポルトガル	134,688,022	0.06
リベリア	76,138,330	0.04	
パプアニューギニア	28,837,483	0.01	
マン島	27,345,392	0.01	

	英ヴァージン諸島	16,795,597	0.01
	小計	205,091,312,055	95.65
投資証券	アメリカ	4,434,236,835	2.07
	オーストラリア	636,977,637	0.30
	フランス	228,133,391	0.11
	イギリス	146,075,130	0.07
	香港	145,173,951	0.07
	シンガポール	115,253,911	0.05
	カナダ	69,734,492	0.03
	小計	5,775,585,347	2.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,555,363,065	1.66
合計(純資産総額)		214,422,260,467	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	2,766,553,997	1.29
	買建	ドイツ	657,195,059	0.30
	買建	イギリス	220,144,299	0.10
	買建	オーストラリア	154,685,388	0.07
合計	買建		3,798,578,743	1.76

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		385,916,800	0.17
	売建		1,867,242,100	0.87

外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 2月28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	82,900,659,986	48.30
	フランス	16,598,363,284	9.67

	イタリア	14,929,762,298	8.70
	イギリス	10,794,729,821	6.29
	ドイツ	9,620,598,839	5.60
	スペイン	9,046,144,173	5.27
	ベルギー	4,153,323,012	2.42
	カナダ	3,246,814,795	1.89
	オーストラリア	3,228,007,740	1.88
	オランダ	3,099,782,262	1.81
	オーストリア	2,671,819,724	1.56
	メキシコ	1,458,775,532	0.85
	アイルランド	1,237,128,556	0.72
	フィンランド	1,151,458,068	0.67
	ポーランド	955,674,658	0.56
	南アフリカ	952,020,031	0.55
	デンマーク	824,433,344	0.48
	マレーシア	787,849,441	0.46
	シンガポール	701,262,113	0.41
	スウェーデン	474,424,958	0.28
	ノルウェー	377,940,795	0.22
	小計	169,210,973,430	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,440,163,849	1.42
合計(純資産総額)		171,651,137,279	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		240,203	0.00
	売建		691,548,259	0.40

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年2月28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	785,500	7,737.98	6,078,183,290	7,127.00	5,598,258,500	3.65
日本	株式	ソニー	電気機器	444,900	6,998.00	3,113,410,200	6,611.00	2,941,233,900	1.92

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	548,100	4,236.00	2,321,751,600	5,013.00	2,747,625,300	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,747,600	582.10	2,763,577,960	531.90	2,525,248,440	1.65
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	923,600	2,799.00	2,585,156,400	2,529.50	2,336,246,200	1.52
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	585,600	4,491.00	2,629,929,600	3,763.00	2,203,612,800	1.44
日本	株式	キーエンス	電気機器	63,800	37,970.00	2,422,486,000	34,410.00	2,195,358,000	1.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	481,700	3,978.00	1,916,202,600	3,758.00	1,810,228,600	1.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	480,300	4,008.00	1,925,042,400	3,484.00	1,673,365,200	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	514,800	3,150.00	1,621,620,000	3,058.00	1,574,258,400	1.03
日本	株式	任天堂	その他製品	43,200	43,240.00	1,867,968,000	36,270.00	1,566,864,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	554,300	3,104.00	1,720,547,200	2,799.50	1,551,762,850	1.01
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	510,100	3,007.00	1,533,870,700	2,927.50	1,493,317,750	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	248,300	6,020.00	1,494,766,000	5,801.00	1,440,388,300	0.94
日本	株式	信越化学工業	化学	118,400	11,905.00	1,409,552,000	12,145.00	1,437,968,000	0.94
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,433,600	169.70	1,600,881,920	147.60	1,392,399,360	0.91
日本	株式	HOYA	精密機器	140,600	10,025.00	1,409,515,000	9,609.00	1,351,025,400	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	201,400	7,012.00	1,412,216,800	6,590.00	1,327,226,000	0.87
日本	株式	花王	化学	168,500	8,708.00	1,467,298,000	7,868.00	1,325,758,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	89,700	15,770.00	1,414,569,000	14,725.00	1,320,832,500	0.86
日本	株式	三菱商事	卸売業	486,700	2,907.50	1,415,080,250	2,690.00	1,309,223,000	0.85
日本	株式	日立製作所	電気機器	338,300	4,309.00	1,457,734,700	3,637.00	1,230,397,100	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	66,900	21,240.00	1,420,956,000	17,970.00	1,202,193,000	0.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	484,900	2,438.00	1,182,186,200	2,461.50	1,193,581,350	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	206,800	6,529.00	1,350,197,200	5,721.00	1,183,102,800	0.77
日本	株式	三井物産	卸売業	609,200	1,967.50	1,198,601,000	1,783.50	1,086,508,200	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	84,700	16,325.00	1,382,727,500	12,780.00	1,082,466,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	619,500	1,898.00	1,175,811,000	1,699.00	1,052,530,500	0.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	46,900	22,570.00	1,058,533,000	22,325.00	1,047,042,500	0.68
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	58,500	22,245.00	1,301,332,500	17,780.00	1,040,130,000	0.68

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 2月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.71
		食料品	3.72
		繊維製品	0.55
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.01

医薬品	5.97
石油・石炭製品	0.48
ゴム製品	0.65
ガラス・土石製品	0.79
鉄鋼	0.67
非鉄金属	0.69
金属製品	0.56
機械	4.93
電気機器	14.11
輸送用機器	7.67
精密機器	2.43
その他製品	2.15
電気・ガス業	1.50
陸運業	4.01
海運業	0.15
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.10
卸売業	5.01
小売業	4.37
銀行業	5.61
証券、商品先物取引業	0.79
保険業	2.34
その他金融業	1.21
不動産業	2.36
サービス業	4.90
合計	97.64

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	103.98	2,110,976,700	103.56	2,102,349,200	0.800	2023/6/20	1.46
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,721,000,000	102.14	1,757,855,200	102.53	1,764,644,560	0.100	2026/9/20	1.23
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	1,570,000,000	101.06	1,586,757,600	101.68	1,596,407,400	0.100	2024/9/20	1.11
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	106.72	1,552,848,750	105.57	1,536,159,900	1.700	2022/12/20	1.07
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,370,000,000	101.66	1,392,744,450	102.67	1,406,592,700	0.100	2029/9/20	0.98
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.23	1,339,471,150	103.83	1,334,318,300	0.800	2023/9/20	0.93

日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	103.25	1,306,112,500	102.73	1,299,623,050	0.800	2022/9/20	0.91
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	104.50	1,269,760,050	103.92	1,262,628,000	1.000	2023/3/20	0.88
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	117.00	1,251,922,600	117.83	1,260,877,300	1.200	2035/9/20	0.88
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	111.01	1,132,302,000	109.68	1,118,736,000	2.100	2024/3/20	0.78
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	109.52	1,117,124,400	108.33	1,105,037,400	1.900	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	108.99	1,117,229,500	107.78	1,104,796,250	1.900	2023/9/20	0.77
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	103.02	1,097,184,300	102.37	1,090,336,350	0.900	2022/3/20	0.76
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,050,000,000	101.89	1,069,867,200	102.87	1,080,229,500	0.100	2028/6/20	0.75
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	1,035,000,000	102.40	1,059,942,300	102.76	1,063,607,400	0.100	2029/3/20	0.74
日本	特殊債券	第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	102.57	1,025,750,000	101.73	1,017,380,000	1.200	2021/6/30	0.71
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	980,000,000	101.93	998,981,600	102.87	1,008,175,000	0.100	2028/3/20	0.70
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	133.08	987,468,440	133.81	992,885,040	2.400	2034/3/20	0.69
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	960,000,000	103.30	991,718,400	102.58	984,816,000	1.000	2022/3/20	0.69
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	114.36	972,119,500	113.38	963,738,500	2.000	2025/12/20	0.67
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	930,000,000	101.90	947,670,000	102.86	956,663,100	0.100	2027/12/20	0.67
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	910,000,000	103.53	942,146,200	102.69	934,542,700	0.100	2029/6/20	0.65
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	910,000,000	101.89	927,211,000	102.43	932,176,700	0.100	2026/6/20	0.65
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	900,000,000	102.04	918,428,000	101.58	914,292,000	0.100	2024/6/20	0.64
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	890,000,000	101.86	906,554,000	102.33	910,808,200	0.100	2026/3/20	0.63
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	857,000,000	103.12	883,738,400	103.42	886,317,970	0.300	2025/12/20	0.62
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	113.12	882,367,200	111.59	870,441,000	2.400	2024/6/20	0.61
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	117.53	872,080,020	116.43	863,962,540	2.300	2026/6/20	0.60
日本	国債証券	第56回利付国債(20年)	818,000,000	106.68	872,650,580	105.23	860,797,760	2.000	2022/6/20	0.60
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	838,000,000	101.95	854,341,000	102.63	860,081,300	0.100	2026/12/20	0.60

□ 種類別の投資比率

2020年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.95
地方債証券	5.99
特殊債券	10.39
社債券	4.71

合計	97.04
----	-------

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)

2020年 2月28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	226,284	29,245.16	6,617,713,483	29,931.29	6,772,972,841	3.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	369,043	16,565.51	6,113,386,762	17,309.63	6,388,000,515	2.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,450	197,061.54	4,226,970,119	206,198.94	4,422,967,456	2.06
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	122,947	22,065.46	2,712,882,750	20,764.34	2,552,913,617	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,760	142,801.77	2,250,555,939	144,238.58	2,273,200,158	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,316	142,706.56	2,185,693,807	143,894.97	2,203,895,491	1.03
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	159,401	14,418.49	2,298,322,808	13,281.51	2,117,087,426	0.99
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	134,149	15,045.53	2,018,342,898	15,223.90	2,042,271,176	0.95
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	151,115	11,747.11	1,775,165,556	11,502.95	1,738,268,350	0.81
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	87,297	20,190.92	1,762,607,555	19,698.49	1,719,619,457	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	127,112	13,357.02	1,697,838,263	12,420.30	1,578,769,809	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	66,710	24,107.42	1,608,206,589	22,725.32	1,516,006,638	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	372,343	4,090.49	1,523,066,584	3,909.93	1,455,836,518	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	45,757	31,978.72	1,463,250,698	31,277.28	1,431,154,620	0.67
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	433,675	3,646.20	1,581,269,081	3,187.69	1,382,424,019	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	55,601	24,130.40	1,341,674,887	24,592.20	1,367,351,129	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	220,722	6,352.41	1,402,116,971	6,109.47	1,348,495,960	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	48,141	30,626.17	1,474,374,647	27,786.46	1,337,668,240	0.62
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	35,629	34,838.92	1,241,276,165	36,449.74	1,298,668,071	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	210,805	6,592.06	1,389,639,883	6,025.21	1,270,145,617	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	208,020	5,843.56	1,215,577,767	6,010.98	1,250,406,119	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	91,870	16,587.39	1,523,884,383	12,917.11	1,186,695,557	0.55

アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	214,566	7,455.46	1,599,689,497	5,451.80	1,169,771,477	0.55
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	129,771	9,540.10	1,238,029,278	8,544.29	1,108,801,629	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	71,076	14,863.87	1,056,464,915	14,922.96	1,060,664,952	0.49
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	283,170	4,215.24	1,193,630,531	3,731.56	1,056,666,695	0.49
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	108,833	10,406.46	1,132,566,522	9,614.05	1,046,326,121	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	231,398	4,831.33	1,117,961,141	4,492.10	1,039,463,303	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	95,907	12,817.53	1,229,291,415	10,300.64	987,904,046	0.46
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	216,232	4,958.27	1,072,137,352	4,381.57	947,437,201	0.44

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 2月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.40
		素材	4.02
		資本財	6.81
		商業・専門サービス	1.26
		運輸	1.70
		自動車・自動車部品	1.10
		耐久消費財・アパレル	1.80
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	6.05
		小売	4.88
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.78
		家庭用品・パーソナル用品	2.06
		ヘルスケア機器・サービス	4.87
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.35
		銀行	7.21
		各種金融	4.38
		保険	3.75
		不動産	0.75
		ソフトウェア・サービス	10.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.64		

		電気通信サービス	2.32
		公益事業	3.86
		半導体・半導体製造装置	3.30
投資証券			2.69
合計			98.34

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）

2020年 2月28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 1.75	11,800,000	10,951.54	1,292,282,808	11,235.38	1,325,775,227	1.750	2024/6/30	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	10,500,000	10,950.69	1,149,822,907	11,027.63	1,157,901,919	1.750	2021/7/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	7,400,000	12,520.33	926,504,487	13,904.44	1,028,929,254	3.000	2048/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	8,900,000	11,049.01	983,361,918	11,078.07	985,948,911	2.500	2021/2/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	6,700,000	12,059.52	807,988,372	12,610.95	844,933,825	3.125	2028/11/15	0.49
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	3,700,000	20,651.80	764,116,705	21,267.88	786,911,690	4.750	2034/7/4	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,622.66	732,227,765	12,185.20	767,667,696	2.625	2029/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,200,000	11,398.67	706,717,751	11,971.47	742,231,206	2.375	2029/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	6,000,000	11,818.44	709,106,400	12,356.18	741,371,155	2.875	2028/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	11,121.67	722,909,117	11,384.99	740,024,653	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,450,000	10,683.03	689,055,541	11,261.88	726,391,641	1.625	2029/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,200.33	705,620,886	11,508.10	725,010,514	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,366.18	704,703,555	11,593.59	718,802,927	2.750	2023/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,800,000	11,457.66	664,544,452	11,840.66	686,758,742	2.625	2025/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,817.32	654,448,256	11,222.55	678,964,850	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	11,877.94	653,286,842	12,323.69	677,803,439	2.875	2028/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,296.08	643,876,719	11,564.52	659,178,110	2.500	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,600,000	11,264.45	630,809,235	11,756.88	658,385,595	2.250	2027/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	21,670.71	628,450,732	22,649.27	656,829,046	4.500	2041/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,069.76	653,488,000	12,990.83	649,541,504	3.000	2022/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	11,249.06	629,947,474	11,540.59	646,273,064	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	5,800,000	10,894.26	631,867,631	11,052.43	641,040,940	1.500	2022/9/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,960.95	624,774,345	11,163.56	636,323,481	1.750	2023/5/15	0.37

イタリア	国債証券	BTPS 6.5	3,700,000	17,019.14	629,708,316	17,078.58	631,907,525	6.500	2027/11/1	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,500,000	10,801.93	594,106,587	11,235.38	617,946,080	1.625	2026/9/30	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	5,000,000	12,284.91	614,245,632	12,338.45	616,922,752	0.000	2024/3/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	11,262.74	585,662,521	11,738.93	610,424,480	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	4,000,000	13,864.26	554,570,724	15,175.71	607,028,730	3.750	2043/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	11,227.51	583,830,936	11,624.37	604,467,384	2.250	2026/3/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	11,170.40	580,861,279	11,426.03	594,153,607	2.250	2024/1/31	0.35

□ 種類別の投資比率

2020年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.58
合計	98.58

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年 2月28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	244	日本円	3,998,958,400	3,658,780,000	2.38

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 2月28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 2003	買建	171	米ドル	27,412,463	2,999,745,825	25,281,495	2,766,553,997	1.29
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 2003	買建	158	ユーロ	5,779,746	695,419,039	5,462,060	657,195,059	0.30
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 2003	買建	13	オースト ラリアドル	2,185,233.5	157,205,698	2,150,200	154,685,388	0.07
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 2003	買建	23	英ポンド	1,659,086	234,113,625	1,560,090	220,144,299	0.10

(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。

2020年 2月28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	2,590,000.00	283,423,700	283,346,000	0.13
	カナダドル	買建	150,000.00	12,253,500	12,249,000	0.00
	ユーロ	買建	330,000.00	39,712,200	39,705,600	0.01
	英ポンド	買建	150,000.00	21,165,000	21,163,500	0.00
	スイスフラン	買建	100,000.00	11,303,000	11,304,000	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	280,000.00	3,169,600	3,166,800	0.00
	ノルウェークローネ	買建	260,000.00	3,050,600	3,026,400	0.00
	デンマーククローネ	買建	150,000.00	2,415,000	2,415,000	0.00
	ニュージーランドドル	買建	30,000.00	2,077,900	2,067,500	0.00
	香港ドル	買建	240,000.00	3,369,600	3,367,200	0.00
	シンガポールドル	買建	20,000.00	1,569,400	1,569,000	0.00
	イスラエルシェケル	買建	80,000.00	2,560,400	2,536,800	0.00
	米ドル	売建	12,880,000.00	1,420,867,830	1,409,200,800	0.65
	カナダドル	売建	480,000.00	39,761,400	39,196,800	0.01
	ユーロ	売建	1,690,000.00	203,044,200	203,340,800	0.09
	英ポンド	売建	740,000.00	105,590,860	104,406,600	0.04
	スイスフラン	売建	330,000.00	37,322,720	37,303,200	0.01
	スウェーデンクローナ	売建	610,000.00	6,919,548	6,899,100	0.00
	ノルウェークローネ	売建	80,000.00	942,344	931,200	0.00
	デンマーククローネ	売建	720,000.00	11,577,276	11,592,000	0.00
オーストラリアドル	売建	540,000.00	39,039,640	38,842,200	0.01	

ニュージーランドドル	売建	10,000.00	696,190	689,200	0.00
香港ドル	売建	890,000.00	12,601,230	12,486,700	0.00
シンガポールドル	売建	30,000.00	2,365,460	2,353,500	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 2月28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	ユーロ	買建	1,996.37	240,045	240,203	0.00
	米ドル	売建	3,278,018.14	360,940,442	358,615,184	0.20
	ユーロ	売建	2,389,837.00	287,046,285	287,545,187	0.16
	英ポンド	売建	321,694.59	45,807,380	45,387,888	0.02

(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:2020年2月28日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■マイパッケージNEXT30



決算期	分配金
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

■マイパッケージNEXT50



決算期	分配金
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

■マイパッケージNEXT70



決算期	分配金
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■マイパッケージNEXT30

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	94.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.14
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	57.15
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)	18.27
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.39
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9.05

■マイパッケージNEXT50

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	94.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.22
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	37.18
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)	33.23
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	13.82
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.54

■マイパッケージNEXT70

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	94.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.36
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	48.65
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	18.84
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	16.30
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.84

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.36
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.38%

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	3.65
日本	株式	ソニー	電気機器	1.92
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.65
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.52
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.44
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.03

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	75.95
特殊債券	日本	10.39
地方債証券	日本	5.99
社債券	日本	4.43
	フランス	0.14
	オーストラリア	0.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.96
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.46
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	1.23
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	0.100	2024/09/20	1.11
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.07
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	0.100	2029/09/20	0.98
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.93
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	0.91
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.88
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1.200	2035/09/20	0.88
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.78

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	62.95
	イギリス	5.45
	スイス	3.77
	カナダ	3.75
	フランス	3.62
	ドイツ	3.02
	その他	13.09
	投資証券	アメリカ・その他
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.66
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.76%

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	3.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.06
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.03
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.99
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	0.95
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.81
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.80

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	48.30
	フランス	9.67
	イタリア	8.70
	イギリス	6.29
	ドイツ	5.60
	スペイン	5.27
	ベルギー	2.42
	その他	12.33
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

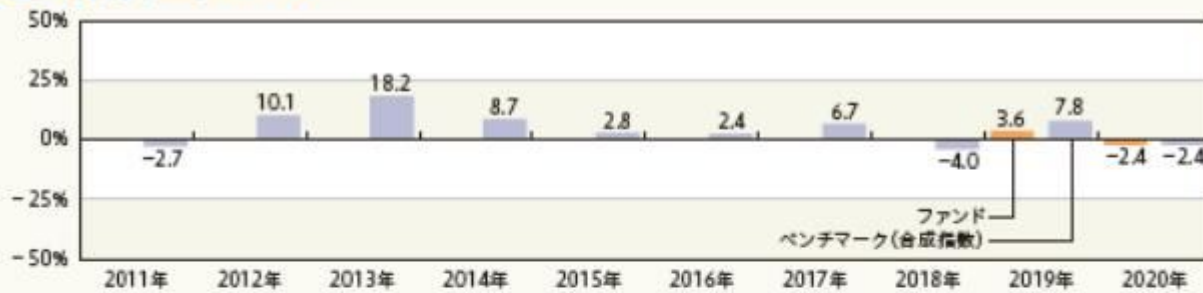
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2024/06/30	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2021/07/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2021/02/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3.125	2028/11/15	0.49
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	4.750	2034/07/04	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2029/05/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.43

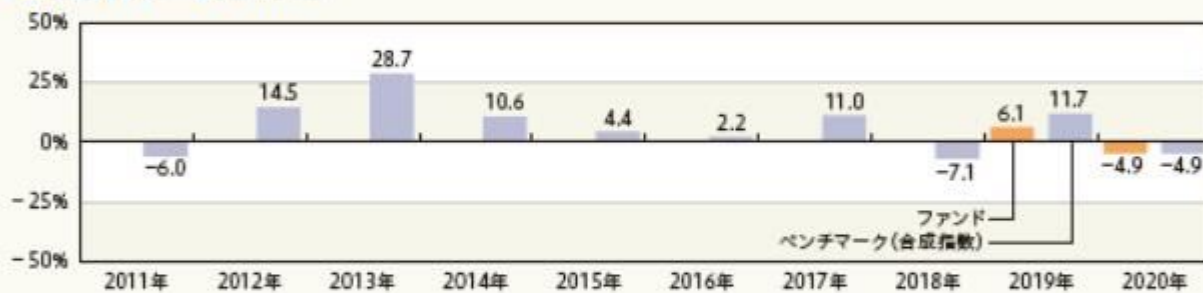
※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■マイパッケージNEXT30



■マイパッケージNEXT50



■マイパッケージNEXT70



※2019年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2019年6月28日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2020年の収益率は、年初から2020年2月28日までの騰落率を表示しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

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

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

(ロ) 原則として午後3時まで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、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

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

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかか

る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

当初自己設定：1口当たり1円です。

継続申込期間：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

ありません。

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DS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

（イ）当初自己設定

委託会社は、設定日（2019年6月28日）に、当初自己設定にかかる発行価額の総額を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みます。

（ロ）継続申込期間

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を

取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「マイパッケージNEXT30」は「マイN30」、「マイパッケージNEXT50」は「マイN50」、「マイパッケージNEXT70」は「マイN70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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】

2019年6月28日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ 信託の終了

（イ）信託契約の解約

- a．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、上記aの事項について、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、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、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。
- d．書面決議は議決権を行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。

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に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。
委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b．分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支

払われます。

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

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。

八 信託約款の変更等

- (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、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。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。
- (ニ) 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(ニ)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であっても、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、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、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します。)に支払われます。

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

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1期(令和1年6月28日から令和2年2月18日まで)の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		(令和2年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		49,098
コール・ローン		3,167
親投資信託受益証券		984,490
流動資産合計		1,036,755
資産合計		1,036,755
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		42
未払委託者報酬		179
その他未払費用		1
流動負債合計		222
負債合計		222
純資産の部		
元本等		
元本		1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		36,533
元本等合計		1,036,533
純資産合計		1,036,533
負債純資産合計		1,036,755

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	37,490
営業収益合計	37,490
営業費用	
受託者報酬	191
委託者報酬	765
その他費用	1
営業費用合計	957
営業利益又は営業損失 ()	36,533
経常利益又は経常損失 ()	36,533
当期純利益又は当期純損失 ()	36,533
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 ()	-
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	36,533

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期
	（ 令和 2年 2月18日現在 ）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,000,000口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0365円 (10,000口当たりの純資産額 10,365円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,405円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（27,128円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は36,533円（1万口当たり365.33円）であります。分配を行っておりません。</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	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。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 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>

項目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
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。

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	(令和 2年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	34,721円
合計	34,721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1期

自 令和 1年 6月28日

至 令和 2年 2月18日

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

(その他の注記)

項 目	第1期 (令和 2年 2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	-円
期中一部解約元本額	-円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	74,615	198,617	
	外国株式インデックス・マザーファンド	26,000	108,126	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	56,364	103,783	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	442,976	573,964	
合計		599,955	984,490	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・年金バランス50（標準型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		（令和2年2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		109,001
コール・ローン		7,030
親投資信託受益証券		2,163,911
流動資産合計		2,279,942
資産合計		2,279,942
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		42
未払委託者報酬		180
その他未払費用		1
流動負債合計		223
負債合計		223
純資産の部		
元本等		
元本		2,156,528
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		123,191
元本等合計		2,279,719
純資産合計		2,279,719
負債純資産合計		2,279,942

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	52,911
営業収益合計	52,911
営業費用	
受託者報酬	192
委託者報酬	769
その他費用	1
営業費用合計	962
営業利益又は営業損失（ ）	51,949
経常利益又は経常損失（ ）	51,949
当期純利益又は当期純損失（ ）	51,949
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（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	71,242
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	71,242
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	123,191

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期
	（ 令和 2年 2月18日現在 ）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,156,528口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0571円 (10,000口当たりの純資産額 10,571円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,189円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（40,760円）、収益調整金（71,242円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は123,191円（1万口当たり571.22円）であります。分配を行っておりませ</p> <p>ん。</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	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。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 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>

項目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
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。

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	(令和 2年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	49,916円
合計	49,916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1期

自 令和 1年 6月28日

至 令和 2年 2月18日

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

(その他の注記)

項目	第1期 (令和 2年 2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,156,528円
期中一部解約元本額	-円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	295,775	787,323	
	外国株式インデックス・マザーファンド	82,549	343,296	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	124,199	228,687	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	620,981	804,605	
合計		1,123,504	2,163,911	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		（令和2年2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		50,973
コール・ローン		3,287
親投資信託受益証券		1,024,437
流動資産合計		1,078,697
資産合計		1,078,697
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		43
未払委託者報酬		182
その他未払費用		1
流動負債合計		226
負債合計		226
純資産の部		
元本等		
元本		1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		78,471
元本等合計		1,078,471
純資産合計		1,078,471
負債純資産合計		1,078,697

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	79,437
営業収益合計	79,437
営業費用	
受託者報酬	193
委託者報酬	772
その他費用	1
営業費用合計	966
営業利益又は営業損失 ()	78,471
経常利益又は経常損失 ()	78,471
当期純利益又は当期純損失 ()	78,471
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 ()	-
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	78,471

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期
	（ 令和 2年 2月18日現在 ）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,000,000口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0785円
	(10,000口当たりの純資産額 10,785円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,894円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（66,577円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は78,471円（1万口当たり784.71円）であります。分配を行っておりません。</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	第1期 自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。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 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>

項目	第1期
	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
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。

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	(令和 2年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	77,151円
合計	77,151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1期

自 令和 1年 6月28日

至 令和 2年 2月18日

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

（その他の注記）

項目	第1期 (令和 2年 2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	-円
期中一部解約元本額	-円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	195,612	520,699	
	外国株式インデックス・マザーファンド	55,524	230,907	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	59,106	108,831	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	126,573	164,000	
合計		436,815	1,024,437	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位：円)	
(令和 2年 2月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,374,330,437
コール・ローン	217,628,532
株式	165,239,345,060
派生商品評価勘定	33,900
未収配当金	274,012,742
前払金	105,020,000
流動資産合計	<u>169,210,370,671</u>
資産合計	<u>169,210,370,671</u>
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	105,302,500
未払金	50,590,000
未払解約金	55,889,728
未払利息	643
その他未払費用	37,546
流動負債合計	<u>211,820,417</u>
負債合計	<u>211,820,417</u>
純資産の部	
元本等	
元本	63,487,344,187
剰余金	
剰余金又は欠損金()	<u>105,511,206,067</u>
元本等合計	<u>168,998,550,254</u>
純資産合計	<u>168,998,550,254</u>
負債純資産合計	<u>169,210,370,671</u>

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和2年2月18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 style="text-align: right;">株式 3,037,600,000円</p>	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,487,344,187口	
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.6619円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,619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 令和1年6月28日 至 令和2年2月18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>	
	(1) 金融商品の内容	

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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</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	(令和 2年 2月18日現在)
-----	-----------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(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 2年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600
	東証株価指数先物	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600
	合計	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600

(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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

