

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年6月4日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド  
以下「当ファンド」といいます。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

\*ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC世界分散」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

## (6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

## (7) 【申込期間】

2020年6月5日から2020年12月7日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

## (8) 【申込取扱場所】

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

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

## (9) 【払込期日】

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

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

## (10) 【払込取扱場所】

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

## (11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

ハ お申込不可日

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

ニ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用  
ありません。

ホ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、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。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金2,000億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。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
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、不動産投信）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、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	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	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に 対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるもの をいいます。
対象指数	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

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

(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 一般 大型株 中小型株	<b>年1回</b> 年2回 年4回	<b>グローバル</b> <b>(日本を含む)</b> 日本 北米	<b>ファミリーファンド</b>	<b>あり</b> <b>(部分ヘッジ)</b>	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他	欧州 アジア オセアニア 中南米			
不動産投信	( )	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合(株式、</b> <b>債券、不動産投信)</b> <b>資産配分固定型))</b>		中近東(中東) エマージング			<b>その他</b> <b>(合成指数)</b>
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年10月 3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。

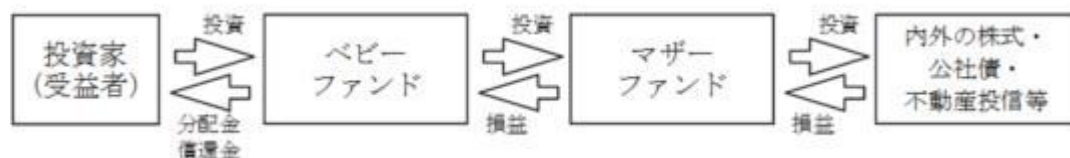
(ハ) 販売会社

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。

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



## ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2020年3月31日現在)

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立  
 1987年2月20日 証券投資顧問業の登録  
 1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可  
 1999年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合  
 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更

- 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得  
 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更  
 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併  
 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

## (八) 大株主の状況

(2020年3月31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

世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、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て運用を行います。

## ロ 投資態度

(イ) 以下の各指数の比率に基づいて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。

指数	比率
NOMURA-BPI (総合)	15%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジベース)	5%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	20%
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	10%
MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	20%
MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	10%
東証REIT指数 (配当込み)	5%
S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

(ロ) 以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、基本資産配分比率は下記の通りとします。

マザーファンドおよび対象指数	基本資産 配分比率



国内債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：NOMURA-BPI(総合)	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 対象指数：TOPIX(東証株価指数、配当込み)	10%
外国株式インデックス・マザーファンド 対象指数：MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド 対象指数：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド 対象指数：東証REIT指数(配当込み)	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド 対象指数：S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

- (八) 実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 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** マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

債券 ■ 国内債券 ■ 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり) ■ 先進国債券(除く日本)

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式(除く日本) ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

**2** 各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

[ 各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率 ]

マザーファンド	対象指数	基本資産配分比率
国内債券パッシブ・マザーファンド	NOMURA-BPI(総合)	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	TOPIX(東証株価指数、配当込み)	10%
外国株式インデックス・マザーファンド	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

**3** 実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。