（令和 2年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,179,274,809円
同期中における追加設定元本額	6,667,199,934円
同期中における一部解約元本額	11,359,130,556円
令和 2年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,962,956,005円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	899,792,988円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,246,929,769円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,050,011,107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）	147,935,771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）	7,077,011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）	24,690,524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）	66,210,067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）	111,561,135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）	75,508,956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）	164,558,698円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,418,399,205円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	12,163,001,184円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	694,688,267円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	710,823,587円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	541,400,084円
イオン・バランス戦略ファンド	43,891,805円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	13,245,790円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	68,627,795円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	59,324,587円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	171,410,982円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	88,467,156円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	109,282,288円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,855,913円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	1,145,713円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	74,615円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	295,775円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	195,612円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,710,915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）	3,602,416,183円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	23,376,394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＞	201,884,802円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,889,783,682円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,239,982,115円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,216,696,177円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	52,551,780円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	204,406,548円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	764,319円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	879,952,814円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	54,695,884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 >	341,485,545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 >	1,024,074,965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 >	834,268,065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 >	2,684,197,713円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,100,852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 >	58,764,376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 >	69,407,060円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	42,189,224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 >	21,110,955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 >	173,909,824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 >	336,437,232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 >	103,508,877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 >	57,354,700円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,142,133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 >	65,926,808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 >	845,306,433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)	193,966,679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 >	16,650,131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 >	982,474,504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 >	176,502,720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 >	1,461,440,781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 >	102,546,812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 >	23,212,563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 >	76,939,106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 >	70,210,715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 >	489,631,412円
合計	63,487,344,187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	3,600	2,815.00	10,134,000	
日本水産	95,800	617.00	59,108,600	
マルハニチロ	13,800	2,604.00	35,935,200	
カネコ種苗	4,300	1,337.00	5,749,100	
サカタのタネ	10,900	3,350.00	36,515,000	
ホクト	7,200	1,973.00	14,205,600	
日鉄鉱業	2,500	4,290.00	10,725,000	

三井松島ホールディングス	3,300	1,125.00	3,712,500
国際石油開発帝石	384,900	1,041.50	400,873,350
石油資源開発	12,400	2,754.00	34,149,600
K & O エナジーグループ	5,300	1,694.00	8,978,200
ヒノキヤグループ	3,200	2,009.00	6,428,800
ショーボンドホールディングス	15,300	4,295.00	65,713,500
ミライト・ホールディングス	27,600	1,496.00	41,289,600
タマホーム	5,500	1,423.00	7,826,500
スペースバリューホールディングス	13,800	527.00	7,272,600
安藤・間	57,300	859.00	49,220,700
東急建設	28,000	742.00	20,776,000
コムシスホールディングス	33,800	2,911.00	98,391,800
ピーアールホールディングス	13,000	477.00	6,201,000
高松コンストラクショングループ	6,000	2,602.00	15,612,000
東建コーポレーション	2,800	8,140.00	22,792,000
大成建設	73,400	4,120.00	302,408,000
大林組	220,700	1,224.00	270,136,800
清水建設	223,800	1,083.00	242,375,400
飛鳥建設	8,000	1,355.00	10,840,000
長谷工コーポレーション	84,400	1,426.00	120,354,400
松井建設	11,200	736.00	8,243,200
銭高組	1,300	4,005.00	5,206,500
鹿島建設	172,200	1,297.00	223,343,400
不動テトラ	7,000	1,611.00	11,277,000
大末建設	5,400	936.00	5,054,400
鉄建建設	5,100	2,627.00	13,397,700
西松建設	17,700	2,454.00	43,435,800
三井住友建設	56,000	607.00	33,992,000
大豊建設	5,100	2,542.00	12,964,200
前田建設工業	56,700	1,093.00	61,973,100
奥村組	12,600	2,844.00	35,834,400
東鉄工業	9,000	3,155.00	28,395,000
浅沼組	3,000	5,140.00	15,420,000
戸田建設	92,700	712.00	66,002,400
熊谷組	10,300	3,130.00	32,239,000
北野建設	2,000	2,501.00	5,002,000
矢作建設工業	12,100	835.00	10,103,500
ピーエス三菱	10,600	643.00	6,815,800
日本ハウスホールディングス	20,000	437.00	8,740,000
大東建託	26,500	12,495.00	331,117,500
新日本建設	10,400	873.00	9,079,200
N I P P O	17,700	2,660.00	47,082,000

東亜道路工業	1,800	3,380.00	6,084,000
前田道路	23,200	3,685.00	85,492,000
日本道路	2,300	7,250.00	16,675,000
東亜建設工業	8,300	1,770.00	14,691,000
日本国土開発	15,000	599.00	8,985,000
若築建設	5,300	1,649.00	8,739,700
東洋建設	26,100	502.00	13,102,200
五洋建設	89,300	662.00	59,116,600
世紀東急工業	13,300	885.00	11,770,500
福田組	2,800	4,600.00	12,880,000
住友林業	55,300	1,677.00	92,738,100
日本基礎技術	12,200	361.00	4,404,200
巴コーポレーション	14,400	374.00	5,385,600
大和ハウス工業	218,400	3,343.00	730,111,200
ライト工業	12,600	1,471.00	18,534,600
積水ハウス	241,500	2,345.50	566,438,250
ユアテック	16,800	645.00	10,836,000
中電工	8,200	2,456.00	20,139,200
関電工	29,200	1,005.00	29,346,000
きんでん	51,800	1,781.00	92,255,800
東京エネシス	9,400	849.00	7,980,600
トーエネック	2,900	3,610.00	10,469,000
住友電設	6,300	2,466.00	15,535,800
日本電設工業	11,200	2,216.00	24,819,200
協和エクシオ	33,300	2,581.00	85,947,300
新日本空調	6,100	1,975.00	12,047,500
九電工	15,500	3,130.00	48,515,000
三機工業	15,700	1,354.00	21,257,800
日揮ホールディングス	68,600	1,541.00	105,712,600
中外炉工業	3,200	1,718.00	5,497,600
ヤマト	9,400	740.00	6,956,000
太平電業	5,700	2,508.00	14,295,600
高砂熱学工業	18,600	1,845.00	34,317,000
朝日工業社	2,100	3,195.00	6,709,500
明星工業	14,700	791.00	11,627,700
大気社	10,700	3,440.00	36,808,000
ダイダン	5,500	2,776.00	15,268,000
日比谷総合設備	7,400	1,920.00	14,208,000
OSJBホールディングス	41,700	261.00	10,883,700
レイズネクスト	12,600	1,310.00	16,506,000
日本製粉	20,200	1,647.00	33,269,400
日清製粉グループ本社	79,400	1,878.00	149,113,200

昭和産業	7,100	3,045.00	21,619,500
鳥越製粉	8,500	824.00	7,004,000
中部飼料	8,900	1,610.00	14,329,000
フィード・ワン	53,400	172.00	9,184,800
日本甜菜製糖	4,700	1,833.00	8,615,100
三井製糖	5,900	2,091.00	12,336,900
日新製糖	3,400	2,005.00	6,817,000
森永製菓	16,500	4,760.00	78,540,000
中村屋	2,500	4,020.00	10,050,000
江崎グリコ	21,000	4,725.00	99,225,000
名糖産業	4,900	1,400.00	6,860,000
井村屋グループ	3,800	1,910.00	7,258,000
不二家	4,300	2,330.00	10,019,000
山崎製パン	53,300	2,044.00	108,945,200
モロゾフ	1,700	4,915.00	8,355,500
亀田製菓	4,000	4,770.00	19,080,000
寿スピリッツ	6,700	6,450.00	43,215,000
カルビー	32,200	3,050.00	98,210,000
森永乳業	13,300	4,135.00	54,995,500
六甲バター	5,300	1,542.00	8,172,600
ヤクルト本社	48,500	5,370.00	260,445,000
明治ホールディングス	46,500	7,170.00	333,405,000
雪印メグミルク	17,100	2,439.00	41,706,900
プリマハム	10,700	2,436.00	26,065,200
日本ハム	26,900	4,695.00	126,295,500
丸大食品	7,000	1,991.00	13,937,000
S Foods	5,400	2,697.00	14,563,800
伊藤ハム米久ホールディングス	45,300	668.00	30,260,400
サッポロホールディングス	24,400	2,501.00	61,024,400
アサヒグループホールディングス	148,000	4,735.00	700,780,000
キリンホールディングス	299,600	2,311.50	692,525,400
宝ホールディングス	53,700	912.00	48,974,400
オエノンホールディングス	22,200	389.00	8,635,800
養命酒製造	3,500	1,929.00	6,751,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	49,800	2,955.00	147,159,000
サントリー食品インターナショナル	47,000	4,615.00	216,905,000
ダイトーグループホールディングス	3,500	3,945.00	13,807,500
伊藤園	21,300	5,430.00	115,659,000
キーコーヒー	6,700	2,262.00	15,155,400
日清オイリオグループ	8,800	3,700.00	32,560,000
不二製油グループ本社	17,300	2,757.00	47,696,100
かどや製油	1,300	3,820.00	4,966,000

J - オイルミルズ	3,600	4,230.00	15,228,000
キッコーマン	50,600	5,810.00	293,986,000
味の素	157,200	1,959.00	307,954,800
キューピー	39,400	2,159.00	85,064,600
ハウス食品グループ本社	26,300	3,425.00	90,077,500
カゴメ	27,100	2,725.00	73,847,500
焼津水産化学工業	5,700	1,016.00	5,791,200
アリアケジャパン	6,400	7,470.00	47,808,000
ニチレイ	33,600	2,754.00	92,534,400
東洋水産	36,100	4,575.00	165,157,500
イトアンド	3,700	1,826.00	6,756,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,400	1,112.00	4,892,800
日清食品ホールディングス	29,900	8,850.00	264,615,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,122.00	8,912,400
一正蒲鉾	4,300	955.00	4,106,500
フジッコ	7,600	1,905.00	14,478,000
ロック・フィールド	7,800	1,419.00	11,068,200
日本たばこ産業	407,700	2,251.00	917,732,700
ケンコーマヨネーズ	4,400	2,192.00	9,644,800
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,845.00	9,409,500
なとり	5,400	1,710.00	9,234,000
ピクルスコーポレーション	2,000	2,639.00	5,278,000
北の達人コーポレーション	23,600	621.00	14,655,600
ユーグレナ	29,100	816.00	23,745,600
ミヨシ油脂	4,300	1,068.00	4,592,400
理研ビタミン	4,000	3,920.00	15,680,000
片倉工業	11,100	1,351.00	14,996,100
ゲンゼ	5,100	4,130.00	21,063,000
東洋紡	28,200	1,490.00	42,018,000
ユニチカ	23,700	353.00	8,366,100
富士紡ホールディングス	3,900	3,435.00	13,396,500
倉敷紡績	7,100	2,302.00	16,344,200
日本毛織	22,500	1,027.00	23,107,500
ダイドーリミテッド	15,000	266.00	3,990,000
帝国繊維	8,300	2,202.00	18,276,600
帝人	55,300	1,981.00	109,549,300
東レ	500,400	697.00	348,778,800
住江織物	2,600	2,355.00	6,123,000
アツギ	9,600	802.00	7,699,200
ダイニック	6,400	801.00	5,126,400
セーレン	16,900	1,574.00	26,600,600
小松マテーレ	12,800	797.00	10,201,600

ワコールホールディングス	18,200	2,798.00	50,923,600
ホギメディカル	8,000	3,290.00	26,320,000
レナウン	35,000	103.00	3,605,000
T S Iホールディングス	24,500	507.00	12,421,500
マツオカコーポレーション	2,800	2,043.00	5,720,400
ワールド	10,000	2,361.00	23,610,000
三陽商会	5,100	1,523.00	7,767,300
オンワードホールディングス	41,700	614.00	25,603,800
ゴールドウイン	12,600	7,160.00	90,216,000
デサント	13,900	1,671.00	23,226,900
特種東海製紙	4,400	4,045.00	17,798,000
王子ホールディングス	285,300	572.00	163,191,600
日本製紙	30,700	1,731.00	53,141,700
三菱製紙	11,700	441.00	5,159,700
北越コーポレーション	45,700	492.00	22,484,400
中越パルプ工業	4,300	1,490.00	6,407,000
大王製紙	29,400	1,447.00	42,541,800
レンゴー	65,300	804.00	52,501,200
トーモク	5,100	1,712.00	8,731,200
ザ・パック	5,000	4,110.00	20,550,000
クラレ	108,000	1,287.00	138,996,000
旭化成	459,400	1,028.00	472,263,200
昭和電工	48,700	2,677.00	130,369,900
住友化学	507,300	450.00	228,285,000
住友精化	3,300	3,105.00	10,246,500
日産化学	38,500	5,090.00	195,965,000
ラサ工業	3,300	1,432.00	4,725,600
クレハ	5,800	5,890.00	34,162,000
多木化学	2,300	4,565.00	10,499,500
テイカ	7,200	1,670.00	12,024,000
石原産業	12,900	824.00	10,629,600
日本曹達	10,200	3,195.00	32,589,000
東ソー	105,200	1,614.00	169,792,800
トクヤマ	19,900	2,715.00	54,028,500
セントラル硝子	14,500	2,306.00	33,437,000
東亜合成	43,600	1,229.00	53,584,400
大阪ソーダ	6,900	2,763.00	19,064,700
関東電化工業	16,800	1,029.00	17,287,200
デンカ	24,900	2,928.00	72,907,200
信越化学工業	118,400	13,365.00	1,582,416,000
日本カーバイド工業	3,200	1,286.00	4,115,200
堺化学工業	4,600	2,222.00	10,221,200

第一稀元素化学工業	9,400	872.00	8,196,800
エア・ウォーター	55,700	1,541.00	85,833,700
大陽日酸	66,200	2,183.00	144,514,600
日本化学工業	2,400	2,647.00	6,352,800
日本パーカラライジング	35,400	1,084.00	38,373,600
高压ガス工業	12,400	774.00	9,597,600
チタン工業	1,800	2,177.00	3,918,600
四国化成工業	10,400	1,246.00	12,958,400
戸田工業	2,500	2,060.00	5,150,000
ステラ ケミファ	4,000	3,295.00	13,180,000
保土谷化学工業	2,800	4,395.00	12,306,000
日本触媒	10,800	6,030.00	65,124,000
大日精化工業	6,200	2,673.00	16,572,600
カネカ	17,700	3,245.00	57,436,500
三菱瓦斯化学	64,500	1,827.00	117,841,500
三井化学	62,600	2,583.00	161,695,800
J S R	64,300	2,120.00	136,316,000
東京応化工業	12,000	4,495.00	53,940,000
大阪有機化学工業	7,200	1,720.00	12,384,000
三菱ケミカルホールディングス	461,000	795.10	366,541,100
K Hネオケム	12,300	2,420.00	29,766,000
ダイセル	94,000	1,014.00	95,316,000
住友ベークライト	10,900	3,555.00	38,749,500
積水化学工業	148,200	1,811.00	268,390,200
日本ゼオン	62,300	1,213.00	75,569,900
アイカ工業	20,700	3,445.00	71,311,500
宇部興産	34,200	2,176.00	74,419,200
積水樹脂	12,300	2,394.00	29,446,200
タキロンシーアイ	16,100	634.00	10,207,400
旭有機材	4,500	1,613.00	7,258,500
日立化成	31,900	4,605.00	146,899,500
ニチバン	4,100	1,685.00	6,908,500
リケンテクノス	19,200	461.00	8,851,200
大倉工業	3,900	1,654.00	6,450,600
積水化成成品工業	10,200	682.00	6,956,400
群栄化学工業	2,400	2,436.00	5,846,400
ミライアル	3,300	1,172.00	3,867,600
ダイキョーニシカワ	14,400	731.00	10,526,400
森六ホールディングス	4,100	2,169.00	8,892,900
日本化薬	43,100	1,290.00	55,599,000
カーリットホールディングス	9,500	557.00	5,291,500
日本精化	6,700	1,403.00	9,400,100

扶桑化学工業	6,900	3,440.00	23,736,000
トリケミカル研究所	1,600	10,020.00	16,032,000
A D E K A	31,900	1,556.00	49,636,400
日油	25,900	3,630.00	94,017,000
ハリマ化成グループ	6,200	1,069.00	6,627,800
花王	168,500	8,513.00	1,434,440,500
第一工業製薬	2,900	4,325.00	12,542,500
三洋化成工業	4,000	4,815.00	19,260,000
大日本塗料	9,100	1,079.00	9,818,900
日本ペイントホールディングス	56,800	5,090.00	289,112,000
関西ペイント	77,600	2,487.00	192,991,200
中国塗料	20,300	946.00	19,203,800
日本特殊塗料	5,900	1,187.00	7,003,300
藤倉化成	13,200	535.00	7,062,000
太陽ホールディングス	5,000	4,750.00	23,750,000
D I C	28,700	2,981.00	85,554,700
サカタインクス	15,100	1,150.00	17,365,000
東洋インキS Cホールディングス	13,900	2,429.00	33,763,100
T & K T O K A	7,100	954.00	6,773,400
富士フィルムホールディングス	134,800	5,388.00	726,302,400
資生堂	139,800	6,998.00	978,320,400
ライオン	91,300	2,048.00	186,982,400
高砂香料工業	4,600	2,310.00	10,626,000
マンダム	15,800	2,520.00	39,816,000
ミルボン	9,400	6,010.00	56,494,000
ファンケル	28,600	3,035.00	86,801,000
コーセー	13,200	14,290.00	188,628,000
コタ	5,100	1,447.00	7,379,700
ポーラ・オルビスホールディングス	30,000	2,353.00	70,590,000
ノエビアホールディングス	6,600	5,090.00	33,594,000
エステー	5,400	1,615.00	8,721,000
アグロ カネショウ	3,300	1,433.00	4,728,900
コニシ	11,800	1,535.00	18,113,000
長谷川香料	9,700	2,170.00	21,049,000
小林製薬	19,700	8,570.00	168,829,000
荒川化学工業	7,000	1,513.00	10,591,000
メック	5,400	1,477.00	7,975,800
タカラバイオ	18,700	2,342.00	43,795,400
J C U	8,700	2,891.00	25,151,700
デクセリアルズ	19,000	900.00	17,100,000
アース製薬	5,300	6,030.00	31,959,000
北興化学工業	9,100	614.00	5,587,400

大成ラミック	3,300	2,805.00	9,256,500
クミアイ化学工業	29,500	835.00	24,632,500
日本農薬	14,600	541.00	7,898,600
アキレス	5,600	2,130.00	11,928,000
有沢製作所	11,700	922.00	10,787,400
日東電工	48,200	6,050.00	291,610,000
レック	8,100	1,163.00	9,420,300
三光合成	11,600	333.00	3,862,800
藤森工業	6,100	3,305.00	20,160,500
前澤化成工業	6,600	1,118.00	7,378,800
未来工業	4,500	2,058.00	9,261,000
J S P	4,600	1,775.00	8,165,000
エフピコ	7,800	6,730.00	52,494,000
天馬	5,300	1,943.00	10,297,900
信越ポリマー	12,600	947.00	11,932,200
東リ	23,100	291.00	6,722,100
ニフコ	25,500	2,908.00	74,154,000
バルカー	5,900	2,341.00	13,811,900
ユニ・チャーム	136,100	3,904.00	531,334,400
協和キリン	70,200	2,759.00	193,681,800
武田薬品工業	585,600	4,206.00	2,463,033,600
アステラス製薬	619,500	1,869.50	1,158,155,250
大日本住友製薬	52,500	1,743.00	91,507,500
塩野義製薬	89,900	6,504.00	584,709,600
あすか製薬	9,000	1,133.00	10,197,000
日本新薬	18,400	9,290.00	170,936,000
中外製薬	73,400	11,735.00	861,349,000
科研製薬	12,200	5,870.00	71,614,000
エーザイ	84,300	8,775.00	739,732,500
ロート製薬	35,900	3,345.00	120,085,500
小野薬品工業	162,000	2,534.00	410,508,000
久光製薬	18,700	5,450.00	101,915,000
持田製薬	10,000	4,215.00	42,150,000
参天製薬	130,900	1,969.00	257,742,100
扶桑薬品工業	3,600	1,880.00	6,768,000
日本ケミファ	1,500	2,524.00	3,786,000
ツムラ	22,100	2,811.00	62,123,100
日医工	20,100	1,340.00	26,934,000
キッセイ薬品工業	12,800	2,850.00	36,480,000
生化学工業	14,200	1,228.00	17,437,600
栄研化学	12,800	2,258.00	28,902,400
鳥居薬品	4,500	3,565.00	16,042,500

JCRファーマ	5,000	10,300.00	51,500,000	
東和薬品	9,000	2,380.00	21,420,000	
富士製薬工業	5,600	1,260.00	7,056,000	
沢井製薬	14,700	6,920.00	101,724,000	
ゼリア新薬工業	13,000	1,962.00	25,506,000	
第一三共	201,400	7,527.00	1,515,937,800	
キョーリン製薬ホールディングス	14,700	2,141.00	31,472,700	
大幸薬品	3,300	5,680.00	18,744,000	
ダイト	4,400	3,510.00	15,444,000	
大塚ホールディングス	134,100	4,546.00	609,618,600	
大正製薬ホールディングス	14,800	7,110.00	105,228,000	
ペプチドリーム	35,700	5,000.00	178,500,000	
日本コークス工業	81,700	75.00	6,127,500	
ニチレキ	9,500	1,385.00	13,157,500	
ユシロ化学工業	5,900	1,333.00	7,864,700	
富士石油	25,200	230.00	5,796,000	
出光興産	79,100	2,854.00	225,751,400	
JXTGホールディングス	1,060,700	467.00	495,346,900	
コスモエネルギーホールディングス	20,700	1,967.00	40,716,900	
横浜ゴム	40,700	2,011.00	81,847,700	
TOYO TIRE	41,200	1,622.00	66,826,400	
ブリヂストン	216,700	3,903.00	845,780,100	
住友ゴム工業	63,400	1,229.00	77,918,600	
オカモト	4,500	3,585.00	16,132,500	
ニッタ	7,900	2,984.00	23,573,600	
住友理工	13,700	842.00	11,535,400	
三ツ星ベルト	9,600	1,724.00	16,550,400	
バンドー化学	13,500	805.00	10,867,500	
日東紡績	10,600	4,975.00	52,735,000	
AGC	69,500	3,460.00	240,470,000	
日本板硝子	21,500	574.00	12,341,000	
日本山村硝子	5,400	1,178.00	6,361,200	
日本電気硝子	28,500	2,064.00	58,824,000	
オハラ	3,600	1,243.00	4,474,800	
住友大阪セメント	13,700	4,140.00	56,718,000	
太平洋セメント	44,500	2,990.00	133,055,000	
日本ヒューム	9,300	775.00	7,207,500	
日本コンクリート工業	20,500	282.00	5,781,000	
三谷セキサン	3,500	3,770.00	13,195,000	
アジアパイルホールディングス	13,300	521.00	6,929,300	
東海カーボン	73,800	1,011.00	74,611,800	
日本カーボン	3,700	3,895.00	14,411,500	

東洋炭素	4,600	1,999.00	9,195,400
ノリタケカンパニーリミテド	4,000	4,175.00	16,700,000
TOTO	50,300	4,665.00	234,649,500
日本碍子	85,400	1,872.00	159,868,800
日本特殊陶業	54,600	1,920.00	104,832,000
MARUWA	2,800	7,570.00	21,196,000
品川リフラクトリーズ	2,400	2,892.00	6,940,800
黒崎播磨	1,500	6,390.00	9,585,000
ヨータイ	8,200	676.00	5,543,200
東京窯業	16,500	309.00	5,098,500
フジミインコーポレーテッド	6,400	3,010.00	19,264,000
ニチアス	19,300	2,490.00	48,057,000
ニチハ	9,700	2,512.00	24,366,400
日本製鉄	311,500	1,453.50	452,765,250
神戸製鋼所	129,300	475.00	61,417,500
中山製鋼所	13,000	457.00	5,941,000
合同製鐵	4,100	2,707.00	11,098,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	187,900	1,174.00	220,594,600
東京製鐵	34,200	790.00	27,018,000
共英製鋼	8,000	1,862.00	14,896,000
大和工業	15,100	2,496.00	37,689,600
東京鐵鋼	4,000	1,395.00	5,580,000
大阪製鐵	4,500	1,625.00	7,312,500
淀川製鋼所	9,100	1,988.00	18,090,800
丸一鋼管	22,900	2,873.00	65,791,700
モリ工業	2,700	2,639.00	7,125,300
大同特殊鋼	11,400	4,285.00	48,849,000
日本冶金工業	5,900	1,983.00	11,699,700
山陽特殊製鋼	5,400	1,449.00	7,824,600
愛知製鋼	3,900	3,340.00	13,026,000
日立金属	74,900	1,665.00	124,708,500
大平洋金属	4,900	2,352.00	11,524,800
新日本電工	50,200	176.00	8,835,200
栗本鐵工所	4,300	2,101.00	9,034,300
三菱製鋼	6,700	990.00	6,633,000
シンニッタン	14,700	443.00	6,512,100
大紀アルミニウム工業所	11,200	665.00	7,448,000
日本輕金属ホールディングス	178,000	208.00	37,024,000
三井金属鉱業	18,900	2,850.00	53,865,000
東邦亜鉛	4,000	1,834.00	7,336,000
三菱マテリアル	45,700	2,834.00	129,513,800
住友金属鉱山	89,200	3,083.00	275,003,600

DOWAホールディングス	17,600	3,840.00	67,584,000
古河機械金属	12,500	1,339.00	16,737,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,800	1,296.00	10,108,800
東邦チタニウム	13,700	848.00	11,617,600
UACJ	10,700	2,132.00	22,812,400
CKサンエツ	1,800	3,280.00	5,904,000
古河電気工業	21,500	2,564.00	55,126,000
住友電気工業	260,000	1,457.00	378,820,000
フジクラ	85,900	380.00	32,642,000
昭和電線ホールディングス	9,600	1,300.00	12,480,000
タツタ電線	15,300	568.00	8,690,400
リョービ	8,500	1,684.00	14,314,000
アーレスティ	11,500	499.00	5,738,500
アサヒホールディングス	12,500	2,688.00	33,600,000
稲葉製作所	5,500	1,342.00	7,381,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,969.00	6,497,700
トーカロ	19,400	1,118.00	21,689,200
アルファC o	4,300	1,184.00	5,091,200
SUMCO	83,500	1,794.00	149,799,000
川田テクノロジーズ	1,700	6,380.00	10,846,000
RS Technologies	2,200	2,691.00	5,920,200
東洋製罐グループホールディングス	44,600	1,956.00	87,237,600
ホッカンホールディングス	4,800	1,847.00	8,865,600
コロナ	5,900	999.00	5,894,100
横河ブリッジホールディングス	13,000	2,169.00	28,197,000
三和ホールディングス	66,800	1,105.00	73,814,000
文化シャッター	21,200	841.00	17,829,200
三協立山	10,500	1,354.00	14,217,000
アルインコ	7,000	1,107.00	7,749,000
LIXILグループ	103,000	1,877.00	193,331,000
ノーリツ	14,900	1,297.00	19,325,300
長府製作所	7,200	2,239.00	16,120,800
リンナイ	13,600	7,710.00	104,856,000
日東精工	13,000	540.00	7,020,000
岡部	14,600	851.00	12,424,600
ジーテクト	8,700	1,482.00	12,893,400
東プレ	12,900	1,626.00	20,975,400
高周波熱錬	14,200	839.00	11,913,800
東京製綱	6,700	956.00	6,405,200
パイオラックス	10,200	1,820.00	18,564,000
エイチワン	9,300	658.00	6,119,400
日本発條	75,000	911.00	68,325,000

三益半導体工業	6,200	2,209.00	13,695,800
日本製鋼所	21,500	1,880.00	40,420,000
三浦工業	30,100	3,940.00	118,594,000
タクマ	23,700	1,235.00	29,269,500
ツガミ	14,800	952.00	14,089,600
オークマ	8,000	4,995.00	39,960,000
東芝機械	7,900	3,260.00	25,754,000
アマダホールディングス	87,300	1,093.00	95,418,900
アイダエンジニアリング	18,200	875.00	15,925,000
F U J I	28,700	1,885.00	54,099,500
牧野フライス製作所	8,000	4,155.00	33,240,000
オーエスジー	32,400	1,783.00	57,769,200
旭ダイヤモンド工業	19,100	575.00	10,982,500
D M G 森精機	43,900	1,543.00	67,737,700
ソディック	16,700	826.00	13,794,200
ディスコ	9,400	24,250.00	227,950,000
日東工器	4,300	2,499.00	10,745,700
日進工具	2,100	2,746.00	5,766,600
パンチ工業	9,200	427.00	3,928,400
豊和工業	5,700	771.00	4,394,700
島精機製作所	11,300	1,970.00	22,261,000
オプトラン	8,000	3,220.00	25,760,000
イワキポンプ	4,500	1,111.00	4,999,500
フリー	8,600	1,192.00	10,251,200
ヤマシンフィルタ	15,200	731.00	11,111,200
日阪製作所	10,300	956.00	9,846,800
やまびこ	13,800	1,014.00	13,993,200
平田機工	3,300	5,850.00	19,305,000
ペガサスミシン製造	10,700	454.00	4,857,800
マルマエ	3,500	911.00	3,188,500
タツモ	3,600	1,201.00	4,323,600
ナプテスコ	40,900	3,310.00	135,379,000
三井海洋開発	7,600	2,056.00	15,625,600
レオン自動機	6,900	1,387.00	9,570,300
S M C	22,100	47,690.00	1,053,949,000
ホソカワミクロン	2,700	5,360.00	14,472,000
ユニオンツール	2,600	3,025.00	7,865,000
オイレス工業	9,300	1,536.00	14,284,800
日精エー・エス・ビー機械	2,600	4,055.00	10,543,000
サトーホールディングス	10,100	2,764.00	27,916,400
技研製作所	6,400	4,440.00	28,416,000
日精樹脂工業	7,300	943.00	6,883,900

ワイエイシイホールディングス	4,100	605.00	2,480,500
小松製作所	318,700	2,300.00	733,010,000
住友重機械工業	39,800	2,687.00	106,942,600
日立建機	27,500	2,950.00	81,125,000
日工	12,400	776.00	9,622,400
巴工業	3,900	2,124.00	8,283,600
井関農機	7,900	1,354.00	10,696,600
T O W A	7,800	1,082.00	8,439,600
北川鉄工所	3,600	2,007.00	7,225,200
ローツェ	3,200	3,925.00	12,560,000
クボタ	373,200	1,596.00	595,627,200
荏原実業	2,600	2,128.00	5,532,800
三菱化工機	3,700	1,890.00	6,993,000
月島機械	13,400	1,374.00	18,411,600
帝国電機製作所	7,100	1,470.00	10,437,000
新東工業	16,700	884.00	14,762,800
澁谷工業	6,300	2,772.00	17,463,600
アイチ コーポレーション	13,700	698.00	9,562,600
小森コーポレーション	17,600	923.00	16,244,800
鶴見製作所	6,100	1,886.00	11,504,600
住友精密工業	1,800	2,931.00	5,275,800
酒井重工業	1,900	2,610.00	4,959,000
荏原製作所	29,300	2,864.00	83,915,200
西島製作所	8,900	860.00	7,654,000
北越工業	8,500	1,272.00	10,812,000
ダイキン工業	89,700	15,290.00	1,371,513,000
オルガノ	2,600	7,090.00	18,434,000
トーヨーカネツ	3,900	2,467.00	9,621,300
栗田工業	37,800	3,190.00	120,582,000
椿本チエイン	9,600	3,235.00	31,056,000
大同工業	6,200	781.00	4,842,200
アネスト岩田	11,900	1,039.00	12,364,100
ダイフク	35,600	6,800.00	242,080,000
加藤製作所	4,500	1,460.00	6,570,000
タダノ	34,800	1,043.00	36,296,400
フジテック	25,100	1,660.00	41,666,000
C K D	19,700	1,885.00	37,134,500
キトー	6,000	1,649.00	9,894,000
平和	19,700	2,259.00	44,502,300
理想科学工業	6,600	1,948.00	12,856,800
S A N K Y O	16,100	3,815.00	61,421,500
日本金銭機械	9,400	770.00	7,238,000

マースグループホールディングス	5,500	2,026.00	11,143,000
フクシマガリレイ	4,400	3,815.00	16,786,000
ダイコク電機	4,500	1,403.00	6,313,500
竹内製作所	11,600	1,915.00	22,214,000
アマノ	18,500	2,921.00	54,038,500
J U K I	10,600	798.00	8,458,800
マックス	10,700	2,043.00	21,860,100
グローリー	19,700	3,065.00	60,380,500
新晃工業	6,900	1,626.00	11,219,400
大和冷機工業	10,700	1,102.00	11,791,400
セガサミーホールディングス	70,400	1,603.00	112,851,200
日本ピストンリング	4,400	1,417.00	6,234,800
リケン	3,400	3,485.00	11,849,000
T P R	9,000	1,641.00	14,769,000
ツバキ・ナカシマ	14,600	1,218.00	17,782,800
ホシザキ	20,600	10,260.00	211,356,000
大豊工業	7,400	681.00	5,039,400
日本精工	130,700	895.00	116,976,500
N T N	161,900	294.00	47,598,600
ジェイテクト	65,900	1,159.00	76,378,100
不二越	6,600	3,985.00	26,301,000
日本トムソン	22,900	430.00	9,847,000
T H K	40,800	2,738.00	111,710,400
ユーシン精機	6,700	897.00	6,009,900
前澤給装工業	3,700	2,181.00	8,069,700
イーグル工業	8,900	935.00	8,321,500
日本ピラー工業	7,800	1,524.00	11,887,200
キッツ	29,000	722.00	20,938,000
マキタ	91,500	4,165.00	381,097,500
日立造船	56,000	425.00	23,800,000
三菱重工業	117,700	3,838.00	451,732,600
I H I	50,900	2,729.00	138,906,100
スター精密	11,200	1,282.00	14,358,400
日清紡ホールディングス	47,800	1,001.00	47,847,800
イビデン	43,500	2,631.00	114,448,500
コニカミノルタ	155,100	658.00	102,055,800
ブラザー工業	85,500	2,135.00	182,542,500
ミネベアミツミ	130,100	2,131.00	277,243,100
日立製作所	338,300	4,074.00	1,378,234,200
三菱電機	704,000	1,551.00	1,091,904,000
富士電機	42,200	3,405.00	143,691,000
東洋電機製造	3,800	1,403.00	5,331,400

安川電機	75,600	3,740.00	282,744,000
シンフォニアテクノロジー	9,400	1,178.00	11,073,200
明電舎	13,100	1,990.00	26,069,000
オリジン	3,400	1,482.00	5,038,800
山洋電気	3,500	4,965.00	17,377,500
デンヨー	6,500	2,035.00	13,227,500
東芝テック	8,800	4,205.00	37,004,000
芝浦メカトロニクス	1,600	3,340.00	5,344,000
マブチモーター	19,300	4,165.00	80,384,500
日本電産	84,700	14,130.00	1,196,811,000
トレックス・セミコンダクター	4,900	1,438.00	7,046,200
東光高岳	5,500	1,146.00	6,303,000
宮越ホールディングス	3,900	824.00	3,213,600
ダイヘン	7,700	3,375.00	25,987,500
ヤーマン	11,200	632.00	7,078,400
JVCケンウッド	60,000	241.00	14,460,000
ミマキエンジニアリング	9,300	500.00	4,650,000
第一精工	4,000	2,503.00	10,012,000
日新電機	16,700	1,132.00	18,904,400
大崎電気工業	16,200	610.00	9,882,000
オムロン	63,100	6,590.00	415,829,000
日東工業	10,700	2,141.00	22,908,700
I D E C	10,500	1,851.00	19,435,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24,100	2,115.00	50,971,500
サクサホールディングス	3,000	1,817.00	5,451,000
メルコホールディングス	2,800	2,496.00	6,988,800
日本電気	85,400	4,725.00	403,515,000
富士通	67,900	12,350.00	838,565,000
沖電気工業	29,900	1,332.00	39,826,800
電気興業	3,700	3,285.00	12,154,500
サンケン電気	8,000	2,840.00	22,720,000
アイホン	5,100	1,679.00	8,562,900
ルネサスエレクトロニクス	336,300	754.00	253,570,200
セイコーエプソン	86,900	1,677.00	145,731,300
ワコム	47,800	392.00	18,737,600
アルバック	14,100	3,620.00	51,042,000
E I Z O	5,500	3,760.00	20,680,000
日本信号	18,500	1,350.00	24,975,000
京三製作所	19,000	547.00	10,393,000
能美防災	9,600	2,358.00	22,636,800
ホーチキ	6,000	1,382.00	8,292,000
エレコム	7,700	3,945.00	30,376,500

パナソニック	805,200	1,182.50	952,149,000
シャープ	81,600	1,490.00	121,584,000
アンリツ	45,700	1,999.00	91,354,300
富士通ゼネラル	19,800	2,438.00	48,272,400
ソニー	444,900	7,265.00	3,232,198,500
T D K	33,800	11,130.00	376,194,000
帝国通信工業	5,800	1,236.00	7,168,800
タムラ製作所	24,200	568.00	13,745,600
アルプスアルパイン	62,200	1,851.00	115,132,200
日本トリム	1,300	3,925.00	5,102,500
ローランド ディー . ジー .	4,800	1,838.00	8,822,400
フォスター電機	7,700	1,551.00	11,942,700
S M K	2,400	2,870.00	6,888,000
ヨコオ	4,600	2,887.00	13,280,200
ホシデン	19,300	1,092.00	21,075,600
ヒロセ電機	10,900	12,810.00	139,629,000
日本航空電子工業	16,000	1,908.00	30,528,000
T O A	8,900	1,026.00	9,131,400
マクセルホールディングス	15,400	1,455.00	22,407,000
古野電気	10,100	1,036.00	10,463,600
ユニデンホールディングス	2,800	2,019.00	5,653,200
スミダコーポレーション	6,400	1,114.00	7,129,600
アイコム	4,600	2,553.00	11,743,800
リオン	3,500	2,899.00	10,146,500
船井電機	9,500	714.00	6,783,000
横河電機	64,700	1,920.00	124,224,000
新電元工業	2,800	3,375.00	9,450,000
アズビル	44,100	2,885.00	127,228,500
東亜ディーケーケー	5,500	987.00	5,428,500
日本光電工業	29,600	3,440.00	101,824,000
チノー	4,200	1,275.00	5,355,000
共和電業	15,200	432.00	6,566,400
堀場製作所	14,000	6,630.00	92,820,000
アドバンテスト	52,400	5,410.00	283,484,000
エスベック	6,500	2,199.00	14,293,500
キーエンス	63,800	37,600.00	2,398,880,000
日置電機	3,900	3,675.00	14,332,500
シスメックス	50,500	7,428.00	375,114,000
日本マイクロニクス	11,500	1,063.00	12,224,500
メガチップス	7,000	1,759.00	12,313,000
O B A R A G R O U P	3,800	3,155.00	11,989,000
コーセル	9,900	1,149.00	11,375,100

イリソ電子工業	6,000	4,020.00	24,120,000
オブテックスグループ	11,900	1,517.00	18,052,300
千代田インテグレ	3,800	2,075.00	7,885,000
レーザーテック	30,800	5,570.00	171,556,000
スタンレー電気	49,300	2,934.00	144,646,200
岩崎電気	4,600	1,578.00	7,258,800
ウシオ電機	41,400	1,460.00	60,444,000
ヘリオス テクノ ホールディング	9,200	386.00	3,551,200
日本セラミック	7,400	2,466.00	18,248,400
山一電機	5,700	1,797.00	10,242,900
図研	5,100	2,420.00	12,342,000
日本電子	14,000	3,340.00	46,760,000
カシオ計算機	62,600	2,017.00	126,264,200
ファナック	66,900	20,325.00	1,359,742,500
日本シイエムケイ	17,800	550.00	9,790,000
エンプラス	3,600	2,933.00	10,558,800
ローム	31,200	8,060.00	251,472,000
浜松ホトニクス	50,400	4,590.00	231,336,000
三井ハイテック	8,000	1,574.00	12,592,000
新光電気工業	23,600	1,301.00	30,703,600
京セラ	99,100	7,373.00	730,664,300
太陽誘電	31,300	3,335.00	104,385,500
村田製作所	206,800	6,114.00	1,264,375,200
双葉電子工業	11,500	1,188.00	13,662,000
北陸電気工業	4,200	1,093.00	4,590,600
ニチコン	24,200	872.00	21,102,400
日本ケミコン	5,900	1,750.00	10,325,000
K O A	11,000	1,196.00	13,156,000
市光工業	11,200	703.00	7,873,600
小糸製作所	42,100	4,660.00	196,186,000
ミツバ	14,000	724.00	10,136,000
S C R E E Nホールディングス	12,300	6,130.00	75,399,000
キャノン電子	7,500	1,999.00	14,992,500
キャノン	378,800	2,792.50	1,057,799,000
リコー	179,100	1,125.00	201,487,500
象印マホービン	21,100	2,041.00	43,065,100
東京エレクトロン	46,900	24,205.00	1,135,214,500
トヨタ紡織	20,200	1,619.00	32,703,800
ユニプレス	13,800	1,288.00	17,774,400
豊田自動織機	56,900	6,230.00	354,487,000
モリタホールディングス	12,500	1,760.00	22,000,000
三櫻工業	10,500	1,001.00	10,510,500

デンソー	155,000	4,450.00	689,750,000	
東海理化電機製作所	18,400	1,845.00	33,948,000	
三井E & Sホールディングス	14,900	878.00	13,082,200	
川崎重工業	54,700	2,223.00	121,598,100	
名村造船所	27,400	238.00	6,521,200	
日本車輛製造	3,300	2,837.00	9,362,100	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,685.00	15,502,000	
日産自動車	830,600	494.70	410,897,820	
いすゞ自動車	204,900	1,139.00	233,381,100	
トヨタ自動車	785,500	7,594.00	5,965,087,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	87,700	1,008.00	88,401,600	
三菱自動車工業	261,100	409.00	106,789,900	
エフテック	7,600	727.00	5,525,200	
武蔵精密工業	15,900	1,351.00	21,480,900	
日産車体	14,200	1,073.00	15,236,600	
新明和工業	19,200	1,302.00	24,998,400	
極東開発工業	13,700	1,373.00	18,810,100	
日信工業	14,300	2,240.00	32,032,000	
トピー工業	6,000	1,710.00	10,260,000	
ティラド	3,500	1,776.00	6,216,000	
タチエス	12,000	1,281.00	15,372,000	
N O K	38,100	1,562.00	59,512,200	
フタバ産業	20,100	618.00	12,421,800	
K Y B	8,000	2,762.00	22,096,000	
大同メタル工業	16,800	673.00	11,306,400	
プレス工業	35,700	349.00	12,459,300	
太平洋工業	15,000	1,295.00	19,425,000	
ケーヒン	16,000	2,586.00	41,376,000	
河西工業	11,000	740.00	8,140,000	
アイシン精機	57,700	3,855.00	222,433,500	
マツダ	206,800	884.00	182,811,200	
今仙電機製作所	9,500	868.00	8,246,000	
本田技研工業	554,300	2,977.00	1,650,151,100	
スズキ	139,700	4,930.00	688,721,000	
S U B A R U	218,900	2,844.00	622,551,600	
安永	4,100	1,141.00	4,678,100	
ヤマハ発動機	92,000	1,924.00	177,008,000	
ショーワ	16,600	2,286.00	37,947,600	
T B K	15,300	450.00	6,885,000	
エクセディ	9,400	2,206.00	20,736,400	
豊田合成	22,700	2,457.00	55,773,900	
愛三工業	12,300	690.00	8,487,000	

日本プラスト	8,400	651.00	5,468,400
ヨロズ	7,700	1,443.00	11,111,100
エフ・シー・シー	11,300	2,103.00	23,763,900
シマノ	26,300	15,470.00	406,861,000
テイ・エス テック	16,400	3,070.00	50,348,000
ジャムコ	4,800	1,316.00	6,316,800
テルモ	199,300	3,769.00	751,161,700
日機装	21,600	1,129.00	24,386,400
日本エム・ディ・エム	4,600	1,907.00	8,772,200
島津製作所	84,300	2,890.00	243,627,000
JMS	9,600	842.00	8,083,200
長野計器	7,800	915.00	7,137,000
ブイ・テクノロジー	3,300	4,570.00	15,081,000
東京計器	6,400	913.00	5,843,200
インターアクション	4,200	2,561.00	10,756,200
東京精密	12,800	3,775.00	48,320,000
マニー	28,300	2,571.00	72,759,300
ニコン	113,600	1,201.00	136,433,600
トプコン	36,100	1,220.00	44,042,000
オリンパス	390,000	1,986.50	774,735,000
理研計器	6,100	2,253.00	13,743,300
タムロン	5,900	2,607.00	15,381,300
HOYA	140,600	10,065.00	1,415,139,000
ノーリツ鋼機	5,200	1,449.00	7,534,800
エー・アンド・デイ	7,900	957.00	7,560,300
朝日インテック	59,700	2,781.00	166,025,700
シチズン時計	82,700	486.00	40,192,200
メニコン	9,600	5,080.00	48,768,000
松風	4,300	1,933.00	8,311,900
セイコーホールディングス	9,800	2,267.00	22,216,600
ニプロ	49,900	1,242.00	61,975,800
スノーピーク	4,500	860.00	3,870,000
パラマウントベッドホールディングス	7,300	4,495.00	32,813,500
トランザクション	5,300	1,068.00	5,660,400
ニホンフラッシュ	3,700	2,445.00	9,046,500
前田工織	8,100	2,071.00	16,775,100
永大産業	14,700	327.00	4,806,900
アートネイチャー	8,200	724.00	5,936,800
バンダイナムコホールディングス	73,000	5,851.00	427,123,000
SHOEI	3,400	5,330.00	18,122,000
フランスベッドホールディングス	11,800	917.00	10,820,600
パイロットコーポレーション	12,500	4,250.00	53,125,000

萩原工業	4,400	1,601.00	7,044,400
トッパン・フォームズ	14,900	1,161.00	17,298,900
フジシールインターナショナル	15,900	2,029.00	32,261,100
タカラトミー	31,800	1,102.00	35,043,600
廣済堂	7,600	888.00	6,748,800
プロネクサス	7,200	1,135.00	8,172,000
大建工業	5,000	1,830.00	9,150,000
凸版印刷	99,200	2,065.00	204,848,000
大日本印刷	91,700	2,925.00	268,222,500
共同印刷	2,000	2,875.00	5,750,000
N I S S H A	14,800	999.00	14,785,200
T A K A R A & C O M P A N Y	3,700	1,692.00	6,260,400
アシックス	58,900	1,329.00	78,278,100
小松ウオール工業	2,600	2,107.00	5,478,200
ヤマハ	41,700	5,750.00	239,775,000
河合楽器製作所	2,500	3,025.00	7,562,500
クリナップ	9,000	602.00	5,418,000
ピジョン	42,600	3,880.00	165,288,000
キングジム	6,800	845.00	5,746,000
リンテック	17,000	2,532.00	43,044,000
イトーキ	18,500	426.00	7,881,000
任天堂	43,200	39,790.00	1,718,928,000
三菱鉛筆	11,500	1,543.00	17,744,500
タカラスタンダード	14,100	1,726.00	24,336,600
コクヨ	34,000	1,573.00	53,482,000
ナカバヤシ	7,400	605.00	4,477,000
グローブライド	3,600	2,360.00	8,496,000
オカムラ	24,300	1,009.00	24,518,700
美津濃	6,500	2,498.00	16,237,000
東京電力ホールディングス	558,300	439.00	245,093,700
中部電力	215,400	1,518.50	327,084,900
関西電力	267,200	1,253.50	334,935,200
中国電力	96,800	1,459.00	141,231,200
北陸電力	66,000	828.00	54,648,000
東北電力	176,000	1,024.00	180,224,000
四国電力	63,800	872.00	55,633,600
九州電力	143,700	865.00	124,300,500
北海道電力	68,100	508.00	34,594,800
沖縄電力	13,000	2,019.00	26,247,000
電源開発	55,700	2,534.00	141,143,800
イーレックス	10,400	1,426.00	14,830,400
レノバ	11,500	1,086.00	12,489,000

東京瓦斯	136,000	2,377.50	323,340,000
大阪瓦斯	136,700	1,884.00	257,542,800
東邦瓦斯	34,900	4,060.00	141,694,000
北海道瓦斯	4,600	1,611.00	7,410,600
広島ガス	17,000	342.00	5,814,000
西部瓦斯	7,800	2,386.00	18,610,800
静岡ガス	20,400	932.00	19,012,800
メタウォーター	3,200	4,055.00	12,976,000
SBSホールディングス	6,600	1,874.00	12,368,400
東武鉄道	73,900	3,585.00	264,931,500
相鉄ホールディングス	22,800	2,714.00	61,879,200
東急	177,400	1,836.00	325,706,400
京浜急行電鉄	90,400	1,856.00	167,782,400
小田急電鉄	104,000	2,320.00	241,280,000
京王電鉄	36,500	5,790.00	211,335,000
京成電鉄	48,800	3,920.00	191,296,000
富士急行	9,800	3,310.00	32,438,000
新京成電鉄	2,800	2,415.00	6,762,000
東日本旅客鉄道	124,000	9,089.00	1,127,036,000
西日本旅客鉄道	62,800	8,860.00	556,408,000
東海旅客鉄道	58,500	21,050.00	1,231,425,000
西武ホールディングス	94,600	1,687.00	159,590,200
鴻池運輸	10,600	1,455.00	15,423,000
西日本鉄道	20,000	2,603.00	52,060,000
ハマキョウレックス	5,500	3,220.00	17,710,000
サカイ引越センター	3,700	5,970.00	22,089,000
近鉄グループホールディングス	66,600	5,230.00	348,318,000
阪急阪神ホールディングス	88,900	4,040.00	359,156,000
南海電気鉄道	32,100	2,670.00	85,707,000
京阪ホールディングス	29,600	4,795.00	141,932,000
神戸電鉄	1,700	3,960.00	6,732,000
名古屋鉄道	54,500	3,105.00	169,222,500
山陽電気鉄道	5,900	2,099.00	12,384,100
日本通運	23,500	5,870.00	137,945,000
ヤマトホールディングス	117,100	1,920.00	224,832,000
山九	18,500	5,060.00	93,610,000
丸全昭和運輸	5,700	2,806.00	15,994,200
センコーグループホールディングス	35,900	866.00	31,089,400
トナミホールディングス	1,800	4,905.00	8,829,000
ニッコンホールディングス	23,800	2,389.00	56,858,200
福山通運	8,400	3,545.00	29,778,000
セイノーホールディングス	49,700	1,377.00	68,436,900

神奈川中央交通	2,300	3,950.00	9,085,000
日立物流	11,800	3,115.00	36,757,000
丸和運輸機関	6,900	2,052.00	14,158,800
C & F ロジホールディングス	7,600	1,279.00	9,720,400
九州旅客鉄道	59,600	3,650.00	217,540,000
S Gホールディングス	70,000	2,251.00	157,570,000
日本郵船	55,400	1,722.00	95,398,800
商船三井	41,900	2,498.00	104,666,200
川崎汽船	19,800	1,438.00	28,472,400
N S ユナイテッド海運	4,400	1,854.00	8,157,600
飯野海運	38,200	356.00	13,599,200
乾汽船	5,800	1,205.00	6,989,000
日本航空	120,000	3,029.00	363,480,000
A N Aホールディングス	122,200	3,314.00	404,970,800
トランコム	2,000	7,600.00	15,200,000
日新	6,300	1,663.00	10,476,900
三菱倉庫	21,300	2,868.00	61,088,400
三井倉庫ホールディングス	8,100	1,695.00	13,729,500
住友倉庫	24,000	1,442.00	34,608,000
澁澤倉庫	4,600	2,092.00	9,623,200
東陽倉庫	20,900	314.00	6,562,600
日本トランスシティ	17,300	481.00	8,321,300
川西倉庫	3,200	1,031.00	3,299,200
安田倉庫	7,500	1,009.00	7,567,500
東洋埠頭	4,900	1,367.00	6,698,300
上組	38,600	2,228.00	86,000,800
近鉄エクスプレス	14,000	1,857.00	25,998,000
エーアイティー	6,400	973.00	6,227,200
日本コンセプト	3,600	1,437.00	5,173,200
N E C ネットエスアイ	6,500	4,180.00	27,170,000
システナ	24,400	1,626.00	39,674,400
デジタルアーツ	3,500	5,470.00	19,145,000
日鉄ソリューションズ	10,200	3,270.00	33,354,000
キューブシステム	6,800	725.00	4,930,000
コア	3,900	1,322.00	5,155,800
ソリトンシステムズ	4,700	1,081.00	5,080,700
ソフトクリエイイトホールディングス	4,000	1,734.00	6,936,000
T I S	23,000	7,060.00	162,380,000
電算システム	3,300	2,588.00	8,540,400
グリー	49,700	459.00	22,812,300
コーエーテクモホールディングス	14,100	3,095.00	43,639,500
三菱総合研究所	3,300	4,250.00	14,025,000

ファインデックス	7,600	857.00	6,513,200
ブレインパッド	1,500	4,940.00	7,410,000
K L a b	14,000	727.00	10,178,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	9,500	950.00	9,025,000
ネクソン	196,800	1,775.00	349,320,000
アイスタイル	18,700	366.00	6,844,200
エムアップ	2,500	2,744.00	6,860,000
エイチーム	6,700	877.00	5,875,900
エニグモ	6,500	825.00	5,362,500
コロプラ	23,200	945.00	21,924,000
ブロードリーフ	36,100	517.00	18,663,700
デジタルハーツホールディングス	5,400	960.00	5,184,000
システム情報	4,300	829.00	3,564,700
メディアドゥホールディングス	2,500	3,065.00	7,662,500
じげん	19,600	428.00	8,388,800
フィックスターズ	8,000	1,313.00	10,504,000
C A R T A H O L D I N G S	4,500	1,071.00	4,819,500
オブティム	2,400	4,470.00	10,728,000
セレス	3,200	1,229.00	3,932,800
S H I F T	1,800	7,470.00	13,446,000
ティーガイア	6,100	2,347.00	14,316,700
セック	1,500	3,585.00	5,377,500
豆蔵ホールディングス	5,400	1,881.00	10,157,400
テクマトリックス	6,000	2,752.00	16,512,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,300	1,870.00	32,351,000
G M O ペイメントゲートウェイ	11,500	7,110.00	81,765,000
システムリサーチ	2,600	1,992.00	5,179,200
インターネットイニシアティブ	10,600	3,350.00	35,510,000
さくらインターネット	8,400	611.00	5,132,400
G M O クラウド	1,800	2,420.00	4,356,000
S R A ホールディングス	4,400	2,592.00	11,404,800
e B A S E	4,800	1,685.00	8,088,000
アバント	5,800	966.00	5,602,800
アドソル日進	2,800	2,352.00	6,585,600
フリービット	5,500	794.00	4,367,000
コムチュア	7,900	2,193.00	17,324,700
アステリア	5,700	527.00	3,003,900
マークライnz	4,300	1,987.00	8,544,100
メディカル・データ・ビジョン	6,100	991.00	6,045,100
g u m i	10,200	711.00	7,252,200
モバイルファクトリー	2,300	1,783.00	4,100,900
テラスカイ	3,000	3,100.00	9,300,000

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	1,646.00	6,419,400
ダブルスタンダード	1,100	3,895.00	4,284,500
オープンドア	4,000	1,229.00	4,916,000
アカツキ	2,600	4,645.00	12,077,000
U b i c o mホールディングス	2,300	1,310.00	3,013,000
L I N E	16,100	5,370.00	86,457,000
チェンジ	1,800	4,160.00	7,488,000
オークネット	5,800	1,198.00	6,948,400
A O I T Y O H o l d i n g s	8,700	695.00	6,046,500
マクロミル	13,600	1,039.00	14,130,400
オロ	2,200	3,290.00	7,238,000
サインポスト	1,500	2,214.00	3,321,000
ソルクシーズ	4,400	868.00	3,819,200
プロトコーポレーション	7,500	1,299.00	9,742,500
野村総合研究所	98,800	2,645.00	261,326,000
サイバネットシステム	6,500	770.00	5,005,000
インテージホールディングス	10,700	840.00	8,988,000
ソースネクスト	34,800	389.00	13,537,200
インフォコム	7,700	2,847.00	21,921,900
ラクスル	3,900	3,400.00	13,260,000
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,885.00	16,022,500
フォーカスシステムズ	6,200	898.00	5,567,600
クレスコ	5,000	1,944.00	9,720,000
フジ・メディア・ホールディングス	67,100	1,429.00	95,885,900
オービック	23,900	14,740.00	352,286,000
ジャストシステム	11,200	5,420.00	60,704,000
T D C ソフト	7,200	921.00	6,631,200
Zホールディングス	949,700	434.00	412,169,800
トレンドマイクロ	30,900	5,880.00	181,692,000
I Dホールディングス	3,900	1,646.00	6,419,400
日本オラクル	13,900	9,380.00	130,382,000
アルファシステムズ	2,700	2,819.00	7,611,300
フューチャー	8,700	1,752.00	15,242,400
C A C H o l d i n g s	5,900	1,300.00	7,670,000
S Bテクノロジー	3,000	2,316.00	6,948,000
オービックビジネスコンサルタント	7,000	4,145.00	29,015,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	3,315.00	104,091,000
アイティフォー	10,300	723.00	7,446,900
大塚商会	37,200	4,935.00	183,582,000
サイボウズ	9,700	2,262.00	21,941,400
ソフトブレーン	5,500	515.00	2,832,500
電通国際情報サービス	4,300	4,985.00	21,435,500

デジタルガレージ	12,700	3,900.00	49,530,000
E Mシステムズ	10,600	892.00	9,455,200
ウェザーニューズ	3,000	3,835.00	11,505,000
C I J	8,200	815.00	6,683,000
WOWOW	3,500	2,581.00	9,033,500
スカラ	6,400	781.00	4,998,400
I M A G I C A G R O U P	7,800	462.00	3,603,600
ネットワンシステムズ	26,500	2,543.00	67,389,500
アルゴグラフィックス	6,000	3,615.00	21,690,000
マーベラス	13,100	666.00	8,724,600
エイベックス	12,600	1,264.00	15,926,400
日本ユニシス	21,700	3,660.00	79,422,000
兼松エレクトロニクス	3,800	3,360.00	12,768,000
東京放送ホールディングス	42,300	1,923.00	81,342,900
日本テレビホールディングス	58,300	1,471.00	85,759,300
朝日放送グループホールディングス	10,800	718.00	7,754,400
テレビ朝日ホールディングス	19,700	2,025.00	39,892,500
スカパーJ S A Tホールディングス	47,000	456.00	21,432,000
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,364.00	14,184,000
ビジョン	8,700	1,157.00	10,065,900
コネクシオ	4,800	1,494.00	7,171,200
日本電信電話	923,600	2,779.50	2,567,146,200
K D D I	514,800	3,395.00	1,747,746,000
ソフトバンク	627,400	1,497.00	939,217,800
光通信	7,100	23,870.00	169,477,000
N T T ドコモ	510,100	3,099.00	1,580,799,900
エムティーアイ	9,100	656.00	5,969,600
G M O インターネット	27,500	2,164.00	59,510,000
K A D O K A W A	19,100	1,693.00	32,336,300
学研ホールディングス	2,500	7,000.00	17,500,000
ゼンリン	14,000	1,462.00	20,468,000
アイネット	4,700	1,444.00	6,786,800
松竹	4,600	13,980.00	64,308,000
東宝	41,500	3,890.00	161,435,000
東映	2,600	14,400.00	37,440,000
エヌ・ティ・ティ・データ	182,800	1,433.00	261,952,400
ピー・シー・エー	1,300	4,110.00	5,343,000
D T S	14,900	2,159.00	32,169,100
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,700	4,910.00	145,827,000
シーイーシー	7,700	1,957.00	15,068,900
カブコン	33,100	3,330.00	110,223,000
ジャステック	6,400	1,063.00	6,803,200

S C S K	16,000	6,120.00	97,920,000
日本システムウエア	2,600	2,282.00	5,933,200
アイネス	8,300	1,691.00	14,035,300
T K C	5,700	5,250.00	29,925,000
富士ソフト	9,000	4,105.00	36,945,000
N S D	22,800	1,863.00	42,476,400
コナミホールディングス	25,200	4,290.00	108,108,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	3,100.00	9,300,000
J B C Cホールディングス	5,600	1,940.00	10,864,000
ミロク情報サービス	6,300	2,710.00	17,073,000
ソフトバンクグループ	548,100	5,269.00	2,887,938,900
伊藤忠食品	1,900	4,925.00	9,357,500
エレマテック	8,100	1,006.00	8,148,600
J A L U X	2,700	2,254.00	6,085,800
あらた	5,600	4,505.00	25,228,000
東京エレクトロン デバイス	3,600	2,693.00	9,694,800
フィールズ	8,500	490.00	4,165,000
双日	378,200	345.00	130,479,000
アルフレッサ ホールディングス	76,500	2,190.00	167,535,000
横浜冷凍	20,700	932.00	19,292,400
アルコニックス	8,300	1,240.00	10,292,000
神戸物産	23,800	4,405.00	104,839,000
あい ホールディングス	10,500	1,730.00	18,165,000
ダイワボウホールディングス	5,900	6,250.00	36,875,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,900	1,682.00	28,425,800
ラクト・ジャパン	2,800	4,190.00	11,732,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,500	1,044.00	14,094,000
八洲電機	8,400	890.00	7,476,000
レスターホールディングス	7,400	1,814.00	13,423,600
ジュテックホールディングス	2,400	1,143.00	2,743,200
T O K A Iホールディングス	36,200	993.00	35,946,600
三洋貿易	8,200	1,205.00	9,881,000
ウイン・パートナーズ	5,600	1,034.00	5,790,400
シップヘルスケアホールディングス	11,200	4,605.00	51,576,000
コメダホールディングス	15,900	2,148.00	34,153,200
小野建	7,500	1,277.00	9,577,500
佐島電機	7,300	840.00	6,132,000
伯東	5,300	1,193.00	6,322,900
コンドーテック	5,800	1,160.00	6,728,000
ナガイレーベン	10,600	2,324.00	24,634,400
三菱食品	7,000	2,941.00	20,587,000
松田産業	5,800	1,502.00	8,711,600

第一興商	10,600	4,930.00	52,258,000
メディバルホールディングス	74,300	2,217.00	164,723,100
S P K	2,600	2,642.00	6,869,200
萩原電気ホールディングス	3,200	2,454.00	7,852,800
アズワン	4,600	9,150.00	42,090,000
尾家産業	3,600	1,373.00	4,942,800
シモジマ	6,100	1,121.00	6,838,100
ドウシシャ	6,800	1,578.00	10,730,400
高速	5,500	1,214.00	6,677,000
ハピネット	6,700	1,285.00	8,609,500
日本ライフライン	20,400	1,412.00	28,804,800
マルカ	3,300	2,015.00	6,649,500
I D O M	21,000	628.00	13,188,000
進和	4,700	2,220.00	10,434,000
ダイトロン	3,900	1,889.00	7,367,100
シークス	9,200	1,314.00	12,088,800
オーハシテクニカ	5,700	1,505.00	8,578,500
伊藤忠商事	484,900	2,590.00	1,255,891,000
丸紅	722,300	785.20	567,149,960
長瀬産業	39,000	1,458.00	56,862,000
蝶理	4,900	2,131.00	10,441,900
豊田通商	77,400	3,665.00	283,671,000
三共生興	15,000	561.00	8,415,000
兼松	24,900	1,322.00	32,917,800
三井物産	609,200	1,930.00	1,175,756,000
日本紙パルプ商事	4,100	3,900.00	15,990,000
日立ハイテク	24,100	8,020.00	193,282,000
カメイ	9,600	1,095.00	10,512,000
スターゼン	2,700	4,390.00	11,853,000
山善	26,100	992.00	25,891,200
椿本興業	1,600	4,055.00	6,488,000
住友商事	437,800	1,648.00	721,494,400
内田洋行	3,200	6,100.00	19,520,000
三菱商事	486,700	2,847.00	1,385,634,900
第一実業	3,800	3,555.00	13,509,000
キャノンマーケティングジャパン	20,300	2,805.00	56,941,500
西華産業	5,400	1,299.00	7,014,600
佐藤商事	7,700	906.00	6,976,200
菱洋エレクトロ	7,200	1,864.00	13,420,800
東京産業	9,100	588.00	5,350,800
ユアサ商事	6,200	3,375.00	20,925,000
神鋼商事	2,200	2,390.00	5,258,000

阪和興業	13,100	2,521.00	33,025,100
正栄食品工業	4,700	3,675.00	17,272,500
カナデン	7,000	1,321.00	9,247,000
菱電商事	6,100	1,645.00	10,034,500
フルサト工業	5,200	1,616.00	8,403,200
岩谷産業	15,600	3,650.00	56,940,000
極東貿易	3,200	1,913.00	6,121,600
イワキ	12,300	498.00	6,125,400
三愛石油	17,200	1,073.00	18,455,600
稲畑産業	14,300	1,426.00	20,391,800
明和産業	8,400	565.00	4,746,000
ワキタ	15,700	1,018.00	15,982,600
東邦ホールディングス	22,600	2,220.00	50,172,000
サンゲツ	19,000	1,808.00	34,352,000
ミツウロコグループホールディングス	10,700	1,130.00	12,091,000
シナネンホールディングス	3,900	2,140.00	8,346,000
伊藤忠エネクス	14,800	921.00	13,630,800
サンリオ	19,500	1,907.00	37,186,500
サンワテクノス	6,600	900.00	5,940,000
リョーサン	7,700	2,425.00	18,672,500
新光商事	11,700	802.00	9,383,400
トーヨー	4,300	1,749.00	7,520,700
三信電気	4,400	1,607.00	7,070,800
東陽テクニカ	10,000	1,033.00	10,330,000
モスフードサービス	9,300	2,959.00	27,518,700
加賀電子	7,100	2,285.00	16,223,500
ソーダニッカ	10,500	578.00	6,069,000
立花エレテック	5,800	1,730.00	10,034,000
PALTAC	11,000	4,885.00	53,735,000
太平洋興発	6,600	766.00	5,055,600
西本Wismettacホールディングス	1,700	3,235.00	5,499,500
国際紙パルプ商事	20,500	291.00	5,965,500
ヤマタネ	4,800	1,486.00	7,132,800
日鉄物産	4,600	4,595.00	21,137,000
泉州電業	2,800	2,932.00	8,209,600
トラスコ中山	14,200	2,408.00	34,193,600
オートバックスセブン	26,100	1,553.00	40,533,300
モリト	7,700	785.00	6,044,500
加藤産業	10,600	3,485.00	36,941,000
イノテック	5,800	1,044.00	6,055,200
イエローハット	13,100	1,655.00	21,680,500
JKホールディングス	9,300	736.00	6,844,800

日伝	6,600	1,925.00	12,705,000
杉本商事	4,700	1,910.00	8,977,000
因幡電機産業	19,400	2,631.00	51,041,400
東テク	2,800	2,562.00	7,173,600
ミスミグループ本社	86,700	2,673.00	231,749,100
タキヒヨー	2,800	1,852.00	5,185,600
スズケン	29,400	4,030.00	118,482,000
ジェコス	7,200	1,008.00	7,257,600
ローソン	17,700	6,200.00	109,740,000
サンエー	5,600	4,490.00	25,144,000
カワチ薬品	5,500	2,121.00	11,665,500
エービーシー・マート	10,800	6,920.00	74,736,000
アスクル	7,500	3,400.00	25,500,000
ゲオホールディングス	12,700	1,225.00	15,557,500
アダストリア	9,800	2,097.00	20,550,600
くら寿司	3,700	5,220.00	19,314,000
キャンドウ	5,000	1,639.00	8,195,000
パルグループホールディングス	3,700	3,310.00	12,247,000
エディオン	31,100	1,024.00	31,846,400
サーラコーポレーション	16,300	615.00	10,024,500
ハローズ	2,900	2,694.00	7,812,600
フジオフードシステム	6,800	1,666.00	11,328,800
あみやき亭	2,200	3,485.00	7,667,000
ひらまつ	20,500	246.00	5,043,000
大黒天物産	2,100	3,345.00	7,024,500
ハニーズホールディングス	7,100	1,325.00	9,407,500
アルペン	5,900	1,908.00	11,257,200
クオールホールディングス	10,600	1,390.00	14,734,000
ジinzホールディングス	3,800	7,470.00	28,386,000
ビックカメラ	40,300	1,117.00	45,015,100
D C Mホールディングス	36,400	1,041.00	37,892,400
Monotaro	49,400	2,545.00	125,723,000
DDホールディングス	3,300	1,642.00	5,418,600
アーランドサービスホールディングス	5,600	1,994.00	11,166,400
J . フロント リテイリング	82,700	1,304.00	107,840,800
ドトール・日レスホールディングス	10,500	2,073.00	21,766,500
マツモトキヨシホールディングス	28,400	3,865.00	109,766,000
ブロンコビリー	3,900	2,534.00	9,882,600
Z O Z O	48,000	1,802.00	86,496,000
物語コーポレーション	1,800	8,410.00	15,138,000
ココカラファイン	7,200	5,240.00	37,728,000
三越伊勢丹ホールディングス	121,400	813.00	98,698,200

H a m e e	2,800	1,601.00	4,482,800
ウエルシアホールディングス	20,600	6,180.00	127,308,000
クリエイトSDホールディングス	9,500	2,776.00	26,372,000
チムニー	3,000	2,206.00	6,618,000
シュッピン	5,900	979.00	5,776,100
ネクステージ	10,300	1,006.00	10,361,800
ジョイフル本田	20,400	1,276.00	26,030,400
鳥貴族	3,000	2,494.00	7,482,000
キリン堂ホールディングス	3,200	1,663.00	5,321,600
ホットランド	6,300	1,252.00	7,887,600
すかいらーくホールディングス	77,900	1,881.00	146,529,900
SFPホールディングス	3,700	2,120.00	7,844,000
綿半ホールディングス	3,100	1,825.00	5,657,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,500	959.00	17,741,500
B E E N O S	3,400	1,089.00	3,702,600
あさひ	6,200	1,304.00	8,084,800
日本調剤	2,300	4,045.00	9,303,500
コスモス薬品	3,100	23,410.00	72,571,000
セブン&アイ・ホールディングス	271,500	4,297.00	1,166,635,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,600	2,224.00	41,366,400
ツルハホールディングス	15,000	12,560.00	188,400,000
サンマルクホールディングス	5,400	2,139.00	11,550,600
トリドールホールディングス	8,700	2,615.00	22,750,500
T O K Y O B A S E	7,300	470.00	3,431,000
J Mホールディングス	3,900	2,296.00	8,954,400
パロックジャパンリミテッド	6,700	980.00	6,566,000
クスリのアオキホールディングス	6,900	6,730.00	46,437,000
力の源ホールディングス	4,100	880.00	3,608,000
スシローグローバルホールディングス	7,600	8,690.00	66,044,000
L I X I L ビバ	7,000	2,336.00	16,352,000
メディカルシステムネットワーク	9,200	477.00	4,388,400
ノジマ	11,600	2,170.00	25,172,000
カップ・クリエイト	10,200	1,441.00	14,698,200
良品計画	92,000	1,760.00	161,920,000
アドヴァン	11,300	1,230.00	13,899,000
アルビス	3,300	2,114.00	6,976,200
コナカ	15,200	403.00	6,125,600
G - 7ホールディングス	4,200	2,402.00	10,088,400
イオン北海道	8,400	836.00	7,022,400
コジマ	14,100	492.00	6,937,200
コーナン商事	9,400	2,396.00	22,522,400

エコス	3,300	1,682.00	5,550,600
ワタミ	9,000	1,153.00	10,377,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	152,000	1,923.00	292,296,000
西松屋チェーン	15,400	932.00	14,352,800
ゼンショーホールディングス	33,500	2,458.00	82,343,000
幸楽苑ホールディングス	5,200	1,851.00	9,625,200
サイゼリヤ	11,400	2,306.00	26,288,400
V Tホールディングス	30,100	418.00	12,581,800
フジ・コーポレーション	2,500	2,018.00	5,045,000
ユナイテッドアローズ	7,500	2,689.00	20,167,500
ハイデイ日高	9,600	1,906.00	18,297,600
コロワイド	23,900	2,161.00	51,647,900
ピーシーデポコーポレーション	11,800	593.00	6,997,400
壱番屋	4,900	5,430.00	26,607,000
スギホールディングス	13,900	5,380.00	74,782,000
薬王堂ホールディングス	3,200	2,181.00	6,979,200
ヴィア・ホールディングス	13,300	656.00	8,724,800
スクロール	15,800	341.00	5,387,800
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,320.00	16,936,000
ファミリーマート	55,500	2,513.00	139,471,500
木曽路	9,100	2,844.00	25,880,400
S R Sホールディングス	11,200	1,036.00	11,603,200
千趣会	17,800	507.00	9,024,600
ケーヨー	18,800	541.00	10,170,800
上新電機	8,000	2,058.00	16,464,000
日本瓦斯	11,200	3,760.00	42,112,000
ロイヤルホールディングス	11,800	2,160.00	25,488,000
いなげや	8,900	1,385.00	12,326,500
島忠	13,200	3,080.00	40,656,000
チヨダ	7,600	1,446.00	10,989,600
ライフコーポレーション	5,400	2,594.00	14,007,600
リンガーハット	8,800	2,424.00	21,331,200
MrMaxHD	12,500	468.00	5,850,000
AOKIホールディングス	13,600	1,014.00	13,790,400
オークワ	11,000	1,440.00	15,840,000
コメリ	10,500	2,215.00	23,257,500
青山商事	14,600	1,298.00	18,950,800
しまむら	8,000	7,890.00	63,120,000
高島屋	51,600	1,142.00	58,927,200
松屋	14,900	791.00	11,785,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,000	962.00	31,746,000
近鉄百貨店	2,800	3,435.00	9,618,000

パルコ	7,200	1,843.00	13,269,600
丸井グループ	63,600	2,383.00	151,558,800
アクシアル リテイリング	5,600	3,720.00	20,832,000
イオン	266,400	2,310.00	615,384,000
イズミ	14,200	3,345.00	47,499,000
平和堂	13,600	1,908.00	25,948,800
フジ	8,500	1,843.00	15,665,500
ヤオコー	7,600	5,960.00	45,296,000
ゼビオホールディングス	8,800	1,106.00	9,732,800
ケーズホールディングス	67,100	1,329.00	89,175,900
Olympicグループ	6,300	585.00	3,685,500
日産東京販売ホールディングス	17,800	257.00	4,574,600
Genky DrugStores	3,700	1,953.00	7,226,100
総合メディカルホールディングス	6,300	2,548.00	16,052,400
ブックオフグループホールディングス	4,900	901.00	4,414,900
アインホールディングス	8,500	6,780.00	57,630,000
元気寿司	2,400	2,965.00	7,116,000
ヤマダ電機	210,500	591.00	124,405,500
アークランドサカモト	10,900	1,176.00	12,818,400
ニトリホールディングス	30,000	16,845.00	505,350,000
グルメ杵屋	6,200	1,160.00	7,192,000
吉野家ホールディングス	23,500	2,489.00	58,491,500
松屋フーズホールディングス	3,300	4,490.00	14,817,000
サガミホールディングス	9,800	1,320.00	12,936,000
関西スーパーマーケット	6,600	1,006.00	6,639,600
王将フードサービス	5,000	6,410.00	32,050,000
プレナス	7,800	1,936.00	15,100,800
ミニストップ	5,800	1,580.00	9,164,000
アークス	13,400	1,921.00	25,741,400
パローホールディングス	14,800	1,828.00	27,054,400
ベルク	3,200	5,630.00	18,016,000
大庄	5,200	1,616.00	8,403,200
ファーストリテイリング	9,300	58,900.00	547,770,000
サンドラッグ	26,000	3,325.00	86,450,000
サックスパー ホールディングス	8,300	803.00	6,664,900
ベルーナ	15,300	617.00	9,440,100
じもとホールディングス	59,100	103.00	6,087,300
めぶきフィナンシャルグループ	361,100	238.00	85,941,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,225.00	12,250,000
九州フィナンシャルグループ	112,600	417.00	46,954,200
ゆうちょ銀行	196,300	1,008.00	197,870,400
富山第一銀行	19,600	311.00	6,095,600

コンコルディア・フィナンシャルグループ	409,100	425.00	173,867,500
西日本フィナンシャルホールディングス	47,300	685.00	32,400,500
関西みらいフィナンシャルグループ	41,100	578.00	23,755,800
三十三フィナンシャルグループ	6,500	1,537.00	9,990,500
第四北越フィナンシャルグループ	12,100	2,559.00	30,963,900
新生銀行	50,800	1,676.00	85,140,800
あおぞら銀行	41,100	3,080.00	126,588,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,780,600	565.80	2,704,863,480
りそなホールディングス	760,700	446.10	339,348,270
三井住友トラスト・ホールディングス	131,100	3,974.00	520,991,400
三井住友フィナンシャルグループ	480,300	3,797.00	1,823,699,100
千葉銀行	238,200	598.00	142,443,600
群馬銀行	135,400	360.00	48,744,000
武蔵野銀行	10,600	1,679.00	17,797,400
千葉興業銀行	20,600	335.00	6,901,000
筑波銀行	30,800	200.00	6,160,000
七十七銀行	23,700	1,591.00	37,706,700
青森銀行	5,400	2,619.00	14,142,600
秋田銀行	5,200	1,903.00	9,895,600
山形銀行	8,700	1,393.00	12,119,100
岩手銀行	5,000	2,524.00	12,620,000
東邦銀行	60,000	245.00	14,700,000
東北銀行	4,000	1,011.00	4,044,000
みちのく銀行	5,000	1,360.00	6,800,000
ふくおかフィナンシャルグループ	58,300	1,869.00	108,962,700
静岡銀行	171,200	755.00	129,256,000
十六銀行	9,000	2,113.00	19,017,000
スルガ銀行	72,700	455.00	33,078,500
八十二銀行	166,800	416.00	69,388,800
山梨中央銀行	9,200	949.00	8,730,800
大垣共立銀行	13,700	2,264.00	31,016,800
福井銀行	5,900	1,605.00	9,469,500
北國銀行	7,600	3,125.00	23,750,000
清水銀行	2,900	1,967.00	5,704,300
富山銀行	1,600	2,025.00	3,240,000
滋賀銀行	13,700	2,649.00	36,291,300
南都銀行	11,900	2,512.00	29,892,800
百五銀行	64,700	323.00	20,898,100
京都銀行	24,700	4,260.00	105,222,000
紀陽銀行	24,500	1,578.00	38,661,000
ほくほくフィナンシャルグループ	46,800	1,024.00	47,923,200
広島銀行	101,200	517.00	52,320,400

山陰合同銀行	42,000	612.00	25,704,000
中国銀行	60,000	964.00	57,840,000
伊予銀行	97,600	540.00	52,704,000
百十四銀行	7,600	2,021.00	15,359,600
四国銀行	10,400	912.00	9,484,800
阿波銀行	11,400	2,394.00	27,291,600
大分銀行	4,200	2,314.00	9,718,800
宮崎銀行	4,500	2,373.00	10,678,500
佐賀銀行	4,700	1,513.00	7,111,100
沖縄銀行	6,500	3,395.00	22,067,500
琉球銀行	15,700	1,066.00	16,736,200
セブン銀行	235,600	311.00	73,271,600
みずほフィナンシャルグループ	9,433,600	159.40	1,503,715,840
山口フィナンシャルグループ	87,800	658.00	57,772,400
名古屋銀行	6,000	3,360.00	20,160,000
北洋銀行	108,300	225.00	24,367,500
愛知銀行	2,900	3,300.00	9,570,000
中京銀行	3,000	2,203.00	6,609,000
大光銀行	2,500	1,619.00	4,047,500
愛媛銀行	10,200	1,084.00	11,056,800
京葉銀行	30,800	573.00	17,648,400
栃木銀行	39,600	198.00	7,840,800
東和銀行	12,300	779.00	9,581,700
トモニホールディングス	57,600	341.00	19,641,600
フィデアホールディングス	73,000	121.00	8,833,000
池田泉州ホールディングス	78,200	188.00	14,701,600
F P G	22,800	970.00	22,116,000
S B I ホールディングス	77,700	2,429.00	188,733,300
ジャフコ	10,600	4,695.00	49,767,000
大和証券グループ本社	557,300	547.90	305,344,670
野村ホールディングス	1,223,100	556.20	680,288,220
岡三証券グループ	62,600	397.00	24,852,200
丸三証券	22,500	506.00	11,385,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,400	318.00	26,203,200
水戸証券	26,500	220.00	5,830,000
いちよし証券	13,600	600.00	8,160,000
松井証券	40,900	895.00	36,605,500
マネックスグループ	56,100	248.00	13,912,800
極東証券	11,100	750.00	8,325,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,260.00	10,080,000
藍澤証券	12,500	703.00	8,787,500
スパークス・グループ	30,000	260.00	7,800,000

かんぽ生命保険	24,900	1,822.00	45,367,800
S O M P Oホールディングス	130,600	4,324.00	564,714,400
アニコム ホールディングス	5,800	4,010.00	23,258,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	181,700	3,701.00	672,471,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	56,900	2,393.00	136,161,700
第一生命ホールディングス	393,100	1,645.00	646,649,500
東京海上ホールディングス	248,300	6,055.00	1,503,456,500
T & Dホールディングス	207,500	1,223.00	253,772,500
アドバンスクリエイト	1,500	1,818.00	2,727,000
全国保証	19,600	4,630.00	90,748,000
C a s a	3,000	1,461.00	4,383,000
アルヒ	11,200	1,748.00	19,577,600
プレミアグループ	4,000	2,088.00	8,352,000
クレディセゾン	48,900	1,846.00	90,269,400
芙蓉総合リース	7,300	6,820.00	49,786,000
みずほリース	10,900	3,230.00	35,207,000
東京センチュリー	14,000	5,110.00	71,540,000
日本証券金融	32,200	493.00	15,874,600
アイフル	111,700	305.00	34,068,500
リコーリース	5,800	4,290.00	24,882,000
イオンフィナンシャルサービス	42,500	1,839.00	78,157,500
アコム	138,800	516.00	71,620,800
ジャックス	7,800	2,433.00	18,977,400
オリエントコーポレーション	195,600	160.00	31,296,000
日立キャピタル	16,200	3,030.00	49,086,000
アプラスフィナンシャル	44,100	79.00	3,483,900
オリックス	434,300	1,893.50	822,347,050
三菱U F Jリース	176,200	685.00	120,697,000
日本取引所グループ	199,500	1,945.00	388,027,500
イー・ギャランティ	7,100	1,290.00	9,159,000
N E Cキャピタルソリューション	3,300	2,393.00	7,896,900
いちご	90,200	390.00	35,178,000
日本駐車場開発	85,300	143.00	12,197,900
スター・マイカ・ホールディングス	4,500	1,613.00	7,258,500
ヒューリック	149,000	1,318.00	196,382,000
三栄建築設計	4,000	1,482.00	5,928,000
野村不動産ホールディングス	42,200	2,752.00	116,134,400
三重交通グループホールディングス	18,000	584.00	10,512,000
サムティ	9,900	1,877.00	18,582,300
ディア・ライフ	14,300	570.00	8,151,000
日本商業開発	6,100	1,734.00	10,577,400
プレサンスコーポレーション	11,100	1,279.00	14,196,900

ユニゾホールディングス	10,800	5,850.00	63,180,000
日本管理センター	5,800	1,341.00	7,777,800
フージャースホールディングス	16,600	694.00	11,520,400
オープンハウス	20,100	3,190.00	64,119,000
東急不動産ホールディングス	188,200	779.00	146,607,800
飯田グループホールディングス	56,600	1,691.00	95,710,600
ムゲンエステート	8,200	581.00	4,764,200
ビーロッド	2,500	1,881.00	4,702,500
ハウズドゥ	6,300	1,177.00	7,415,100
ジェイ・エス・ビー	1,200	5,010.00	6,012,000
パーク24	37,700	2,649.00	99,867,300
パラカ	3,100	1,988.00	6,162,800
三井不動産	342,300	2,944.50	1,007,902,350
三菱地所	487,000	2,099.50	1,022,456,500
平和不動産	13,000	3,460.00	44,980,000
東京建物	77,000	1,769.00	136,213,000
ダイビル	18,400	1,381.00	25,410,400
京阪神ビルディング	12,100	1,534.00	18,561,400
住友不動産	156,500	4,083.00	638,989,500
テオオーシー	15,000	869.00	13,035,000
東京楽天地	1,700	5,680.00	9,656,000
スターツコーポレーション	9,200	2,620.00	24,104,000
フジ住宅	11,800	664.00	7,835,200
空港施設	13,300	532.00	7,075,600
ゴールドクレスト	6,900	1,874.00	12,930,600
エスリード	3,800	1,849.00	7,026,200
日神グループホールディングス	14,100	539.00	7,599,900
日本エスコン	14,100	887.00	12,506,700
タカラレーベン	33,500	494.00	16,549,000
A V A N T I A	7,000	958.00	6,706,000
イオンモール	35,700	1,850.00	66,045,000
ファースト住建	5,200	1,246.00	6,479,200
カチタス	8,800	4,065.00	35,772,000
トーセイ	9,900	1,339.00	13,256,100
サンフロンティア不動産	10,200	1,272.00	12,974,400
エフ・ジェー・ネクスト	7,800	1,110.00	8,658,000
ランドビジネス	7,400	755.00	5,587,000
日本空港ビルデング	22,400	5,190.00	116,256,000
日本工営	4,600	3,415.00	15,709,000
L I F U L L	24,800	499.00	12,375,200
ジェイエシーリクルートメント	5,000	1,653.00	8,265,000
日本M&Aセンター	50,900	3,710.00	188,839,000

メンバーズ	2,300	1,548.00	3,560,400
UTグループ	8,000	2,629.00	21,032,000
タケエイ	8,100	1,017.00	8,237,700
ビーネックスグループ	8,100	969.00	7,848,900
コシダカホールディングス	16,600	1,484.00	24,634,400
パソナグループ	8,400	1,316.00	11,054,400
リンクアンドモチベーション	16,300	496.00	8,084,800
G C A	9,800	799.00	7,830,200
エス・エム・エス	21,300	2,300.00	48,990,000
パーソルホールディングス	67,300	1,858.00	125,043,400
リニカル	4,700	990.00	4,653,000
クックパッド	28,300	302.00	8,546,600
学情	3,400	2,091.00	7,109,400
スタジオアリス	4,300	1,879.00	8,079,700
シミックホールディングス	4,700	1,598.00	7,510,600
総合警備保障	26,700	5,580.00	148,986,000
カカクコム	50,800	2,900.00	147,320,000
アイロムグループ	3,300	1,519.00	5,012,700
ルネサンス	4,900	1,686.00	8,261,400
ディップ	9,500	3,200.00	30,400,000
オプトホールディング	4,200	1,883.00	7,908,600
新日本科学	9,300	663.00	6,165,900
ツクイ	18,400	651.00	11,978,400
ベネフィット・ワン	18,100	1,929.00	34,914,900
エムスリー	148,300	3,035.00	450,090,500
アウトソーシング	38,300	938.00	35,925,400
ウェルネット	9,100	693.00	6,306,300
ワールドホールディングス	2,700	1,940.00	5,238,000
ディー・エヌ・エー	33,700	1,579.00	53,212,300
博報堂D Yホールディングス	93,000	1,475.00	137,175,000
ぐるなび	13,500	849.00	11,461,500
タカミヤ	9,400	598.00	5,621,200
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	840.00	4,704,000
ファンコミュニケーションズ	21,000	436.00	9,156,000
ライク	3,200	1,940.00	6,208,000
エスプール	14,200	815.00	11,573,000
W D Bホールディングス	3,300	2,727.00	8,999,100
バリューコマース	4,300	2,508.00	10,784,400
インフォマート	75,000	742.00	55,650,000
J Pホールディングス	27,200	329.00	8,948,800
E P Sホールディングス	10,700	1,246.00	13,332,200
プレステージ・インターナショナル	26,000	942.00	24,492,000

アミューズ	4,100	2,666.00	10,930,600
ドリームインキュベータ	3,100	1,483.00	4,597,300
クイック	4,900	1,439.00	7,051,100
ケネディクス	65,400	647.00	42,313,800
電通グループ	69,200	3,545.00	245,314,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,062.00	3,610,800
ぴあ	2,100	3,920.00	8,232,000
イオンファンタジー	2,800	2,199.00	6,157,200
シーティーエス	9,000	660.00	5,940,000
ネクシィーズグループ	2,800	1,571.00	4,398,800
みらかホールディングス	19,400	2,829.00	54,882,600
アルプス技研	6,300	1,982.00	12,486,600
日本空調サービス	9,600	762.00	7,315,200
オリエンタルランド	71,500	13,930.00	995,995,000
ダスキン	17,400	3,035.00	52,809,000
明光ネットワークジャパン	10,100	908.00	9,170,800
ファルコホールディングス	5,100	2,010.00	10,251,000
ラウンドワン	19,300	960.00	18,528,000
リゾートトラスト	31,700	1,631.00	51,702,700
ビー・エム・エル	8,600	3,420.00	29,412,000
りらいあコミュニケーションズ	12,200	1,412.00	17,226,400
リソー教育	32,300	384.00	12,403,200
ユー・エス・エス	75,400	1,877.00	141,525,800
サイバーエージェント	39,000	4,345.00	169,455,000
楽天	313,900	933.00	292,868,700
クリーク・アンド・リバー社	4,500	995.00	4,477,500
テー・オー・ダブリュー	8,300	872.00	7,237,600
山田コンサルティンググループ	3,800	1,547.00	5,878,600
セントラルスポーツ	2,900	3,005.00	8,714,500
フルキャストホールディングス	6,600	2,548.00	16,816,800
エン・ジャパン	11,900	3,510.00	41,769,000
テクノプロ・ホールディングス	13,500	7,670.00	103,545,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	6,840.00	21,204,000
Gunosy	5,300	1,144.00	6,063,200
イー・ガーディアン	3,600	1,929.00	6,944,400
ジャパンマテリアル	20,600	1,505.00	31,003,000
ベクトル	9,300	1,211.00	11,262,300
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	932.00	4,660,000
I B J	5,600	1,172.00	6,563,200
アサンテ	3,700	1,881.00	6,959,700
N・フィールド	7,000	554.00	3,878,000
バリューHR	1,700	3,055.00	5,193,500

M & Aキャピタルパートナーズ	4,800	3,685.00	17,688,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,632.00	6,038,400
シグマクシス	5,000	1,687.00	8,435,000
ウィルグループ	5,100	990.00	5,049,000
リクルートホールディングス	481,700	4,500.00	2,167,650,000
エラン	4,400	1,686.00	7,418,400
日本郵政	551,600	1,011.50	557,943,400
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,517.00	17,597,200
鎌倉新書	5,400	1,625.00	8,775,000
L I T A L I C O	2,900	2,512.00	7,284,800
エアトリ	3,500	1,360.00	4,760,000
アトラエ	2,000	2,745.00	5,490,000
ストライク	2,600	4,715.00	12,259,000
ソラスト	18,900	1,059.00	20,015,100
インソース	3,500	2,890.00	10,115,000
ベйкаレント・コンサルティング	4,200	7,650.00	32,130,000
グレイステクノロジー	3,300	3,085.00	10,180,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,300	2,283.00	16,665,900
グリーンズ	4,300	876.00	3,766,800
日総工産	5,200	815.00	4,238,000
キュービーネットホールディングス	4,700	2,297.00	10,795,900
R P Aホールディングス	4,400	1,064.00	4,681,600
スプリックス	3,100	964.00	2,988,400
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	864.00	4,060,800
リログループ	36,800	2,590.00	95,312,000
東祥	4,800	2,005.00	9,624,000
エイチ・アイ・エス	10,600	2,504.00	26,542,400
共立メンテナンス	11,000	4,175.00	45,925,000
イチネンホールディングス	8,300	1,368.00	11,354,400
建設技術研究所	5,600	2,248.00	12,588,800
燦ホールディングス	4,400	1,539.00	6,771,600
東京テアトル	4,700	1,319.00	6,199,300
ナガワ	2,100	6,700.00	14,070,000
よみうりランド	2,100	4,160.00	8,736,000
東京都競馬	4,600	3,545.00	16,307,000
常磐興産	4,900	1,612.00	7,898,800
カナモト	11,100	2,643.00	29,337,300
東京ドーム	28,200	953.00	26,874,600
西尾レントオール	6,800	2,898.00	19,706,400
トランス・コスモス	6,400	2,634.00	16,857,600
乃村工藝社	28,800	1,204.00	34,675,200
藤田観光	3,700	2,483.00	9,187,100

KNT - CTホールディングス	4,800	1,167.00	5,601,600
日本管財	6,400	1,910.00	12,224,000
トーカイ	6,600	2,487.00	16,414,200
セコム	71,300	9,521.00	678,847,300
セントラル警備保障	3,300	5,470.00	18,051,000
丹青社	13,100	1,155.00	15,130,500
メイテック	8,500	5,690.00	48,365,000
応用地質	7,900	1,381.00	10,909,900
船井総研ホールディングス	13,700	2,981.00	40,839,700
オオバ	8,200	714.00	5,854,800
ベネッセホールディングス	22,700	3,005.00	68,213,500
イオンディライト	8,100	3,700.00	29,970,000
ナック	6,000	980.00	5,880,000
ニチイ学館	9,900	1,373.00	13,592,700
ダイセキ	11,300	2,897.00	32,736,100
合 計	82,096,300		165,239,345,060

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（令和 2年 2月18日現在）

資産の部

流動資産

金銭信託	478,901,879
コール・ローン	30,886,932
国債証券	107,923,204,140
地方債証券	8,574,266,640
特殊債券	14,874,562,019
社債券	6,837,231,000
未収入金	116,611,400
未収利息	420,107,736
前払費用	4,543,049
流動資産合計	139,260,314,795

資産合計

139,260,314,795

負債の部

流動負債

未払解約金	99,011,550
未払利息	91

(令和 2年 2月18日現在)

その他未払費用	6,316
流動負債合計	99,017,957
負債合計	99,017,957
純資産の部	
元本等	
元本	107,405,246,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	31,756,049,926
元本等合計	139,161,296,838
純資産合計	139,161,296,838
負債純資産合計	139,260,314,795

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 令和 1年 6月28日
	至 令和 2年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(令和 2年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	107,405,246,912口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2957円
	(10,000口当たりの純資産額 12,957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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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	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る場合、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。

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(令和 2年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	121,666,391,786円
同期中における追加設定元本額	14,406,619,423円
同期中における一部解約元本額	28,667,764,297円
令和 2年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,200,488,591円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,973,645,381円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,935,830,418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)	625,719,043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)	52,869,460円

(令和2年2月18日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	188,105,232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)	361,976,149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)	350,151,880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)	141,140,207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)	264,626,940円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	120,218,313円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,773,898,437円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	510,411,078円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	23,338,429円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	14,905,538円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,051,182,559円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	353,693,767円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	463,109,615円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	83,984,752円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	7,138,094円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	47,682,561円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	442,976円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	620,981円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	126,573円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,213,875円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,855,107,812円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	16,578,099,929円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,134,235,811円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,510,036,902円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	337,602,291円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	584,000,853円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,857,949円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	263,178,696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>	114,381,750円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,976,884,869円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,195,429,901円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,671,616,453円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,029,580,964円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,314,139円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,422,913,818円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	488,613,431円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	645,327,491円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	181,670,894円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	45,425,323円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,816,743,594円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,381,697,831円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	952,715,786円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	245,199,667円

（令和 2年 2月18日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	19,479,316円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	326,867,434円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	5,969,464,326円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	268,464,600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>	194,699,554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>	705,362,167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>	663,872,246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>	3,272,880,266円
合計	107,405,246,912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403回利付国債（2年）	20,000,000	20,073,800	
	第404回利付国債（2年）	20,000,000	20,078,200	
	第405回利付国債（2年）	60,000,000	60,252,000	
	第406回利付国債（2年）	760,000,000	763,359,200	
	第407回利付国債（2年）	270,000,000	271,252,800	
	第129回利付国債（5年）	150,000,000	150,618,000	
	第130回利付国債（5年）	290,000,000	291,383,300	
	第131回利付国債（5年）	140,000,000	140,758,800	
	第132回利付国債（5年）	95,000,000	95,577,600	
	第133回利付国債（5年）	108,000,000	108,741,960	
	第134回利付国債（5年）	110,000,000	110,829,400	
	第135回利付国債（5年）	190,000,000	191,558,000	

第136回利付国債(5年)	400,000,000	403,616,000	
第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,955,000	
第138回利付国債(5年)	600,000,000	606,132,000	
第140回利付国債(5年)	900,000,000	910,008,000	
第141回利付国債(5年)	1,570,000,000	1,588,478,900	
第142回利付国債(5年)	170,000,000	172,068,900	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	62,237,600	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	366,448,500	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	282,367,350	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	380,955,510	
第5回利付国債(40年)	245,000,000	366,880,150	
第6回利付国債(40年)	265,000,000	392,003,900	
第7回利付国債(40年)	280,000,000	399,963,200	
第8回利付国債(40年)	330,000,000	442,404,600	
第9回利付国債(40年)	501,000,000	506,586,150	
第10回利付国債(40年)	470,000,000	556,663,300	
第11回利付国債(40年)	390,000,000	448,968,000	
第12回利付国債(40年)	260,000,000	271,538,800	
第317回利付国債(10年)	55,000,000	56,095,600	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,002,598,800	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	980,380,800	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	983,126,400	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,088,430,000	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	317,650,800	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	398,712,600	
第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,296,334,050	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,884,190	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,682,750	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	133,056,300	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,095,264,500	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,329,692,300	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	816,393,500	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	840,599,150	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	325,439,100	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,523,500	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	351,097,600	

第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,718,000	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	828,296,700	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	808,856,150	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	794,740,100	
第341回利付国債(10年)	857,000,000	880,721,760	
第342回利付国債(10年)	890,000,000	904,480,300	
第343回利付国債(10年)	910,000,000	925,424,500	
第344回利付国債(10年)	1,021,000,000	1,039,000,230	
第345回利付国債(10年)	838,000,000	853,343,780	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	652,147,200	
第347回利付国債(10年)	630,000,000	642,146,400	
第348回利付国債(10年)	405,000,000	412,921,800	
第349回利付国債(10年)	930,000,000	948,051,300	
第350回利付国債(10年)	980,000,000	998,806,200	
第351回利付国債(10年)	930,000,000	947,614,200	
第352回利付国債(10年)	740,000,000	753,786,200	
第353回利付国債(10年)	800,000,000	814,616,000	
第354回利付国債(10年)	475,000,000	483,260,250	
第355回利付国債(10年)	910,000,000	925,397,200	
第356回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,391,796,700	
第357回利付国債(10年)	345,000,000	350,285,400	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	635,291,700	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	394,590,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	362,157,800	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	605,653,500	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	117,288,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	630,724,200	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	523,267,000	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	751,660,000	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	982,348,640	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	626,313,150	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	597,064,500	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	651,793,100	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	461,858,400	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	432,923,400	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	453,691,000	

第24回利付国債(30年)	310,000,000	428,571,900	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	406,230,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	499,008,840	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	616,611,600	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	544,707,760	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	248,104,440	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	656,575,600	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	434,542,500	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	548,628,600	
第33回利付国債(30年)	518,000,000	701,636,180	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	640,572,330	
第35回利付国債(30年)	435,000,000	594,544,950	
第36回利付国債(30年)	190,000,000	260,938,400	
第37回利付国債(30年)	335,000,000	455,104,200	
第38回利付国債(30年)	255,000,000	342,365,550	
第39回利付国債(30年)	220,000,000	301,019,400	
第40回利付国債(30年)	310,000,000	417,938,900	
第41回利付国債(30年)	310,000,000	411,565,300	
第42回利付国債(30年)	285,000,000	379,286,550	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	419,759,550	
第44回利付国債(30年)	290,000,000	387,387,800	
第45回利付国債(30年)	335,000,000	432,401,250	
第46回利付国債(30年)	325,000,000	419,880,500	
第47回利付国債(30年)	330,000,000	435,091,800	
第48回利付国債(30年)	435,000,000	553,289,550	
第49回利付国債(30年)	335,000,000	426,411,450	
第50回利付国債(30年)	385,000,000	432,605,250	
第51回利付国債(30年)	430,000,000	428,950,800	
第52回利付国債(30年)	413,000,000	432,803,350	
第53回利付国債(30年)	177,000,000	189,949,320	
第54回利付国債(30年)	65,000,000	73,139,300	
第55回利付国債(30年)	325,000,000	365,586,000	
第56回利付国債(30年)	370,000,000	416,597,800	
第57回利付国債(30年)	375,000,000	422,621,250	
第58回利付国債(30年)	400,000,000	450,628,000	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	440,052,000	

第60回利付国債(30年)	420,000,000	485,062,200	
第61回利付国債(30年)	335,000,000	368,114,750	
第62回利付国債(30年)	145,000,000	151,339,400	
第63回利付国債(30年)	390,000,000	396,240,000	
第64回利付国債(30年)	455,000,000	461,715,800	
第65回利付国債(30年)	55,000,000	55,742,500	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,006,861,700	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	859,243,560	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,532,231,400	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,258,800,750	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,101,301,000	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,101,243,000	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,114,880,400	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	867,094,800	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	831,575,550	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	737,086,480	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	546,707,700	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	655,354,300	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	699,136,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	958,375,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	734,713,050	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	859,020,820	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,026,400	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	671,297,800	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	848,592,080	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	729,745,120	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	360,525,250	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	799,036,020	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	815,612,490	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	246,280,320	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	428,158,400	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	553,915,990	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	464,685,000	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	444,062,900	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	452,106,900	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	459,509,700	

第109回利付国債(20年)	340,000,000	401,750,800	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	468,519,080	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	516,149,060	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	440,337,150	
第116回利付国債(20年)	200,000,000	245,462,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	242,200,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	351,129,650	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	233,906,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	307,252,050	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	394,115,700	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	98,412,000	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	231,665,100	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	255,391,050	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	220,251,600	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	175,815,400	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	261,435,700	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	228,881,600	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	163,053,000	
第131回利付国債(20年)	560,000,000	669,883,200	
第132回利付国債(20年)	630,000,000	755,829,900	
第133回利付国債(20年)	160,000,000	193,848,000	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,724,500	
第135回利付国債(20年)	295,000,000	354,719,800	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	142,846,800	
第137回利付国債(20年)	45,000,000	54,232,650	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,515,000	
第139回利付国債(20年)	210,000,000	250,506,900	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	640,552,700	
第141回利付国債(20年)	270,000,000	327,013,200	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	134,631,200	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	204,239,700	
第144回利付国債(20年)	170,000,000	202,029,700	
第145回利付国債(20年)	200,000,000	243,380,000	
第146回利付国債(20年)	85,000,000	103,711,900	
第147回利付国債(20年)	610,000,000	737,862,100	
第148回利付国債(20年)	274,000,000	328,169,800	

	第149回利付国債(20年)	525,000,000	630,183,750	
	第150回利付国債(20年)	401,000,000	476,271,710	
	第151回利付国債(20年)	595,000,000	690,658,150	
	第152回利付国債(20年)	365,000,000	424,327,100	
	第153回利付国債(20年)	287,000,000	338,238,110	
	第154回利付国債(20年)	670,000,000	780,690,700	
	第155回利付国債(20年)	310,000,000	351,837,600	
	第156回利付国債(20年)	410,000,000	426,760,800	
	第157回利付国債(20年)	295,000,000	297,351,150	
	第158回利付国債(20年)	330,000,000	348,404,100	
	第159回利付国債(20年)	453,000,000	485,670,360	
	第160回利付国債(20年)	335,000,000	364,771,450	
	第161回利付国債(20年)	610,000,000	654,157,900	
	第162回利付国債(20年)	180,000,000	193,048,200	
	第163回利付国債(20年)	495,000,000	530,917,200	
	第164回利付国債(20年)	395,000,000	416,764,500	
	第165回利付国債(20年)	610,000,000	643,495,100	
	第166回利付国債(20年)	315,000,000	343,835,100	
	第167回利付国債(20年)	470,000,000	495,586,800	
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	196,621,500	
	第169回利付国債(20年)	650,000,000	660,250,500	
	第170回利付国債(20年)	445,000,000	451,679,450	
国債証券合計		95,788,000,000	107,923,204,140	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,152,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,591,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,121,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	542,376,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	664,700,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	194,653,260	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	102,209,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	101,901,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,173,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,435,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,101,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	300,108,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,075,000	

第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,284,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,667,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	201,474,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,378,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,065,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,727,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	111,164,900	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,978,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,414,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	331,902,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	135,475,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	112,193,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,918,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	200,064,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,814,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,274,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,228,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,194,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,079,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,948,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,136,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,478,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,156,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,160,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	215,296,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	110,857,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	139,754,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,270,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,139,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,420,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	110,273,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,924,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	118,586,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,132,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,366,000	

	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,880,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,052,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	150,136,980	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,414,000	
地方債証券合計		7,900,500,000	8,574,266,640	
特殊債券	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	216,414,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,618,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,845,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,187,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,288,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	115,909,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,839,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,176,000	
	第9回道路債券	100,000,000	132,670,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	160,522,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	467,805,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,482,000	
	第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,954,000	
	第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	138,905,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	359,973,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,645,000	
	第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,684,000	
	第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,017,510,000	
	第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,839,000	
	第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,615,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,404,000		

第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,683,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	120,137,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,211,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,603,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,054,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	301,000,000	302,860,180	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,456,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	503,665,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,744,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,692,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	236,532,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,001,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,220,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,235,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,788,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,030,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,292,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,626,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,441,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,105,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	105,472,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	105,422,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,678,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,876,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,711,000	11,954,354	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,978,000	14,589,956	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,225,000	12,483,192	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,551,000	16,323,107	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,616,000	27,666,799	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,619,000	16,532,242	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,229,000	42,868,265	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,514,000	16,327,709	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,645,000	17,674,160	

第1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,672,000	10,766,660	
第1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,155,000	13,342,721	
第1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	31,614,000	32,298,126	
第1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,391,000	21,758,012	
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,982,000	45,201,599	
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,440,000	69,086,124	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,685,000	25,446,690	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,559,000	27,435,030	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,044,000	13,441,059	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,473,000	30,707,845	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,927,000	30,102,513	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,544,000	15,030,060	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,938,000	58,746,851	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,224,000	15,850,315	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,470,000	32,520,326	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,294,000	32,187,072	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,698,000	14,208,524	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,923,000	15,657,211	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,254,000	29,718,404	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,908,000	42,456,524	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,720,000	34,925,328	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,646,000	65,725,732	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,571,000	32,504,004	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,437,000	14,017,344	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,654,000	71,789,689	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,363,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,131,000	14,798,265	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,914,000	94,200,826	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,396,000	44,946,967	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,842,000	47,512,341	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,674,000	91,890,041	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,798,000	143,432,563	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,742,000	46,034,080	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,494,000	51,801,410	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,316,000	105,980,844	

	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,312,000	92,905,107	
	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,788,000	52,633,882	
	第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,221,000	
	第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,851,000	75,870,673	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,808,000	91,498,186	
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,721,000	91,164,610	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,142,000	91,590,581	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,115,000	92,450,745	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,841,000	92,299,906	
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,705,000	93,431,805	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,968,000	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,804,000	96,694,391	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,706,000	27,620,146	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,514,000	30,925,949	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,535,000	15,219,743	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,997,000	14,565,138	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,166,000	31,673,093	
	い第810号農林債	300,000,000	300,495,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	102,138,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,204,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,350,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,685,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,546,000	
	特殊債券合計	13,989,623,000	14,874,562,019	
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債	200,000,000	201,194,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポ レーション円貨社債	200,000,000	200,188,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,541,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディング ス無担保社債	100,000,000	101,695,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	101,203,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,093,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,568,000	
	第24回株式会社三菱ケミカルホールディング ス無担保社債	100,000,000	100,834,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,391,000	

第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,178,000	
第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,390,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,651,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,046,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,914,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	115,627,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,632,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,971,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	118,306,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	302,595,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	101,955,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,882,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	115,433,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,236,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,934,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	115,407,000	
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,740,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,146,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,922,000	
野村ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	99,970,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,135,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,003,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	129,820,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,850,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	101,362,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,116,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,316,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,966,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,209,000	

第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,799,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,464,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,307,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,489,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,356,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,831,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,955,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,230,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,588,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,949,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,818,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	109,371,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	202,284,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	207,982,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,102,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	103,215,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,025,000	
社債券合計	6,600,000,000	6,837,231,000	
合計		138,209,263,799	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(令和2年2月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	3,141,752,692
金銭信託	702,503,849
コール・ローン	45,308,213
株式	233,710,263,718

（令和 2年 2月18日現在）

投資証券	6,446,937,770
派生商品評価勘定	157,726,072
未収入金	64,328
未収配当金	283,567,619
差入委託証拠金	1,982,236,680
流動資産合計	246,470,360,941
資産合計	246,470,360,941
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,383,285
前受金	153,450,087
未払解約金	830,678,122
未払利息	134
その他未払費用	2,936
流動負債合計	988,514,564
負債合計	988,514,564
純資産の部	
元本等	
元本	59,028,905,441
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	186,452,940,936
元本等合計	245,481,846,377
純資産合計	245,481,846,377
負債純資産合計	246,470,360,941

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

項目	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
	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 2年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,028,905,441口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.1587円 (10,000口当たりの純資産額 41,587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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。

項目	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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	(令和 2年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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）

（令和 2年 2月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,086,093,166	-	5,239,543,253	153,450,087
	SPMINI 2003	3,715,249,600	-	3,844,255,725	129,006,125
	DJ EUR 2003	856,921,748	-	879,050,016	22,128,268
	FTSE 2003	299,497,825	-	295,363,185	4,134,640
	SPI200 2003	214,423,993	-	220,874,327	6,450,334
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	184,238,700	-	184,346,000	107,300
	米ドル	129,505,000	-	129,623,000	118,000
	カナダドル	6,627,200	-	6,637,600	10,400
	ユーロ	19,030,400	-	19,032,000	1,600
	英ポンド	11,451,200	-	11,424,800	26,400
	スイスフラン	5,588,500	-	5,597,000	8,500
	スウェーデンクローナ	2,034,000	-	2,037,600	3,600
	ノルウェークローネ	474,800	-	473,600	1,200
	デンマーククローネ	1,273,600	-	1,273,600	-
	オーストラリアドル	4,422,600	-	4,412,400	10,200
	香港ドル	2,402,100	-	2,402,100	-
	シンガポールドル	788,900	-	790,300	1,400
	イスラエルシェケル	640,400	-	642,000	1,600
	合計		5,270,331,866	-	5,423,889,253

（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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(令和 2年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,205,007,755円
同期中における追加設定元本額	17,841,275,258円
同期中における一部解約元本額	10,017,377,572円
令和 2年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	24,828,043,242円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	303,036,450円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,226,998,168円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	822,009,476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)	75,101,360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)	2,101,425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)	8,192,634円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	22,897,019円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,925,112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)	36,295,463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)	83,049,192円
外国株式指数ファンド	516,313,712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	5,289,680,165円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	412,589,320円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	419,978,757円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	318,817,093円
イオン・バランス戦略ファンド	25,105,401円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	7,491,762円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	45,849,580円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,836,373円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	114,226,463円

(令和 2年 2月18日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,367,997円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	73,375,327円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,103,337円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	286,222円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	26,000円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	82,549円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	55,524円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,643,256円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,229,811,499円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,672,249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>	66,348,893円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,277,164,230円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,305,319,045円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,509,240,201円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	17,911,308円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	94,101,398円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	399,172円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	682,688,394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>	55,944,645円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	158,440,162円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	721,136,946円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	558,667,645円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,345,334,596円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	746,596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)	282,073,284円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	116,624,991円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	15,373,482円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,502,233円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,176,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	37,751,066円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	96,012,758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>	659,889,934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>	120,415,216円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,222,610,762円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	221,785,813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>	3,893,763,433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>	14,071,423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>	46,409,987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>	42,379,851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>	410,659,696円
合計	59,028,905,441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	APACHE CORPORATION	19,062	27.36	521,536.32	
	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	21.98	702,788.52	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	14.80	290,553.60	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	54.98	645,850.06	
	CHEVRON CORPORATION	97,751	110.08	10,760,430.08	
	CONCHO RESOURCES INC	10,172	77.93	792,703.96	
	CONOCOPHILLIPS	57,162	58.62	3,350,836.44	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	26.20	118,817.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,054	22.82	480,452.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	74.97	594,737.01	
	EOG RESOURCES INC	29,883	74.92	2,238,834.36	
	EXXON MOBIL CORPORATION	217,863	60.65	13,213,390.95	
	HALLIBURTON CO	44,317	22.12	980,292.04	
	HESS CORPORATION	14,506	60.34	875,292.04	
	HOLLYFRONTIER CORP	9,418	43.32	407,987.76	
	KINDER MORGAN INC	104,909	22.00	2,307,998.00	
	MARATHON OIL CORP	47,030	10.64	500,399.20	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,599	58.33	1,959,829.67	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,156	22.89	507,150.84	
	NOBLE ENERGY INC	26,757	19.16	512,664.12	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	45,362	41.60	1,887,059.20	
	ONEOK INC	20,930	76.98	1,611,191.40	
	PHILLIPS 66	23,021	89.47	2,059,688.87	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,540	139.23	1,189,024.20	
	SCHLUMBERGER LTD	70,022	34.42	2,410,157.24	
	TARGA RESOURCES CORP	11,788	36.89	434,859.32	
	TECHNIPFMC PLC	21,584	17.26	372,539.84	
	VALERO ENERGY CORP	21,157	82.64	1,748,414.48	
	WILLIAMS COS INC	61,445	21.54	1,323,525.30	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,470	256.01	2,936,434.70	
ALBEMARLE CORPORATION	6,316	89.64	566,166.24		
AMCOR PLC	82,302	10.21	840,303.42		
AVERY DENNISON CORP	4,859	138.13	671,173.67		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	29.89	376,315.10		

BALL CORPORATION	16,125	77.22	1,245,172.50
CELANESE CORPORATION	6,420	110.02	706,328.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	38.30	459,676.60
CORTEVA INC	38,111	30.71	1,170,388.81
CROWN HOLDINGS INC	6,863	80.00	549,040.00
DOW INC	37,971	48.63	1,846,529.73
DUPONT DE NEMOURS INC	38,111	53.10	2,023,694.10
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	74.73	525,127.71
ECOLAB INC	13,335	207.31	2,764,478.85
FMC CORPORATION	6,676	105.47	704,117.72
FREEMONT-MCMORAN INC	69,858	12.24	855,061.92
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	43.19	826,656.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	135.87	661,822.77
LINDE PLC	27,913	222.64	6,214,550.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,240	82.60	1,176,224.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,381	263.48	890,825.88
MOSAIC CO/THE	18,584	18.75	348,450.00
NEWMONT CORPORATION	41,561	44.07	1,831,593.27
NUCOR CORP	15,455	47.15	728,703.25
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,339	98.94	528,240.66
PPG INDUSTRIES INC	11,972	120.15	1,438,435.80
RPM INTERNATIONAL INC	7,603	75.44	573,570.32
SEALED AIR CORP	7,895	34.77	274,509.15
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,196	585.45	2,456,548.20
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	28.44	289,832.04
VULCAN MATERIALS CO	6,698	146.97	984,405.06
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	64.84	95,639.00
WESTROCK CO	13,034	40.53	528,268.02
3M COMPANY	30,005	161.01	4,831,105.05
ACUITY BRANDS INC	1,884	116.90	220,239.60
AERCAP HOLDINGS NV	5,726	62.52	357,989.52
ALLEGION PLC	4,764	138.90	661,719.60
AMETEK INC	12,190	101.34	1,235,334.60
ARCONIC INC	19,024	33.36	634,640.64
BOEING CO	27,343	340.49	9,310,018.07
CATERPILLAR INC	28,968	137.99	3,997,294.32
CUMMINS INC	7,944	166.78	1,324,900.32
DEERE & CO	15,270	168.07	2,566,428.90
DOVER CORP	7,949	119.86	952,767.14
EATON CORP PLC	21,454	103.55	2,221,561.70
EMERSON ELECTRIC CO	30,851	73.51	2,267,857.01
FASTENAL COMPANY	29,021	38.32	1,112,084.72

FLOWERVE CORP	6,650	46.41	308,626.50
FORTIVE CORP	16,143	77.81	1,256,086.83
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	72.99	470,785.50
GENERAL DYNAMICS CORP	12,293	188.06	2,311,821.58
GENERAL ELECTRIC CO	455,110	12.83	5,839,061.30
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	41.92	326,431.04
HEICO CORP	1,888	129.76	244,986.88
HEICO CORP-CLASS A	4,435	103.16	457,514.60
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,695	180.81	6,634,822.95
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	246.21	518,764.47
IDEX CORP	3,839	174.79	671,018.81
ILLINOIS TOOL WORKS	16,656	187.86	3,128,996.16
INGERSOLL-RAND PLC	12,228	146.55	1,792,013.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	100.66	697,271.82
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	58.00	667,000.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	13,100	31.65	414,615.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,358	41.96	1,693,421.68
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,862	228.55	2,711,060.10
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,030	244.78	496,903.40
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,031	437.85	5,705,623.35
MASCO CORP	14,885	45.61	678,904.85
MIDDLEBY CORP	2,823	113.73	321,059.79
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,277	370.94	3,070,270.38
OWENS CORNING	6,518	63.82	415,978.76
PACCAR INC	17,567	74.74	1,312,957.58
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,505	211.84	1,378,019.20
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	44.24	363,652.80
RAYTHEON COMPANY	14,342	227.18	3,258,215.56
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,002	200.68	1,204,481.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,265	392.73	2,067,723.45
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,506	48.88	464,653.28
SMITH(A.O.) CORP	7,157	43.93	314,407.01
SNAP-ON INC	3,221	156.26	503,313.46
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	67.91	348,853.67
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,684	166.97	1,282,997.48
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,070	389.48	806,223.60
TEXTRON INC	11,803	48.08	567,488.24
TRANSDIGM GROUP INC	2,427	646.75	1,569,662.25
UNITED RENTALS INC	4,233	156.86	663,988.38
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,561	153.46	6,531,411.06
WABCO HOLDINGS INC	2,598	136.01	353,353.98
WABTEC CORP	9,231	77.05	711,248.55

WW GRAINGER INC	2,390	307.65	735,283.50
XYLEM INC	9,124	88.14	804,189.36
CINTAS CORP	4,507	300.88	1,356,066.16
COPART INC	10,456	103.25	1,079,582.00
COSTAR GROUP INC	1,853	731.37	1,355,228.61
EQUIFAX INC	6,127	162.96	998,455.92
IHS MARKIT LTD	19,257	80.76	1,555,195.32
MANPOWERGROUP	3,264	92.70	302,572.80
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	21.39	385,576.14
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	100.43	1,146,408.45
ROBERT HALF INTL INC	7,058	60.20	424,891.60
ROLLINS INC	6,451	39.82	256,878.82
TRANSUNION	9,497	98.13	931,940.61
VERISK ANALYTICS INC	7,884	171.38	1,351,159.92
WASTE CONNECTIONS INC	13,371	103.81	1,388,043.51
WASTE MANAGEMENT INC	21,844	125.75	2,746,883.00
AMERCO	390	346.25	135,037.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	29.20	165,739.20
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	72.01	498,669.25
CSX CORPORATION	38,979	79.59	3,102,338.61
DELTA AIR LINES INC	8,299	58.90	488,811.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,513	73.39	698,159.07
FEDEX CORP	12,944	158.62	2,053,177.28
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	110.07	485,518.77
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	173.64	885,564.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	8,325	39.06	325,174.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,486	209.35	2,823,294.10
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,284	221.91	728,752.44
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	57.97	366,138.52
UBER TECHNOLOGIES INC	9,385	39.66	372,209.10
UNION PACIFIC CORP	35,924	184.00	6,610,016.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	79.55	229,104.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,377	105.95	3,854,143.15
XPO LOGISTICS INC	4,716	95.20	448,963.20
APTIV PLC	13,074	88.32	1,154,695.68
AUTOLIV INC	4,001	77.26	309,117.26
BORGWARNER INC	12,075	34.15	412,361.25
FORD MOTOR COMPANY	198,706	8.10	1,609,518.60
GENERAL MOTORS CO	66,284	34.76	2,304,031.84
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	34.36	252,442.92
LEAR CORP	3,525	122.76	432,729.00
TESLA INC	6,743	800.03	5,394,602.29

CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	28.62	178,273.98
D.R.HORTON INC	19,074	61.81	1,178,963.94
GARMIN LTD	6,739	98.18	661,635.02
HANESBRANDS INC	22,204	14.30	317,517.20
HASBRO INC	7,338	97.71	716,995.98
LEGGETT & PLATT INC	6,656	45.60	303,513.60
LENNAR CORP-CL A	15,664	70.35	1,101,962.40
LULULEMON ATHLETICA INC	5,615	254.41	1,428,512.15
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	137.98	395,036.74
NEWELL BRANDS INC	18,477	20.10	371,387.70
NIKE INC -CL B	65,251	103.54	6,756,088.54
NVR INC	173	3,993.63	690,897.99
POLARIS INC	2,467	93.90	231,651.30
PULTE GROUP INC	13,065	46.69	610,004.85
PVH CORP	3,303	89.37	295,189.11
RALPH LAUREN CORPORATION	3,315	121.84	403,899.60
TAPESTRY INC	14,712	29.21	429,737.52
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	17.19	148,418.46
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	15.45	128,095.95
VF CORP	17,117	83.66	1,432,008.22
WHIRLPOOL CORP	3,212	152.16	488,737.92
ARAMARK	13,242	42.48	562,520.16
CARNIVAL CORP	21,372	42.60	910,447.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,405	921.94	1,295,325.70
DARDEN RESTAURANTS INC	6,722	121.71	818,134.62
DOMINO'S PIZZA INC	2,219	291.60	647,060.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,021	113.23	1,587,597.83
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	68.07	1,200,346.38
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,352	144.90	2,079,604.80
MCDONALD'S CORPORATION	39,104	217.09	8,489,087.36
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	9,858	21.40	210,961.20
MGM MIRAGE	25,878	31.52	815,674.56
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,922	52.46	572,968.12
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	113.16	1,022,513.76
STARBUCKS CORP	60,931	89.28	5,439,919.68
VAIL RESORTS INC	2,038	249.41	508,297.58
WYNN RESORTS LTD	4,913	132.14	649,203.82
YUM! BRANDS INC	15,515	105.28	1,633,419.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,495	63.52	2,508,722.40
ALPHABET INC-CL A	15,423	1,518.73	23,423,372.79
ALPHABET INC-CL C	16,143	1,520.74	24,549,305.82
ALTICE USA INC-A	6,300	28.71	180,873.00

CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,985	534.89	4,271,096.65
COMCAST CORP-CLASS A	233,539	46.09	10,763,812.51
DISCOVERY INC-A	7,075	30.21	213,735.75
DISCOVERY INC-C	18,283	28.73	525,270.59
DISH NETWORK CORP.	12,937	39.97	517,091.89
ELECTRONIC ARTS INC	15,073	109.69	1,653,357.37
FACEBOOK INC-A	124,174	214.18	26,595,587.32
FOX CORPORATION-CLASS A	19,769	37.80	747,268.20
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	37.31	327,320.63
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	237.95	945,613.30
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	24.47	480,248.22
LIBERTY BROADBAND-C	5,418	137.07	742,645.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	20.33	171,422.56
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	19.45	409,986.55
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	46.85	481,992.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	49.72	380,258.56
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	49.35	204,358.35
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	74.02	556,038.24
MATCH GROUP INC	3,732	76.50	285,498.00
NETFLIX INC	22,692	380.40	8,632,036.80
NEWS CORP-CLASS A	16,662	14.60	243,265.20
OMNICOM GROUP	11,898	78.14	929,709.72
PINTEREST INC- CLASS A	10,948	23.22	254,212.56
ROKU INC	4,624	130.25	602,276.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	81,768	7.21	589,547.28
SNAP INC-A	35,102	17.56	616,391.12
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	113.43	647,345.01
THE WALT DISNEY CO.	92,755	139.54	12,943,032.70
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	29.65	120,112.15
TWITTER INC	37,026	36.91	1,366,629.66
VIACOMCBS INC	30,377	34.98	1,062,587.46
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	51.85	275,842.00
ADVANCE AUTO PARTS	4,057	133.59	541,974.63
AMAZON.COM INC	21,650	2,134.87	46,219,935.50
AUTOZONE INC	1,248	1,053.21	1,314,406.08
BEST BUY COMPANY INC	13,082	90.21	1,180,127.22
BOOKING HOLDINGS INC	2,157	1,990.96	4,294,500.72
BURLINGTON STORES INC	3,749	245.68	921,054.32
CARMAX INC	8,427	98.81	832,671.87
DOLLAR GENERAL CORP	13,099	158.03	2,070,034.97
DOLLAR TREE INC	12,047	88.68	1,068,327.96
EBAY INC	41,983	38.14	1,601,231.62

EXPEDIA GROUP INC	7,538	122.80	925,666.40
GAP INC/THE	9,218	18.14	167,214.52
GENUINE PARTS CO	7,406	96.47	714,456.82
GRUBHUB INC	4,403	50.39	221,867.17
HOME DEPOT INC	56,390	245.03	13,817,241.70
KOHL'S CORP	8,274	44.47	367,944.78
LKQ CORPORATION	15,922	33.20	528,610.40
LOWE'S COMPANIES INC	39,957	125.42	5,011,406.94
MERCADOLIBRE INC	2,251	735.01	1,654,507.51
NORDSTROM INC	4,756	40.28	191,571.68
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,969	390.89	1,551,442.41
ROSS STORES INC	18,632	121.78	2,269,004.96
TARGET CORP	26,308	116.63	3,068,302.04
TIFFANY & CO	5,541	134.27	743,990.07
TJX COMPANIES INC	62,529	63.38	3,963,088.02
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	98.17	600,505.89
ULTA BEAUTY INC	3,061	294.57	901,678.77
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	82.46	238,062.02
COSTCO WHOLESALE CORP	22,816	318.31	7,262,560.96
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	5.37	72,495.00
KROGER CO	40,905	28.23	1,154,748.15
SYSCO CORP	25,103	78.21	1,963,305.63
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,407	52.85	2,082,659.95
WALMART INC	73,496	117.89	8,664,443.44
ALTRIA GROUP INC	97,572	45.17	4,407,327.24
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	44.77	1,271,647.08
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	71.40	1,115,268.00
BUNGE LIMITED	7,174	54.22	388,974.28
CAMPBELL SOUP CO	7,879	48.64	383,234.56
COCA-COLA CO/THE	208,020	59.95	12,470,799.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	10,663	55.15	588,064.45
CONAGRA BRANDS INC	24,639	32.69	805,448.91
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,611	203.83	1,755,180.13
GENERAL MILLS INC	31,074	53.31	1,656,554.94
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	48.58	725,736.62
INGREDION INC	3,320	97.34	323,168.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	110.00	634,480.00
KELLOGG CO	12,949	67.71	876,776.79
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	26.88	914,161.92
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	95.17	705,875.89
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,209	166.84	1,035,909.56
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	55.25	532,002.25

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	75,167	59.68	4,485,966.56
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	20,672	69.86	1,444,145.92
PEPSICO INC	72,524	146.99	10,660,302.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	80,763	88.50	7,147,525.50
THE HERSHEY COMPANY	7,514	160.34	1,204,794.76
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	80.51	1,203,543.99
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	76.43	954,228.55
CLOROX COMPANY	6,458	164.83	1,064,472.14
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	41,705	76.69	3,198,356.45
COTY INC-CL A	16,985	11.41	193,798.85
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,391	215.01	2,449,178.91
KIMBERLY-CLARK CORP	17,723	145.56	2,579,759.88
PROCTER & GAMBLE CO	128,862	126.14	16,254,652.68
ABBOTT LABORATORIES	91,005	89.66	8,159,508.30
ABIOMED INC	2,288	167.22	382,599.36
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	274.95	1,059,657.30
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	94.36	754,219.48
ANTHEM INC	13,172	297.82	3,922,885.04
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,576	93.14	2,289,008.64
BECTON DICKINSON & CO	14,104	260.22	3,670,142.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,882	42.31	3,041,327.42
CARDINAL HEALTH INC	15,114	59.62	901,096.68
CENTENE CORP	29,583	64.94	1,921,120.02
CERNER CORP	16,501	77.07	1,271,732.07
CIGNA CORPORATION	19,443	220.34	4,284,070.62
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,509	353.31	886,454.79
CVS HEALTH CORPORATION	67,717	71.37	4,832,962.29
DANAHER CORP	32,183	165.95	5,340,768.85
DAVITA INC	5,115	85.98	439,787.70
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	57.85	686,332.40
DEXCOM INC	4,617	283.91	1,310,812.47
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,573	230.55	2,437,605.15
HCA HEALTHCARE INC	13,886	149.57	2,076,929.02
HENRY SCHEIN INC	7,559	72.13	545,230.67
HOLOGIC INC	13,592	53.02	720,647.84
HUMANA INC.	6,956	375.85	2,614,412.60
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	288.78	1,259,369.58
INSULET CORP	3,486	212.32	740,147.52
INTUITIVE SURGICAL INC	5,934	603.36	3,580,338.24
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	195.28	975,423.60
MCKESSON CORP	9,632	168.03	1,618,464.96
MEDTRONIC PLC	68,636	117.33	8,053,061.88

QUEST DIAGNOSTICS	6,814	112.85	768,959.90
RESMED INC	7,271	176.60	1,284,058.60
STERIS PLC	4,287	168.51	722,402.37
STRYKER CORP	17,576	221.54	3,893,787.04
TELEFLEX INC	2,340	386.65	904,761.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	48,797	298.78	14,579,567.66
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	139.93	588,125.79
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,195	146.92	763,249.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,481	158.87	1,029,636.47
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,260	174.57	743,668.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,385	160.40	1,665,754.00
ABBVIE INC	76,817	94.05	7,224,638.85
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,023	85.82	1,375,093.86
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,370	102.56	1,166,107.20
ALLERGAN PLC	16,559	198.32	3,283,980.88
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	128.70	722,393.10
AMGEN INC	30,615	223.48	6,841,840.20
BEIGENE LTD-ADR	1,977	171.09	338,244.93
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,328	403.63	536,020.64
BIOGEN INC	9,497	333.00	3,162,501.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	89.01	808,210.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,721	66.38	8,013,459.98
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,964	30.98	556,524.72
ELI LILLY & CO	44,740	141.12	6,313,708.80
EXACT SCIENCES CORP	8,404	98.18	825,104.72
GILEAD SCIENCES INC	66,294	67.56	4,478,822.64
ILLUMINA INC	7,454	298.92	2,228,149.68
INCYTE CORP	9,243	78.45	725,113.35
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	60.13	406,478.80
IQVIA HOLDINGS INC	8,501	164.32	1,396,884.32
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	140.85	366,773.40
JOHNSON & JOHNSON	135,893	150.13	20,401,616.09
MERCK & CO. INC.	131,835	82.65	10,896,162.75
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	763.20	960,105.60
MYLAN NV	26,138	21.90	572,422.20
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,068	104.30	528,592.40
PERKINELMER INC	5,624	95.56	537,429.44
PERRIGO CO PLC	7,737	57.71	446,502.27
PFIZER INC	283,170	36.51	10,338,536.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,097	399.55	1,636,956.35
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	125.42	480,107.76
SEATTLE GENETICS INC	5,726	118.07	676,068.82

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	56,969	12.22	696,161.18
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,776	339.19	7,047,011.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,196	243.82	3,217,448.72
WATERS CORP	3,523	216.06	761,179.38
ZOETIS INC	24,590	144.17	3,545,140.30
BANK OF AMERICA CORP	453,515	34.85	15,804,997.75
CITIGROUP INC	115,504	78.79	9,100,560.16
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,242	38.67	898,768.14
COMERICA INC	7,691	62.76	482,687.16
EAST WEST BANCORP INC	8,825	47.80	421,835.00
FIFTH THIRD BANCORP	37,239	29.60	1,102,274.40
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,184	117.73	1,081,232.32
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	14.08	747,112.96
JPMORGAN CHASE & CO	164,641	137.46	22,631,551.86
KEYCORP	51,128	19.73	1,008,755.44
M & T BANK CORP	6,581	169.78	1,117,322.18
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	16.25	328,250.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,533	154.13	3,473,011.29
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	55,875	16.54	924,172.50
SIGNATURE BANK	2,508	144.36	362,054.88
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	265.42	700,708.80
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	67,981	54.94	3,734,876.14
US BANCORP	77,084	55.11	4,248,099.24
WELLS FARGO & COMPANY	214,370	48.22	10,336,921.40
ZIONS BANCORPORATION	8,874	46.26	410,511.24
ALLY FINANCIAL INC	20,139	32.85	661,566.15
AMERICAN EXPRESS COMPANY	36,312	135.87	4,933,711.44
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,790	178.82	1,214,187.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	43,698	45.90	2,005,738.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	67,536	226.80	15,317,164.80
BLACKROCK INC	5,969	565.94	3,378,095.86
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,057	62.95	2,143,888.15
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,172	102.64	2,481,014.08
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	125.63	711,191.43
CME GROUP INC.	18,686	213.13	3,982,547.18
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,415	76.42	1,254,434.30
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	12,407	44.19	548,265.33
EATON VANCE CORP	5,530	49.15	271,799.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	26.89	613,629.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	299.54	580,808.06
FRANKLIN RESOURCES INC	17,818	24.36	434,046.48
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,970	237.08	4,023,247.60

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,592	96.86	2,769,421.12
INVESCO LIMITED	18,328	17.78	325,871.84
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	23.47	302,410.95
KKR & CO INC -A	24,824	33.54	832,596.96
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	345.69	660,959.28
MOODY'S CORP	8,653	277.83	2,404,062.99
MORGAN STANLEY	63,976	55.84	3,572,419.84
MSCI INC-A	4,294	322.56	1,385,072.64
NASDAQ INC	6,566	116.20	762,969.20
NORTHERN TRUST CORP	10,486	101.20	1,061,183.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	98.95	635,852.70
S&P GLOBAL INC	12,894	307.65	3,966,839.10
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,925	47.23	2,877,487.75
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,655	68.54	524,673.70
STATE STREET CORP	18,922	77.85	1,473,077.70
SYNCHRONY FINANCIAL	31,458	33.75	1,061,707.50
T ROWE PRICE GROUP INC	11,991	137.39	1,647,443.49
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	49.54	694,947.12
VOYA FINANCIAL INC	7,308	62.58	457,334.64
AFLAC INC	37,801	52.81	1,996,270.81
ALLEGHANY CORPORATION	805	825.22	664,302.10
ALLSTATE CORP	16,891	125.57	2,121,002.87
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	112.81	399,234.59
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,792	48.48	2,171,516.16
AON PLC	12,196	235.73	2,874,963.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	47.68	976,295.68
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	109.16	1,025,449.04
ASSURANT INC	3,114	142.52	443,807.28
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	48.28	395,847.72
BROWN & BROWN INC	14,075	47.85	673,488.75
CHUBB LTD	23,926	164.56	3,937,262.56
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	115.21	905,320.18
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	163.56	210,665.28
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	291.37	601,679.05
FNF GROUP	13,937	45.08	628,279.96
GLOBE LIFE INC	5,900	110.95	654,605.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	59.10	1,083,362.10
LINCOLN NATIONAL CORP	11,217	61.11	685,470.87
LOEWS CORPORATION	13,914	54.19	753,999.66
MARKEL CORP	702	1,323.64	929,195.28
MARSH & MCLENNAN COS	25,929	118.78	3,079,846.62
METLIFE INC	40,962	52.28	2,141,493.36

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	56.36	796,028.64
PROGRESSIVE CORP	29,612	83.77	2,480,597.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,587	94.48	1,945,059.76
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	154.22	466,052.84
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	198.18	443,725.02
TRAVELERS COS INC(THE)	13,281	137.76	1,829,590.56
UNUM GROUP	9,769	30.01	293,167.69
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	79.40	589,783.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,553	213.67	1,400,179.51
CBRE GROUP INC-A	16,199	63.96	1,036,088.04
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,818	165.97	3,621,133.46
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.47	286,081.00
JONES LANG LASALLE INC	2,618	171.34	448,568.12
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,743	294.61	1,691,945.23
ACCENTURE PLC-CL A	33,117	212.37	7,033,057.29
ADOBE INC	24,996	379.67	9,490,231.32
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	99.67	829,354.07
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	102.83	228,488.26
ANSYS INC	4,256	291.98	1,242,666.88
AUTODESK INC	11,164	208.95	2,332,717.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,344	181.25	4,049,850.00
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	8,792	74.39	654,036.88
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,163	76.65	625,693.95
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	122.28	720,106.92
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	78.76	1,122,330.00
CDK GLOBAL INC	7,488	52.10	390,124.80
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,244	117.10	731,172.40
CITRIX SYSTEMS INC	6,676	122.03	814,672.28
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,867	68.42	1,975,080.14
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,311	118.94	274,870.34
DOCUSIGN INC	5,401	89.41	482,903.41
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	18.53	195,769.45
DXC TECHNOLOGY CO	11,825	30.82	364,446.50
EPAM SYSTEMS INC	3,084	236.75	730,137.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,001	157.44	5,038,237.44
FISERV INC	29,748	122.32	3,638,775.36
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	318.43	1,391,857.53
FORTINET INC	7,360	119.19	877,238.40
GARTNER INC	4,568	152.41	696,208.88
GLOBAL PAYMENTS INC	15,100	206.37	3,116,187.00
GODADDY INC - CLASS A	8,905	78.39	698,062.95
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,792	122.42	586,636.64

INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,010	150.70	6,933,707.00
INTUIT INC	13,151	304.29	4,001,717.79
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	172.08	673,693.20
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	112.81	783,691.07
MASTERCARD INC-CL A	46,275	340.95	15,777,461.25
MICROSOFT CORP	373,418	185.35	69,213,026.30
MONGODB INC	1,890	171.33	323,813.70
NORTONLIFELOCK INC	31,347	20.66	647,629.02
OKTA INC	5,270	137.03	722,148.10
ORACLE CORPORATION	120,235	55.47	6,669,435.45
PALO ALTO NETWORKS INC	4,867	247.25	1,203,365.75
PAYCHEX INC	16,401	89.21	1,463,133.21
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	314.43	792,992.46
PAYPAL HOLDINGS INC	57,971	122.99	7,129,853.29
PTC INC	5,462	87.35	477,105.70
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,101	242.39	994,041.39
SABRE CORP	13,930	22.04	307,017.20
SALESFORCE.COM, INC.	43,147	189.95	8,195,772.65
SERVICENOW INC	9,653	356.16	3,438,012.48
SPLUNK INC	7,614	172.52	1,313,567.28
SQUARE INC-A	17,051	81.86	1,395,794.86
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	66.26	765,037.96
SYNOPSYS INC	7,601	163.35	1,241,623.35
TWILIO INC-A	5,649	127.74	721,603.26
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,223	338.25	751,929.75
VERISIGN INC	5,439	209.57	1,139,851.23
VISA INC	88,923	210.29	18,699,617.67
VMWARE INC	4,194	161.82	678,673.08
WESTERN UNION COMPANY	21,840	26.24	573,081.60
WIX.COM LTD	2,419	148.26	358,640.94
WORKDAY INC-CLASS A	8,894	196.99	1,752,029.06
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,148	104.07	1,576,452.36
APPLE INC	232,469	324.95	75,540,801.55
ARISTA NETWORKS INC	2,720	223.47	607,838.40
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	79.19	327,054.70
CDW CORP/DE	7,404	138.29	1,023,899.16
CISCO SYSTEMS INC	220,418	46.97	10,353,033.46
COGNEX CORP	8,698	53.76	467,604.48
CORNING INC	39,793	28.59	1,137,681.87
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,900	52.88	417,752.00
F5 NETWORKS INC	3,504	127.51	446,795.04
FLEX LTD	23,204	13.58	315,110.32

FLIR SYSTEMS INC	6,867	57.51	394,921.17
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	67,905	14.44	980,548.20
HP INC	76,380	22.37	1,708,620.60
IPG PHOTONICS CORP	1,776	139.49	247,734.24
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	24.24	423,230.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	98.16	936,642.72
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,356	184.41	1,540,929.96
NETAPP INC	12,523	54.24	679,247.52
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	53.99	682,109.66
TE CONNECTIVITY LTD	17,082	93.30	1,593,750.60
TRIMBLE INC	12,759	45.36	578,748.24
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	69.25	1,028,847.25
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	37.82	366,740.54
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	238.77	653,513.49
AT&T INC	376,243	38.25	14,391,294.75
CENTURYLINK INC	49,758	13.90	691,636.20
SPRINT CORP	36,740	8.69	319,270.60
T-MOBILE US INC	17,328	96.48	1,671,805.44
VERIZON COMMUNICATIONS INC	212,966	58.51	12,460,640.66
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,946	34.91	417,034.86
AES CORPORATION	33,656	20.93	704,420.08
ALLIANT ENERGY CORP	13,283	59.74	793,526.42
AMEREN CORPORATION	12,454	86.79	1,080,882.66
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,748	103.76	2,567,852.48
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	139.32	1,275,335.28
ATMOS ENERGY CORP	6,436	120.45	775,216.20
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	27.18	692,111.52
CMS ENERGY CORPORATION	15,038	68.51	1,030,253.38
CONSOLIDATED EDISON INC	16,392	94.30	1,545,765.60
DOMINION ENERGY INC	42,205	87.46	3,691,249.30
DTE ENERGY COMPANY	9,290	134.02	1,245,045.80
DUKE ENERGY CORP	37,518	101.28	3,799,823.04
EDISON INTERNATIONAL	17,941	77.14	1,383,968.74
ENERGY CORP	10,703	134.13	1,435,593.39
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,653	53.72	679,719.16
EVERGY INC	12,378	72.34	895,424.52
EVERSOURCE ENERGY	17,595	93.66	1,647,947.70
EXELON CORP	49,234	49.76	2,449,883.84
FIRSTENERGY CORP	26,948	52.23	1,407,494.04
NEXTERA ENERGY INC	24,938	278.52	6,945,731.76
NISOURCE INC	18,919	30.21	571,542.99
NRG ENERGY INC	13,547	40.06	542,692.82

	OGE ENERGY CORP	11,680	46.12	538,681.60
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	100.43	602,178.28
	PPL CORPORATION	36,597	35.37	1,294,435.89
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25,629	58.48	1,498,783.92
	SEMPRA ENERGY	13,913	160.96	2,239,436.48
	SOUTHERN CO	54,470	69.02	3,759,519.40
	UGI CORPORATION	10,588	41.70	441,519.60
	VISTRA ENERGY CORP	18,354	23.29	427,464.66
	WEC ENERGY GROUP INC	15,995	101.87	1,629,410.65
	XCEL ENERGY INC	26,098	70.26	1,833,645.48
	ADVANCED MICRO DEVICES	53,101	55.31	2,937,016.31
	ANALOG DEVICES INC	18,750	117.65	2,205,937.50
	APPLIED MATERIALS INC	47,467	66.85	3,173,168.95
	BROADCOM INC	20,560	317.77	6,533,351.20
	INTEL CORP	228,104	67.27	15,344,556.08
	KLA CORPORATION	8,195	176.28	1,444,614.60
	LAM RESEARCH CORP	7,602	339.30	2,579,358.60
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,750	25.12	797,560.00
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	63.56	878,017.84
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,065	109.36	1,319,428.40
	MICRON TECHNOLOGY INC	55,617	58.50	3,253,594.50
	NVIDIA CORP	30,053	289.79	8,709,058.87
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,208	137.08	1,947,632.64
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	21.44	448,353.28
	QORVO INC	6,042	106.02	640,572.84
	QUALCOMM INC	63,277	89.60	5,669,619.20
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	118.99	1,041,995.43
	TERADYNE INC	9,842	70.16	690,514.72
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,073	132.21	6,355,731.33
	XILINX INC	12,876	90.17	1,161,028.92
	米ドル 小計	15,456,507		1,489,426,685.35 (163,628,415,652)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	12.25	200,704.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	62,867	38.81	2,439,868.27
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	11.82	638,492.76
	ENBRIDGE INC	104,247	56.03	5,840,959.41
	HUSKY ENERGY INC	14,553	8.28	120,498.84
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	31.80	413,368.20
	INTER PIPELINE LTD	19,394	21.82	423,177.08
	KEYERA CORP	11,374	35.98	409,236.52
	OVINTIV INC	13,275	21.02	279,040.50
	PARKLAND FUEL CORP	7,666	47.69	365,591.54

PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	52.74	1,445,656.14
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	14.45	130,599.10
SUNCOR ENERGY INC	81,480	39.45	3,214,386.00
TC ENERGY CORP	48,116	74.62	3,590,415.92
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	66.06	786,444.30
BARRICK GOLD CORP	93,270	26.12	2,436,212.40
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	58.69	385,182.47
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	12.18	385,764.96
FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,493	153.18	1,454,137.74
KINROSS GOLD CORP	63,501	6.69	424,821.69
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,329	49.02	555,347.58
LUNDIN MINING CORP	28,209	7.33	206,771.97
METHANEX CORPORATION	2,452	44.55	109,236.60
NUTRIEN LTD	30,042	54.66	1,642,095.72
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	17.83	442,433.62
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	63.17	181,487.41
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,695	39.75	981,626.25
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.65	125,155.80
CAE INC	12,891	40.46	521,569.86
WSP GLOBAL INC	6,393	96.67	618,011.31
THOMSON REUTERS CORP	11,002	108.55	1,194,267.10
AIR CANADA	5,737	46.22	265,164.14
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,223	124.50	4,634,263.50
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,090	358.88	2,544,459.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	67.92	975,602.88
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	36.89	334,444.74
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,035	89.11	1,161,548.85
STARS GROUP INC/THE	14,575	30.95	451,096.25
QUEBECOR INC -CL B	9,953	32.88	327,254.64
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,532	25.89	686,913.48
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,540	148.91	527,141.40
DOLLARAMA INC	14,542	43.61	634,176.62
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	46,234	44.06	2,037,070.04
EMPIRE CO LTD A	7,235	31.57	228,408.95
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	71.09	607,037.51
METRO INC	13,109	55.84	732,006.56
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	110.53	473,178.93
SAPUTO INC	13,425	41.40	555,795.00
AURORA CANNABIS INC	28,563	2.06	58,839.78
BAUSCH HEALTH COS INC	15,027	36.77	552,542.79
CANOPY GROWTH CORP	11,251	29.98	337,304.98
CRONOS GROUP INC	8,026	9.69	77,771.94

	BANK OF MONTREAL	33,657	101.81	3,426,619.17
	BANK OF NOVA SCOTIA	62,983	74.73	4,706,719.59
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,547	110.05	2,481,297.35
	NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	73.76	1,253,403.68
	ROYAL BANK OF CANADA	73,835	108.30	7,996,330.50
	TORONTO-DOMINION BANK	93,672	75.29	7,052,564.88
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	46,422	90.07	4,181,229.54
	CI FINANCIAL CORP	11,041	25.09	277,018.69
	IGM FINANCIAL INC	6,433	39.41	253,524.53
	ONEX CORPORATION	4,217	86.18	363,421.06
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	628.93	876,099.49
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	34.75	493,450.00
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	69.19	335,640.69
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	152.74	1,078,038.92
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,811	26.11	2,606,065.21
	POWER CORP OF CANADA	14,595	34.38	501,776.10
	POWER FINANCIAL CORP	16,201	36.00	583,236.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	30,089	66.44	1,999,113.16
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	7.73	200,925.89
	CGI INC-CL A	12,438	102.94	1,280,367.72
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,106	1,473.13	1,629,281.78
	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	63.28	864,721.20
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,177	704.18	3,645,539.86
	BCE INC	8,379	64.33	539,021.07
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,323	65.71	1,204,004.33
	TELUS CORPORATION	7,611	53.73	408,939.03
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	22,613	21.83	493,641.79
	ALTAGAS LTD	17,347	22.33	387,358.51
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	54.14	164,044.20
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	41.91	307,787.04
	EMERA INC	13,403	59.33	795,199.99
	FORTIS INC	21,905	58.36	1,278,375.80
	HYDRO ONE LTD	15,052	29.30	441,023.60
	カナダドル 小計	1,994,509		104,270,363.61 (8,652,354,772)
ユーロ	ENI SPA	130,479	13.02	1,699,880.41
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	14.12	341,189.37
	NESTE OYJ	22,758	39.23	892,796.34
	OMV AG	7,781	43.76	340,496.56
	REPSOL SA	75,914	12.52	950,822.85
	TENARIS S.A.	25,963	9.61	249,556.35
	TOTAL SA	122,417	45.20	5,533,860.48

VOPAK	3,130	51.50	161,195.00
AIR LIQUIDE SA	24,407	139.80	3,412,098.60
AKZO NOBEL	12,200	86.22	1,051,884.00
ARCELORMITTAL	35,989	15.97	574,744.33
ARKEMA	3,250	85.78	278,785.00
BASF SE	48,160	61.87	2,979,659.20
COVESTRO AG	8,053	39.48	317,932.44
CRH PLC	40,685	35.42	1,441,062.70
EVONIK INDUSTRIES AG	7,539	26.97	203,326.83
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	42.10	141,877.00
HEIDELBERGCEMENT AG	8,350	63.44	529,724.00
KONINKLIJKE DSM NV	9,200	115.10	1,058,920.00
LANXESS	4,409	56.30	248,226.70
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	34.42	393,799.22
SOLVAY SA	3,758	97.66	367,006.28
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	12.30	304,044.24
SYMRISE AG	6,524	98.82	644,701.68
THYSSENKRUPP AG	19,367	10.85	210,131.95
UMICORE	11,350	45.53	516,765.50
UPM-KYMMENE OYJ	29,092	30.07	874,796.44
VOESTALPINE AG	5,079	22.81	115,851.99
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,575	32.00	466,400.00
AIRBUS SE	30,025	130.98	3,932,674.50
ALSTOM RGPT	9,668	50.30	486,300.40
ANDRITZ AG	3,728	35.48	132,269.44
BOUYGUES SA	11,049	38.99	430,800.51
BRENTAG AG	9,172	49.79	456,673.88
CNH INDUSTRIAL NV	57,033	8.88	506,795.23
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	36.40	931,221.20
DASSAULT AVIATION SA	172	1,081.00	185,932.00
EIFFAGE SA	3,488	110.15	384,203.20
FERROVIAL SA	23,480	30.25	710,270.00
GEA GROUP AG	8,178	28.33	231,682.74
HOCHTIEF AG	825	112.20	92,565.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	61.25	467,460.00
KION GROUP AG	3,179	59.96	190,612.84
KNORR-BREMSE AG	2,138	99.95	213,693.10
KONE OYJ-B	18,260	55.22	1,008,317.20
LEGRAND SA	14,350	77.44	1,111,264.00
LEONARDO SPA	18,310	11.37	208,276.25
METSO OYJ	5,880	33.35	196,098.00
MTU AERO ENGINES AG	2,856	277.80	793,396.80

PRYSMIAN SPA	11,926	24.30	289,801.80
SAFRAN SA	17,196	144.85	2,490,840.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,565	98.18	2,804,511.70
SIEMENS AG-REG	39,075	107.88	4,215,411.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	15.63	179,463.66
THALES SA	5,403	95.20	514,365.60
VINCI S.A.	26,415	105.75	2,793,386.25
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	11.01	208,122.03
BUREAU VERITAS SA	17,235	25.06	431,909.10
EDENRED	12,139	49.54	601,366.06
RANDSTAD NV	5,121	55.38	283,600.98
TELEPERFORMANCE	2,970	244.60	726,462.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,924	69.76	1,041,098.24
AENA SME SA	3,741	167.85	627,926.85
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	170.30	229,223.80
ATLANTIA SPA	26,501	22.90	606,872.90
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	15.30	141,678.00
DEUTSCHE POST AG-REG	51,919	33.05	1,716,182.54
FRAPORT AG	1,856	69.54	129,066.24
GETLINK	22,311	16.78	374,378.58
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,789	66.51	1,116,636.39
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	52.15	130,792.20
CONTINENTAL AG	5,578	112.36	626,744.08
DAIMLER AG	46,555	43.67	2,033,289.62
FAURECIA	3,127	45.83	143,310.41
FERRARI NV	6,579	163.25	1,074,021.75
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,491	12.32	732,929.12
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	112.25	981,738.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	26.95	148,413.65
PIRELLI & C SPA	17,484	4.72	82,524.48
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	65.44	508,141.60
PSA PEUGEOT CITROEN	32,147	19.56	628,795.32
RENAULT SA	8,830	33.03	291,654.90
VALEO SA	14,048	27.70	389,129.60
VOLKSWAGEN AG	1,984	173.95	345,116.80
VOLKSWAGEN AG PFD	9,410	172.52	1,623,413.20
ADIDAS AG	9,463	291.45	2,757,991.35
ESSILORLUXOTTICA	14,780	140.35	2,074,373.00
HERMES INTERNATIONAL	1,690	709.40	1,198,886.00
KERING	3,987	580.00	2,312,460.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,207	414.40	5,887,380.80
MONCLER SPA	7,711	38.26	295,022.86

PUMA SE	3,830	72.40	277,292.00
SEB SA	1,032	119.60	123,427.20
ACCOR SA	10,680	38.75	413,850.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,221	102.65	433,285.65
SODEXO	3,900	99.86	389,454.00
ALTICE NV -A W/I	37,625	6.46	243,132.75
BOLLORE	39,433	3.74	147,558.28
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	12.25	106,893.50
JC DECAUX SA	2,828	23.20	65,609.60
PUBLICIS GROUPE	10,736	41.07	440,927.52
SES	17,687	10.75	190,223.68
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	40.98	89,377.38
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,215	73.90	385,388.50
VIVENDI SA	43,144	25.24	1,088,954.56
DELIVERY HERO SE	5,334	79.00	421,386.00
INDITEX	55,694	31.48	1,753,247.12
JUST EAT TAKEAWAY	5,922	92.50	547,785.00
PROSUS NV	25,486	72.28	1,842,128.08
ZALANDO SE	8,284	48.41	401,028.44
CARREFOUR SA	35,128	15.76	553,792.92
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	36.50	66,904.50
COLRUYT NV	2,472	46.52	114,997.44
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	17.08	211,461.04
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	60,023	23.60	1,416,842.91
METRO AG	8,344	12.30	102,631.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,222	67.43	2,644,739.46
DANONE	31,976	72.26	2,310,585.76
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	28,021	8.91	249,667.11
HEINEKEN HOLDING NV	6,520	92.30	601,796.00
HEINEKEN NV	13,143	103.40	1,358,986.20
KERRY GROUP PLC-A	8,352	117.00	977,184.00
PERNOD-RICARD SA	11,091	166.40	1,845,542.40
REMY COINTREAU	1,273	100.70	128,191.10
BEIERSDORF AG	5,600	105.65	591,640.00
HENKEL AG & CO KGAA	5,742	82.70	474,863.40
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	92.54	836,839.22
L'OREAL	12,957	267.50	3,465,997.50
UNILEVER NV	76,386	55.00	4,201,230.00
BIOMERIEUX	1,779	93.20	165,802.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	108.80	246,867.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,928	74.58	815,010.24
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,162	48.60	1,028,473.20

KONINKLIJKE PHILIPS NV	46,965	44.73	2,100,744.45
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	233.80	421,775.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,711	40.41	352,011.51
BAYER AG	48,080	75.92	3,650,233.60
EUROFINS SCIENTIFIC	701	474.20	332,414.20
GALAPAGOS NV	2,318	242.10	561,187.80
GRIFOLS S.A.	17,072	33.12	565,424.64
IPSEN	1,498	67.80	101,564.40
MERCK KGAA	6,553	122.70	804,053.10
ORION OYJ	4,259	39.14	166,697.26
QIAGEN N.V.	10,191	34.42	350,774.22
RECORDATI SPA	4,578	41.10	188,155.80
SANOFI	57,535	92.31	5,311,055.85
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	181.70	282,543.50
UCB SA	6,070	89.58	543,750.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	15.17	286,955.72
AIB GROUP PLC	36,918	2.39	88,234.02
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	343,002	5.22	1,793,214.45
BANCO DE SABADELL SA	242,077	0.86	208,670.37
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	852,250	3.95	3,368,944.25
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,159	4.12	215,208.03
BANKIA SA	82,022	1.71	140,421.66
BANKINTER,S.A.	36,405	6.31	229,933.98
BNP PARIBAS	57,737	54.18	3,128,190.66
CAIXABANK	181,981	2.81	511,548.59
COMMERZBANK AG	46,644	6.75	314,847.00
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	13.63	792,738.90
ERSTE GROUP BANK AG	16,973	35.57	603,729.61
FINECOBANK SPA	32,034	11.05	353,975.70
ING GROEP NV-CVA	203,129	10.73	2,180,386.68
INTESA SANPAOLO	779,261	2.54	1,979,322.94
KBC GROUPE SA	12,946	73.32	949,200.72
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.64	258,285.60
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	22.52	123,972.60
SOCIETE GENERALE	41,025	31.93	1,310,133.37
UNICREDIT SPA	106,885	14.15	1,512,422.75
AMUNDI SA	3,955	77.25	305,523.75
DEUTSCHE BANK AG -REG	99,560	10.20	1,015,910.24
DEUTSCHE BOERSE AG	9,634	154.95	1,492,788.30
EURAZEO	1,792	65.80	117,913.60
EXOR NV	4,846	75.76	367,132.96

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,728	94.10	444,904.80
NATIXIS	45,362	4.35	197,732.95
WENDEL	1,082	126.30	136,656.60
AEGON NV	91,609	3.86	353,702.34
AGEAS	8,765	52.92	463,843.80
ALLIANZ SE-REG	22,062	232.00	5,118,384.00
ASSICURAZIONI GENERALI	58,634	18.77	1,100,853.35
AXA SA	97,245	25.50	2,479,747.50
CNP ASSURANCES	8,978	16.88	151,548.64
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	191.50	585,607.00
MAPFRE SA	46,367	2.38	110,724.39
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,693	282.60	2,174,041.80
NN GROUP NV	15,922	37.00	589,114.00
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.93	290,455.47
SAMPO OYJ-A SHS	23,650	41.48	981,002.00
SCOR SE	9,581	36.99	354,401.19
AROUNDTOWN SA	45,883	8.79	403,495.10
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	38.55	699,451.20
VONOVIA SE	26,280	53.06	1,394,416.80
ADYEN NV	622	883.20	549,350.40
AMADEUS IT GROUP SA	22,251	72.96	1,623,432.96
ATOS SE	4,547	80.92	367,943.24
CAPGEMINI SA	8,059	115.15	927,993.85
DASSAULT SYSTEMES SA	6,666	155.25	1,034,896.50
SAP SE	50,158	127.40	6,390,129.20
WIRECARD AG	5,952	136.10	810,067.20
WORLDLINE SA	6,228	75.05	467,411.40
INGENICO S.A.	2,691	138.95	373,914.45
NOKIA OYJ	285,784	3.96	1,132,561.99
CELLNEX TELECOM SA	13,722	47.41	650,560.02
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	173,491	15.67	2,719,991.89
ELISA OYJ	8,333	56.54	471,147.82
ILIAD SA	1,016	135.30	137,464.80
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.51	436,264.33
ORANGE S.A.	104,864	13.38	1,403,604.64
PROXIMUS SA	6,313	26.31	166,095.03
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.52	255,879.83
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.51	128,253.05
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.60	105,145.58
TELEFONICA S.A.	240,639	6.38	1,535,998.73
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,861	31.00	212,691.00
E.ON SE	115,877	11.38	1,318,912.01

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	136,343	4.82	657,173.26
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	13.19	377,878.41
	ENAGAS	10,471	25.51	267,115.21
	ENDESA S.A.	18,336	25.46	466,834.56
	ENEL SPA	420,215	8.39	3,527,284.71
	ENGIE	96,233	16.32	1,571,003.72
	FORTUM OYJ	21,280	22.17	471,777.60
	IBERDROLA SA	312,775	11.06	3,459,291.50
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	24.18	373,315.02
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	19.07	394,986.02
	RWE AG	29,609	33.56	993,678.04
	SNAM SPA	89,624	5.04	451,704.96
	SUEZ	14,536	15.13	220,002.36
	TERNA SPA	80,482	6.57	529,410.59
	UNIPER SE	12,358	29.51	364,684.58
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,081	28.16	818,920.96
	VERBUND AG	3,692	47.48	175,296.16
	ASML HOLDING NV	21,891	288.45	6,314,458.95
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,563	22.22	1,456,809.86
	STMICROELECTRONICS NV	37,627	28.20	1,061,081.40
	ユーロ 小計	10,129,693		223,117,842.53 (26,539,867,368)
英債券	BP PLC	1,055,848	4.61	4,867,459.28
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	218,167	19.33	4,218,040.77
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	194,456	19.37	3,767,779.45
	ANGLO AMERICAN PLC	51,260	21.03	1,078,254.10
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.77	170,518.90
	BHP GROUP PLC	107,097	16.91	1,811,652.85
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,482	50.90	380,833.80
	EVRAZ PLC	28,275	3.88	109,735.27
	GLENCORE PLC	556,703	2.36	1,317,437.64
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	26.75	269,479.50
	MONDI PLC	25,128	16.62	417,627.36
	RIO TINTO PLC	58,681	42.12	2,471,937.12
	ASHTREAD GROUP PLC	23,686	27.19	644,022.34
	BAE SYSTEMS PLC	170,608	6.38	1,088,820.25
	BUNZL PLC	17,064	19.36	330,359.04
	DCC PLC	4,734	62.60	296,348.40
	FERGUSON PLC	12,237	75.98	929,767.26
	MEGGITT PLC	36,960	6.35	234,843.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	2.42	596,164.58
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	86,917	6.83	593,643.11

SMITHS GROUP PLC	23,530	17.46	410,833.80
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	92.75	341,783.75
WEIR GROUP PLC/THE	16,710	14.08	235,276.80
EXPERIAN PLC	47,988	28.24	1,355,181.12
G4S PLC	74,291	2.01	149,919.23
INTERTEK GROUP PLC	8,184	58.14	475,817.76
RELX PLC	97,576	20.73	2,022,750.48
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	4.92	445,606.39
EASYJET PLC	7,630	15.09	115,174.85
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	58,735	8.70	511,229.44
BURBERRY GROUP PLC	23,066	20.06	462,703.96
PERSIMMON PLC	16,916	32.47	549,262.52
TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	2.31	342,511.66
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	53.36	284,728.96
CARNIVAL PLC	8,091	31.03	251,063.73
COMPASS GROUP PLC	82,693	19.44	1,607,965.38
GVC HOLDINGS PLC	23,842	8.34	198,937.64
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,704	48.29	468,654.68
TUI AG-DI	17,636	8.80	155,196.80
WHITBREAD PLC	6,801	47.20	321,007.20
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	6.02	253,495.48
INFORMA PLC	69,099	7.81	539,939.58
ITV PLC	215,062	1.35	291,624.07
PEARSON PLC	39,623	5.72	226,643.56
WPP PLC	63,987	9.80	627,328.54
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	8.63	249,177.24
KINGFISHER PLC	109,678	2.22	243,485.16
MARKS & SPENCER GROUP PLC	84,084	1.83	154,546.39
NEXT PLC	6,860	71.62	491,313.20
OCADO GROUP PLC	22,177	11.61	257,474.97
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.08	235,104.37
TESCO PLC	516,090	2.57	1,328,415.66
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.83	268,268.10
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	26.73	448,288.83
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	117,896	33.31	3,927,705.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	28.52	248,238.08
DIAGEO PLC	121,902	30.90	3,766,771.80
IMPERIAL BRANDS PLC	49,659	17.98	893,166.77
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,620	63.22	2,315,116.40
UNILEVER PLC	56,134	46.30	2,599,004.20
NMC HEALTH PLC	3,940	8.00	31,520.00
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	18.28	811,031.17

	ASTRAZENECA PLC	68,127	73.77	5,025,728.79
	GLAXOSMITHKLINE PLC	258,953	16.61	4,302,763.04
	BARCLAYS PLC	863,463	1.77	1,534,373.75
	HSBC HOLDINGS PLC	1,048,514	5.90	6,193,572.19
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,684,159	0.56	2,095,181.22
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	245,244	2.09	512,559.96
	STANDARD CHARTERED PLC	141,577	6.35	899,297.10
	3I GROUP PLC	49,338	11.68	576,514.53
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,431	16.90	243,956.05
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,953	83.00	1,324,099.00
	M&G PLC	133,064	2.46	328,135.82
	SCHRODERS PLC	6,213	33.84	210,247.92
	ST JAMES' S PLACE PLC	23,417	11.70	274,095.98
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	3.22	397,769.70
	ADMIRAL GROUP PLC	12,109	23.13	280,081.17
	AVIVA PLC	198,601	4.12	819,824.92
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.46	219,549.54
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	3.17	959,685.02
	PRUDENTIAL PLC	133,064	14.93	1,987,310.84
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	5.70	298,395.27
	AVEVA GROUP PLC	3,527	52.30	184,462.10
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	8.20	123,985.75
	SAGE GROUP PLC/THE	49,814	7.82	389,943.99
	HALMA PLC	21,166	21.95	464,593.70
	BT GROUP PLC	419,350	1.53	644,708.69
	VODAFONE GROUP PLC	1,367,398	1.51	2,066,411.85
	CENTRICA PLC	254,915	0.72	185,170.25
	NATIONAL GRID PLC	178,374	10.44	1,863,651.55
	SEVERN TRENT PLC	14,466	26.16	378,430.56
	SSE PLC	54,852	16.74	918,496.74
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	10.10	335,556.73
	英ポンド 小計	15,463,949		92,546,543.54 (13,217,497,348)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	23.82	240,605.82
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	339	643.00	217,977.00
	GIVAUDAN-REG	472	3,356.00	1,584,032.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,793	49.82	1,285,007.26
	SIKA AG	6,470	185.50	1,200,185.00
	ABB LTD	96,431	23.92	2,306,629.52
	GEBERIT AG-REG	1,999	527.60	1,054,672.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	232.60	218,876.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,322	240.70	558,905.40

	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	58.42	410,049.98	
	SGS SA	256	2,640.00	675,840.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	157.85	372,841.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,260	74.18	2,022,146.80	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	252.80	336,224.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	48.00	120,768.00	
	DUFREY AG-REG	2,262	85.74	193,943.88	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	188	2,212.00	415,856.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	49	8,450.00	414,050.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	91,600.00	458,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	152,702	107.86	16,470,437.72	
	ALCON INC	21,063	61.82	1,302,114.66	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	257.10	679,515.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	599	968.00	579,832.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,776	416.80	1,573,836.80	
	NOVARTIS AG-REG SHS	110,429	95.56	10,552,595.24	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,331	343.30	12,472,432.30	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	188.00	495,944.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	129,608	13.50	1,749,708.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,666	50.20	635,833.20	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	80.80	150,853.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	948.60	922,987.80	
	UBS GROUP AG	193,660	13.05	2,528,231.30	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	181.70	449,707.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	518.80	900,118.00	
	SWISS RE AG	15,453	115.70	1,787,912.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,768	437.70	3,400,053.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	122.30	477,703.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,650	164.00	598,600.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,431	572.40	819,104.40	
	スイスフラン 小計	893,488		72,634,132.68 (8,130,664,812)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,380	303.10	3,449,278.00	
	BOLIDEN AB	16,246	236.00	3,834,056.00	
	ALFA LAVAL AB	13,939	255.60	3,562,808.40	
	ASSA ABLOY AB-B	53,447	243.00	12,987,621.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,909	373.70	13,419,193.30	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	328.70	6,503,986.90	
	EPIROC AB-A	30,249	120.05	3,631,392.45	
	EPIROC AB-B	16,107	118.20	1,903,847.40	
	SANDVIK AB	60,999	184.00	11,223,816.00	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	238.20	3,742,360.20	

	SKF AB-B SHARES	20,607	191.95	3,955,513.65	
	VOLVO AB-B SHS	79,515	173.40	13,787,901.00	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	148.00	2,386,204.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,165	222.00	2,034,630.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	73.20	1,361,007.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	43,722	204.50	8,941,149.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	399.00	1,416,450.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,559	600.60	4,539,935.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,725	315.00	10,308,375.00	
	NORDEA BANK ABP	170,474	85.69	14,607,917.06	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,798	101.35	8,999,677.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	109.40	8,496,879.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	156.50	7,186,636.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	253.30	1,587,177.80	
	INVESTOR AB-B SHS	24,294	564.20	13,706,674.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	231.20	2,602,618.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	446.00	1,397,764.00	
	ERICSSON LM-B SHS	159,401	88.12	14,046,416.12	
	HEXAGON AB-B SHS	13,203	570.80	7,536,272.40	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,238	456.00	1,932,528.00	
	TELE2 AB-B SHS	29,159	147.50	4,300,952.50	
	TELIA CO AB	126,963	41.30	5,243,571.90	
	スウェーデンクローナ 小計	1,266,109		204,634,611.28 (2,316,463,799)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,392	255.00	1,374,960.00	
	EQUINOR ASA	50,788	160.70	8,161,631.60	
	NORSK HYDRO ASA	79,046	29.51	2,332,647.46	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	378.00	3,403,890.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,930	257.00	1,010,010.00	
	MOWI ASA	22,242	223.70	4,975,535.40	
	ORKLA ASA	33,915	87.40	2,964,171.00	
	DNB ASA	47,557	176.00	8,370,032.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	205.00	2,268,530.00	
	TELENOR ASA	39,602	163.30	6,467,006.60	
	ノルウェークローネ 小計	302,543		41,328,414.06 (489,741,706)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,029	546.60	3,295,451.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	380.50	3,883,763.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,581	697.60	6,683,705.60	
	ISS A/S	8,523	166.85	1,422,062.55	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	7,940.00	1,333,920.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	370	8,478.00	3,136,860.00	

	DSV PANALPINA A S	10,998	771.80	8,488,256.40
	PANDORA A/S	4,763	345.00	1,643,235.00
	CARLSBERG AS-B	5,817	1,016.00	5,910,072.00
	COLOPLAST-B	6,052	954.00	5,773,608.00
	DEMANT A/S	4,455	230.50	1,026,877.50
	GENMAB A/S	3,294	1,637.50	5,393,925.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	262.00	758,752.00
	NOVO NORDISK A/S-B	91,583	438.60	40,168,303.80
	DANSKE BANK A/S	32,789	120.50	3,951,074.50
	TRYG A/S	8,215	206.40	1,695,576.00
	ORSTED A/S	9,592	743.40	7,130,692.80
	デンマーククローネ 小計	215,332		101,696,136.05 (1,619,002,485)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	34.85	466,502.10
	OIL SEARCH LTD	70,573	6.45	455,195.85
	ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	7.78	694,800.68
	SANTOS LTD	91,657	8.13	745,171.41
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,659	22.74	174,165.66
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	47,870	33.32	1,595,028.40
	WORLEY LIMITED	13,384	13.95	186,706.80
	ALUMINA LTD	106,977	2.21	236,419.17
	BHP GROUP LTD	151,689	38.47	5,835,475.83
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	13.98	322,784.22
	BORAL LIMITED	75,397	4.76	358,889.72
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	10.92	765,502.92
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.06	187,746.30
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,865	31.34	810,609.10
	NEWCREST MINING LIMITED	41,293	27.78	1,147,119.54
	ORICA LIMITED	17,981	22.51	404,752.31
	RIO TINTO LIMITED	19,754	97.84	1,932,731.36
	SOUTH32 LTD	235,718	2.61	615,223.98
	CIMIC GROUP LTD	4,062	27.51	111,745.62
	BRAMBLES LIMITED	88,389	13.14	1,161,431.46
	SEEK LIMITED	18,186	23.60	429,189.60
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	5.49	476,993.16
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	6.35	291,026.85
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,141	37.05	1,079,674.05
	CROWN RESORTS LTD	21,863	11.78	257,546.14
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	38.48	101,972.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	4.60	478,584.00	
REA GROUP LTD	2,871	113.09	324,681.39	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.74	97,373.82	

	WESFARMERS LIMITED	58,571	45.45	2,662,051.95
	COLES GROUP LIMITED	57,494	16.91	972,223.54
	WOOLWORTHS GROUP LTD	64,250	43.27	2,780,097.50
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	11.86	278,022.12
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.35	413,866.40
	COCHLEAR LIMITED	2,927	234.56	686,557.12
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,513	79.71	758,281.23
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	31.50	664,051.50
	CSL LIMITED	23,460	332.55	7,801,623.00
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	146,659	26.58	3,898,196.22
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.57	209,719.37
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	92,044	89.46	8,234,256.24
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	148,449	27.28	4,049,688.72
	WESTPAC BANKING CORPORATION	177,786	25.62	4,554,877.32
	AMP LIMITED	223,504	1.89	422,422.56
	ASX LTD	9,287	82.40	765,248.80
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	10.19	234,594.18
	MACQUARIE GROUP LTD	16,904	148.72	2,513,962.88
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,094	72.56	587,300.64
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	6.78	794,527.86
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.05	392,608.20
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	67,004	14.76	988,979.04
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	12.51	799,801.83
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,039	17.54	526,884.06
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	29.25	231,338.25
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.72	807,027.96
	TPG TELECOM LTD	17,758	8.04	142,774.32
	AGL ENERGY LIMITED	34,137	20.89	713,121.93
	AUSNET SERVICES	85,220	1.74	148,282.80
	オーストラリアドル 小計	3,519,160		69,777,430.98 (5,132,130,048)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,669	5.23	212,698.87
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	55,278	8.40	464,335.20
	A2 MILK CO LTD	34,910	16.28	568,334.80
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,600	24.82	759,492.00
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,962	16.85	268,959.70
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.76	418,829.20
	MERCURY NZ LTD	30,223	5.32	160,786.36
	MERIDIAN ENERGY LTD	81,829	5.52	452,105.22
	ニュージーランドドル 小計	377,368		3,305,541.35 (233,404,274)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	143,424	71.40	10,240,473.60

	NWS HOLDINGS LTD	69,500	10.46	726,970.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	69.60	4,906,800.00	
	MTR CORPORATION	67,000	45.65	3,058,550.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	21.30	575,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	57.55	6,790,900.00	
	SANDS CHINA LTD	135,600	40.25	5,457,900.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	9.45	756,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	17.30	1,224,840.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	65,000	23.95	1,556,750.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	32.65	1,371,300.00	
	WH GROUP LIMITED	517,000	8.35	4,316,950.00	
	BANK OF EAST ASIA	87,220	17.64	1,538,560.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	27.95	5,240,625.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	164.50	6,382,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	60,600	272.80	16,531,680.00	
	AIA GROUP LTD	623,800	81.00	50,527,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,424	52.00	7,250,048.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.34	1,797,320.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,384	37.45	2,373,730.80	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	24.10	662,750.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	356,333	10.46	3,727,243.18	
	SINO LAND CO	124,200	11.14	1,383,588.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	85,000	115.70	9,834,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	75.05	2,026,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	25.30	1,340,900.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	42.45	3,056,400.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	37,000	48.90	1,809,300.00	
	PCCW LIMITED	269,000	4.78	1,285,820.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	55.50	1,665,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	82.50	7,020,750.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.89	875,790.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	545,014	15.26	8,316,913.64	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	57.20	4,089,800.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	111.30	1,368,990.00	
	香港ドル 小計	4,610,499		181,088,993.02 (2,560,598,361)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	6.72	469,728.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.04	89,188.80	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	4.28	424,148.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.01	90,900.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.09	243,903.00	
	SATS LTD	26,800	4.48	120,064.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	8.66	217,071.56
	GENTING SINGAPORE LTD	370,200	0.88	327,627.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	2.03	140,171.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	29.09	136,723.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	117,000	4.08	477,360.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	25.48	2,400,216.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	163,900	11.01	1,804,539.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,900	26.05	1,664,595.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	9.34	332,504.00
	CAPITALAND LTD	136,600	3.73	509,518.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	11.00	283,800.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.19	177,723.00
	VENTURE CORP LTD	11,900	16.84	200,396.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,115	3.21	1,409,559.15
	シンガポールドル 小計	2,024,951		11,519,735.01 (910,519,855)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	13.42	385,301.62
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	537.80	747,004.20
	BANK HAPOLIM BM	65,020	28.58	1,858,271.60
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	83,960	24.42	2,050,303.20
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	15.57	851,274.18
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	95.30	518,622.60
	AZRIELI GROUP	2,140	281.20	601,768.00
	NICE LTD	2,768	612.40	1,695,123.20
	イスラエルシュケル 小計	244,104		8,707,668.60 (279,603,238)
	合 計	56,498,212		233,710,263,718 (233,710,263,718)

（注）金額欄の（ ）内は、外貨建保有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 610銘柄	66.7%	70.0%
カナダドル	株式 85銘柄	3.5%	3.7%
ユーロ	株式 237銘柄	10.8%	11.4%
英ポンド	株式 93銘柄	5.4%	5.7%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.3%	3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	0.9%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.1%	2.2%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 35銘柄	1.0%	1.1%

シンガポールドル	株式	20銘柄	0.4%	0.4%
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	491,854.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	5,727	1,001,824.11	
		AMERICAN TOWER CORP	22,501	5,765,881.25	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	80,296	836,684.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,069	1,608,409.57	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	1,153,547.05	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	582,798.78	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,561	1,388,771.50	
		DUKE REALTY CORP	20,240	778,835.20	
		EQUINIX INC	4,426	2,870,924.90	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	651,879.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,789	1,624,496.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	1,080,134.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	746,024.09	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,227	537,801.21	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,237	904,282.47	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	635,291.79	
		INVITATION HOMES INC	25,902	843,110.10	
		IRON MOUNTAIN INC	16,395	543,330.30	
		KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	406,193.40	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,675	714,574.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	841,047.80	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	470,522.96	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	12,872	570,487.04	
		PROLOGIS INC	39,305	3,834,202.75	
		PUBLIC STORAGE	7,965	1,854,411.30	
		REALTY INCOME CORPORATION	16,047	1,287,771.75	
		REGENCY CENTERS CORP	9,451	605,053.02	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,428	2,143,257.76	
		SL GREEN REALTY CORP	3,945	374,932.80	
		SUN COMMUNITIES INC	4,598	772,418.02	
		UDR INC	14,289	719,022.48	
VENTAS INC	19,185	1,146,303.75			
VEREIT INC	54,273	544,358.19			

	VICI PROPERTIES INC	26,533	745,842.63
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	591,050.34
	WELLTOWER INC	20,533	1,834,007.56
	WEYERHAEUSER CO	37,766	1,157,905.56
	WP CAREY INC	8,640	741,571.20
	米ドル 小計	698,897	45,400,816.57 (4,987,733,708)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	4,697	276,089.66
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	142,899.18
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,391	223,198.68
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	205,892.47
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	112,712.40
	カナダドル 小計	32,660	960,792.39 (79,726,552)
ユーロ	COVIVIO	2,388	264,590.40
	GECINA SA	2,689	485,364.50
	ICADE	1,265	130,421.50
	KLEPIERRE	9,305	290,781.25
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,311	933,980.25
	ユーロ 小計	22,958	2,105,137.90 (250,406,153)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	261,049.37
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	321,143.46
	SEGRO PLC	61,311	555,845.52
	英ポンド 小計	138,976	1,138,038.35 (162,534,637)
オーストラリアドル	APA GROUP	55,097	627,554.83
	DEXUS	62,385	830,344.35
	GOODMAN GROUP	86,301	1,429,144.56
	GPT GROUP	97,296	611,991.84
	LENDLEASE GROUP	25,262	449,410.98
	MIRVAC GROUP	226,368	747,014.40
	SCENTRE GROUP	290,995	1,099,961.10
	STOCKLAND	103,417	521,221.68
	SYDNEY AIRPORT	49,760	417,984.00
	TRANSURBAN GROUP	141,455	2,288,741.90
	VICINITY CENTRES	146,656	369,573.12
	オーストラリアドル 小計	1,284,992	9,392,942.76 (690,850,939)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	170,000	2,050,200.00

	LINK REIT		112,500	8,893,125.00
	香港ドル 小計		282,500	10,943,325.00 (154,738,615)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		150,400	493,312.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,400	269,928.00
	CAPITALAND MALL TRUST		160,800	405,216.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		104,900	245,466.00
	SUNTEC REIT		64,600	116,280.00
	シンガポールドル 小計		611,100	1,530,202.00 (120,947,166)
	合計			6,446,937,770 (6,446,937,770)

(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 39銘柄	2.0%	77.4%
カナダドル	投資証券 5銘柄	0.0%	1.2%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	3.9%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.5%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.3%	10.7%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 5銘柄	0.0%	1.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(令和 2年 2月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	658,479,599
金銭信託	251,210,849
コール・ローン	16,201,925
国債証券	168,803,691,286
未収利息	1,350,042,152
前払費用	47,930,201

流動資産合計 171,127,556,012

資産合計

171,127,556,012

負債の部

流動負債

(令和2年2月18日現在)

未払解約金	160,434,330
未払利息	47
その他未払費用	15,491
流動負債合計	160,449,868
負債合計	160,449,868
純資産の部	
元本等	
元本	92,850,628,728
剰余金	
剰余金又は欠損金()	78,116,477,416
元本等合計	170,967,106,144
純資産合計	170,967,106,144
負債純資産合計	171,127,556,012

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和1年6月28日
	至 令和2年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和2年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,850,628,728口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8413円

項目	(令和 2年 2月18日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 18,413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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	自 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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	(令和 2年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

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 令和 1年 6月28日 至 令和 2年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（令和 2年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	90,123,282,996円
同期中における追加設定元本額	14,710,317,354円
同期中における一部解約元本額	11,982,971,622円
令和 2年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	21,534,751,681円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	664,752,688円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,805,039,664円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	904,627,912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）	102,371,639円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,195,766円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	32,751,972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）	93,743,791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）	132,988,962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）	74,508,384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）	158,082,820円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	22,698,330円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	198,310,140円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	215,945,347円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	167,467,429円
イオン・バランス戦略ファンド	54,374,494円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	6,620,827円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	55,973,419円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	60,740,528円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	115,914,254円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	44,168,094円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	20,348,679円

(令和2年2月18日現在)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,682,823円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	578,915円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	124,199円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	59,106円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,345,111円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,695,045,476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>	66,234,760円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,180,484,834円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,428,874,945円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,285,103,255円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	39,245,451円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,496,233円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	572,400円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	744,253,727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>	121,214,505円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,877,296,919円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,043,606,193円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,627,146円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,979,645,464円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	406,885,833円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,273,388円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,471,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	38,632,744円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	128,196,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	505,626,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	154,651,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,809,310円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,272,010,412円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,121,083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>	2,401,949,169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>	1,365,567,210円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,716,314,439円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	582,852,083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>	58,758,346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>	77,534,671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>	254,148,937円

(令和 2年 2月18日現在)	
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 >	238,480,125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 >	1,418,504,207円
合計	92,850,628,728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	3,800,000.00	3,785,007.82	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,985,234.39	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,476,621.10	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,685,445.32	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,088,351.57	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,589,875.00	
		US TREASURY N/B 1.25	4,500,000.00	4,483,828.12	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,985,351.57	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,996,015.64	
		US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,396,343.74	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,993,593.76	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,996,250.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,496,992.20	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,498,144.52	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,997,773.43	
		US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,581,109.38	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,002,929.68	
		US TREASURY N/B 1.5	5,800,000.00	5,813,820.29	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,008,906.25	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,009,726.57	
		US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,007,734.38	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,500,644.53	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,011,171.88	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,417,929.69	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,520,371.08	
		US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,024,531.24	

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,020,976.57	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,021,796.89	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,024,257.82	
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,421,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,101,755.87	
US TREASURY N/B 1.625	5,500,000.00	5,544,257.84	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,023,671.89	
US TREASURY N/B 1.625	6,450,000.00	6,473,179.68	
US TREASURY N/B 1.75	10,500,000.00	10,539,785.13	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,015,351.57	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,018,984.39	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,812,023.44	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,416,781.25	
US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,130,109.37	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,022,265.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,023,320.32	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,026,250.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,030,117.18	
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,762,343.75	
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	11,965,015.68	
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	862,085.93	
US TREASURY N/B 1.75	3,900,000.00	3,962,156.25	
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,056,562.52	
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,419,687.51	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,018,359.38	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,029,062.50	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,030,585.93	
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,718,859.37	
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,855,312.51	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,036,914.07	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,835,789.05	
US TREASURY N/B 1.875	3,500,000.00	3,582,851.58	
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,276,000.00	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,008,593.76	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,014,882.82	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,018,750.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,023,437.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,026,484.39	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,340,312.50	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,535,000.00	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,134,390.62	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,042,421.89	

US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,554,960.95
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,080,664.05
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,866,945.32
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,047,812.50
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,379,664.07
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,562,011.72
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,596,523.45
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,425,472.66
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,222,578.16
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,715,187.50
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,714,410.15
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,037,812.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,171.89
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,037,148.43
US TREASURY N/B 2.125	4,500,000.00	4,569,082.02
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,049,804.68
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,080,781.24
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,182,585.95
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,055,703.12
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,684,335.97
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,606,503.91
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,125,625.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,858,359.38
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,069,203.12
US TREASURY N/B 2.125	3,900,000.00	4,050,363.29
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,028,750.00
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,024,375.00
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,540,078.12
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,830,406.26
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,374,410.16
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,095,156.25
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,368,187.50
US TREASURY N/B 2.25	4,800,000.00	4,962,562.50
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,556,484.37
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,538,957.04
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,220,246.08
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,173,593.76
US TREASURY N/B 2.25	7,200,000.00	7,526,531.23
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,616,906.27
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,469,343.77
US TREASURY N/B 2.25	5,600,000.00	5,895,312.52
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,963,777.35
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,708,125.00

US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	5,045,703.15
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,019,921.88
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,670,031.26
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,233,656.25
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,839,039.07
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,833,187.52
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,190,554.71
US TREASURY N/B 2.375	6,200,000.00	6,622,375.00
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,290,000.00
US TREASURY N/B 2.5	8,900,000.00	8,989,347.63
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,937,332.03
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,572,597.66
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,188,085.95
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,953,828.12
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,574,648.44
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,482,960.93
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,460,351.58
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,161,000.00
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,471,562.50
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	506,855.47
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,058,750.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,063,281.24
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,062,812.50
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,144,531.24
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,552,625.00
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	6,178,359.40
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	6,854,695.34
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,074,531.24
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,427,562.50
US TREASURY N/B 2.75	4,900,000.00	5,105,570.33
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,090,312.50
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,230,859.40
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,503,703.15
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,364,960.96
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,128,281.26
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,337,109.40
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,244,785.14
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,237,625.02
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,270,312.50
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,177,125.00
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,362,578.14
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,723,125.00

US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,096,406.24
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,210,625.00
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,107,656.26
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,358,382.81
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,180,136.71
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,695,703.12
US TREASURY N/B 2.875	6,500,000.00	7,166,757.84
US TREASURY N/B 2.875	7,000,000.00	7,732,812.50
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,474,375.00
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,656,250.00
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,216,500.00
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,065,656.25
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,332,656.24
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,360,714.83
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	2,127,093.75
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,149,960.95
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,750,625.00
US TREASURY N/B 3	4,200,000.00	5,001,937.50
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,999,414.07
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,640,343.75
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,730,898.45
US TREASURY N/B 3	7,400,000.00	8,930,875.00
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,599,484.39
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,059,531.25
US TREASURY N/B 3.125	6,700,000.00	7,552,156.25
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,324,296.87
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,410,000.00
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,769,882.82
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	4,595,328.14
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,957,437.51
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	5,027,187.52
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,005,054.70
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,010,750.00
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,103,125.00
US TREASURY N/B 3.625	3,400,000.00	4,423,187.50
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,694,062.50
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,971,093.75
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	5,304,687.52
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,996,757.82
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,386,718.75
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	838,359.37
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	697,148.44
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	987,710.94

	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,982,531.25
	US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,562,046.88
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,035,937.50
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	283,203.12
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,430,312.50
	US TREASURY N/B 4.625	3,800,000.00	5,537,312.50
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,232,070.32
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	738,671.87
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	651,132.81
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	441,300.00
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	657,656.25
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,261,445.31
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,338,984.38
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	931,968.75
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	661,835.94
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,445,945.31
	米ドル 小計	708,970,000.00	752,201,994.15 (82,636,911,077)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,960,500.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,800,000.00	1,791,504.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,982,740.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,976,440.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	2,965,470.00
	CANADA-GOV'T 1	1,600,000.00	1,558,416.00
	CANADA-GOV'T 1.25	600,000.00	593,628.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,004,420.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,004,890.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,007,750.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,110,065.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	943,776.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,032,880.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,463,000.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,508,164.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,196,579.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,850,760.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,423,939.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	711,335.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,021,190.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,141,490.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,183,265.00
	CANADA-GOV'T 5	1,750,000.00	2,689,890.00
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	344,270.00

	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	761,640.00
	CANADA-GOV'T 8	700,000.00	1,018,668.00
	カナダドル 小計	35,500,000.00	39,246,669.00 (3,256,688,593)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,619,840.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	19,243,200.00
	MEXICAN BONOS 6.5	52,000,000.00	51,900,160.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	26,391,000.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,542,010.00
	MEXICAN BONOS 7.75	11,000,000.00	12,141,360.00
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	28,328,400.00
	MEXICAN BONOS 8.5	28,000,000.00	31,750,460.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	47,232,600.00
	メキシコペソ 小計	241,000,000.00	260,149,030.00 (1,537,480,767)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,041,635.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,387,841.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	757,589.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	544,255.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,950,160.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,757,968.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	768,817.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,663,610.00
	BELGIAN 0321 4.25	4,300,000.00	4,638,152.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,304,500.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,917,787.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,643,760.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	568,725.00
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	989,394.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,047,140.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	747,565.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	478,432.00
	BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	645,660.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,523,900.00
	BELGIAN 1	1,300,000.00	1,454,414.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	463,136.00
	BELGIAN 1.6	1,150,000.00	1,450,506.50
	BELGIAN 1.9	500,000.00	640,180.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	762,555.00
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,417,256.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	1,003,970.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,514,610.00
BTPS 0.45	1,500,000.00	1,514,130.00	

BTPS 0.65	2,000,000.00	2,044,360.00
BTPS 0.9	2,250,000.00	2,306,092.50
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,058,020.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,059,100.00
BTPS 1	2,300,000.00	2,362,008.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,028,820.00
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,678,176.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,064,000.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,079,580.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,903,608.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,058,750.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,866,185.00
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,285,908.00
BTPS 1.65	1,700,000.00	1,811,129.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,071,250.00
BTPS 2	2,300,000.00	2,511,508.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,765,520.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,655,430.00
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,101,690.00
BTPS 2.15	500,000.00	521,570.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,113,640.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,346,748.00
BTPS 2.3	600,000.00	625,026.00
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,269,708.00
BTPS 2.45	400,000.00	447,148.00
BTPS 2.5	600,000.00	664,170.00
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,230,878.00
BTPS 2.7	2,050,000.00	2,427,610.00
BTPS 2.8	300,000.00	351,846.00
BTPS 2.8	900,000.00	1,077,615.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,223,390.00
BTPS 3	3,500,000.00	4,190,795.00
BTPS 3.1	1,700,000.00	2,118,421.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,946,220.00
BTPS 3.35	850,000.00	1,080,834.50
BTPS 3.45	1,600,000.00	2,152,736.00
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,373,043.00
BTPS 3.75	1,400,000.00	1,459,122.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,097,040.00
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,386,208.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,318,540.00
BTPS 3.85	400,000.00	574,196.00
BTPS 4	2,100,000.00	2,893,485.00

BTPS 4.5	2,300,000.00	2,629,406.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,525,900.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,236,122.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,799,316.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,906,400.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,331,750.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,535,984.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,211,500.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,235,650.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,078,090.00	
BTPS 5	1,800,000.00	2,827,782.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,682,583.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,370,208.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,301,080.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,628,540.00	
BTPS 6	2,700,000.00	4,125,168.00	
BTPS 6.5	3,700,000.00	5,319,268.00	
BTPS 7.25	400,000.00	576,988.00	
BTPS 9	300,000.00	398,868.00	
BUNDESUBL-173 0	2,500,000.00	2,518,125.00	
BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,032,220.00	
BUNDESUBL-176 0	2,000,000.00	2,035,660.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,400,000.00	3,532,158.00	
DEUTSCHLAND REP 0	500,000.00	521,145.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,905,192.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,088,326.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,400,000.00	2,559,024.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,644,775.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,400,000.00	1,494,584.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,619,880.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,166,980.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,398,046.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,236,345.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,450,000.00	1,924,962.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	500,000.00	532,930.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,392,690.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,185,880.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,327,226.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	4,000,000.00	4,391,200.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,641,795.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,462,958.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	514,000.00	

DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,534,102.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,453,828.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,087,424.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,088,566.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,763,760.50
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,320,640.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	4,100,000.00	7,126,620.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,150,000.00	2,298,746.50
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,490,778.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,495,430.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,525,296.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	838,250.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,530,620.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	405,524.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	427,300.00
FINNISH GOV'T 0.5	1,400,000.00	1,497,580.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	549,675.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	231,286.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,067,490.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,058,400.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,108,690.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	765,640.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	755,880.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,048,210.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,246,670.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,018,390.00
FRANCE O.A.T. 0	2,600,000.00	2,620,228.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,025,320.00
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,231,416.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,037,540.00
FRANCE O.A.T. 0	5,000,000.00	5,116,350.00
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,254,582.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,048,480.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,502,696.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,052,743.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,701,635.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,300,000.00	3,518,823.00
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,586,176.00
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,851,130.00
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,223,122.50
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,747,350.00
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,979,004.00
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,802,072.00

FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,302,474.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	400,000.00	496,644.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,233,100.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,300,000.00	2,552,402.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,900,000.00	3,682,594.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,107,856.00	
FRANCE O.A.T. 2	3,000,000.00	4,113,360.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,047,706.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,812,760.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,459,280.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,750,000.00	4,653,862.50	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,399,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,664,125.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,641,484.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,115,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,576,086.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,363,980.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,797,951.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	3,009,160.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,541,680.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,352,907.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,739,472.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,219,050.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,646,944.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,117,380.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	776,682.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	405,552.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	719,453.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	764,309.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,083,020.00	
IRISH GOVT 1.1	1,100,000.00	1,224,993.00	
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	488,396.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	368,964.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,341,670.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	751,818.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,158,890.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	568,645.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,943,880.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,821,708.00	
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,048,260.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,773,746.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,300,000.00	1,370,330.00	

NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,597,080.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	600,000.00	652,950.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,524,726.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,200,000.00	1,316,676.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,731,856.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,115,780.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,605,630.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,349,900.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,044,944.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	843,960.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	790,629.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,354,014.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,856,052.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,033,067.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,122,363.00
REP OF AUSTRIA 0.5	1,300,000.00	1,382,615.00
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	908,089.00
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	970,254.00
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	760,725.00
REP OF AUSTRIA 1.2	1,500,000.00	1,644,195.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	285,486.00
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	1,294,160.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,213,883.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,087,000.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	803,478.00
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	1,007,046.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,223,365.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,065,470.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,093,730.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	1,123,030.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,192,866.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,326,620.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,498,550.00
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,105,588.00
SPANISH GOV'T 0.25	2,500,000.00	2,554,025.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,037,560.00
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	511,810.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,036,320.00
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,939,328.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,209,480.00
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,769,248.00
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	663,450.00
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,229,208.00

	SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,326,924.00	
	SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,402,796.00	
	SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	471,004.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	400,000.00	449,968.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,989,119.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,258,600.00	
	SPANISH GOV'T 2.35	1,700,000.00	2,106,742.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	1,750,000.00	2,430,155.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,394,714.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,993,768.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,885,147.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,224,995.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,582,926.50	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,349,980.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,270,106.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	3,143,610.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,403,200.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,647,065.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,146,680.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,295,756.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,635,830.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,892,753.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,477,805.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,471,942.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	691,340.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,339,886.00	
	ユーロ 小計	429,840,000.00	523,495,780.00 (62,269,823,031)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,800,576.00	
	UK TSY GILT 0.625	1,000,000.00	1,005,570.00	
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	756,345.00	
	UK TSY GILT 0.875	1,400,000.00	1,430,842.00	
	UK TSY GILT 1	1,300,000.00	1,326,598.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,500,000.00	1,579,395.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,063,940.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,850,569.00	
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	572,350.50	
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,178,120.00	
	UK TSY GILT 1.625	300,000.00	348,924.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,238,352.00	
	UK TSY GILT 1.75	2,300,000.00	2,568,939.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,650,000.00	1,904,166.00	

	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,193,005.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,866,590.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,482,832.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,871,819.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,313,008.00
	UK TSY GILT 3.5	2,350,000.00	3,562,459.00
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,850,250.50
	UK TSY GILT 3.75	1,500,000.00	1,574,130.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,772,480.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,606,635.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,374,619.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,412,917.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,971,438.00
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,565,917.50
	UK TSY GILT 4.25	1,350,000.00	2,118,541.50
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,069,847.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,584,485.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,513,070.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,330,198.00
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,643,884.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,277,328.50
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,639,106.50
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,971,048.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,958,368.00
	UK TSY GILT 6	950,000.00	1,393,108.50
	UK TSY GILT 8	820,000.00	898,711.80
	英bond 小計	56,120,000.00	75,440,483.30 (10,774,409,824)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,281,480.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1	7,400,000.00	7,989,706.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,471,310.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,723,450.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,707,440.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,196,930.00
	スウェーデンクローナ 小計	36,000,000.00	41,370,316.00 (468,311,977)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,533,950.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,099,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,779,380.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,126,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,194,800.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,263,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,176,400.00

ノルウェークローネ 小計		31,200,000.00	32,173,630.00 (381,257,515)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	8,100,000.00	8,721,270.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,403,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,810,000.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,448,700.00
	DENMARK - BULLET 4.5	11,500,000.00	22,109,900.00
デンマーククローネ 小計		37,600,000.00	50,492,870.00 (803,846,490)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,012,120.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,014,780.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,614,435.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,072,210.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	8,900,000.00	9,487,845.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,919,240.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,283,560.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,651,208.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,832,418.00
ポーランドズロチ 小計		31,900,000.00	33,887,816.00 (945,470,066)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1,400,000.00	1,459,780.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,022,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	2,082,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,298,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,538,055.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,704,042.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,492,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,060,254.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,504,490.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	963,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,804,401.20
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,134,270.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,506,770.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,150,000.00	1,491,665.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,636,608.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,150,000.00	2,586,880.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,971,620.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,909,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,298,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	2,969,596.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,797,375.00	
オーストラリアドル 小計		38,250,000.00	44,233,447.50 (3,253,370,063)

シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,110,670.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,248,840.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	459,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	806,529.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	446,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	745,689.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	832,240.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	950,000.00	1,134,675.25	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,800,000.00	2,027,700.00	
シンガポールドル 小計		8,050,000.00	8,812,143.75	(696,511,842)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,130,235.70	
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,246,887.42	
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,631,250.00	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,642,500.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,542,713.20	
マレーシアリングgit 小計		28,200,000.00	30,193,586.32	(799,526,165)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	41,604,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	16,018,240.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	59,000,000.00	50,386,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	27,500,000.00	25,883,000.00	
南アフリカランド 小計		162,500,000.00	133,891,240.00	(980,083,876)
合計			168,803,691,286	(168,803,691,286)

(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 212銘柄	48.3%	49.0%
カナダドル	国債証券 26銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 267銘柄	36.4%	36.9%
英ポンド	国債証券 40銘柄	6.3%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 5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 21銘柄	1.9%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 9銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.6%	0.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

2020年 2月28日現在

資産総額	1,011,981円
負債総額	41円
純資産総額（ - ）	1,011,940円
発行済口数	1,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0119円
（1万口当たり純資産額）	（10,119円）

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

2020年 2月28日現在

資産総額	2,177,751円
負債総額	93円
純資産総額（ - ）	2,177,658円
発行済口数	2,156,528口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0098円
（1万口当たり純資産額）	（10,098円）

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

2020年 2月28日現在

資産総額	1,007,485円
負債総額	42円
純資産総額（ - ）	1,007,443円
発行済口数	1,000,000口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0074円
（1万口当たり純資産額）	（10,074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。
- ヘ 償還金
償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。
- ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【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

	2020年2月28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。

2020年2月28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	759	7,678,486
単位型株式投資信託	121	641,090
追加型公社債投資信託	1	29,437
単位型公社債投資信託	188	508,957
合計	1,069	8,857,971

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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

(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 業務執行社員	公認会計士	飯田 浩 司	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐藤 榮 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（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。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 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. 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。
- b. 2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項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。

*日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に2020年7月27日に資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

□ 販売会社

- (イ) 名称 株式会社三井住友銀行
- (ロ) 資本金の額 1,770,996百万円(2019年9月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付け、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【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は提出されておりません。

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2年3月31日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の令和1年6月28日から令和2年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の令和2年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友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．XBRL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2年3月31日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス50（標準型）の令和1年6月28日から令和2年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス50（標準型）の令和2年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友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．XBRL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2年3月31日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の令和1年6月28日から令和2年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の令和2年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友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．XBRL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。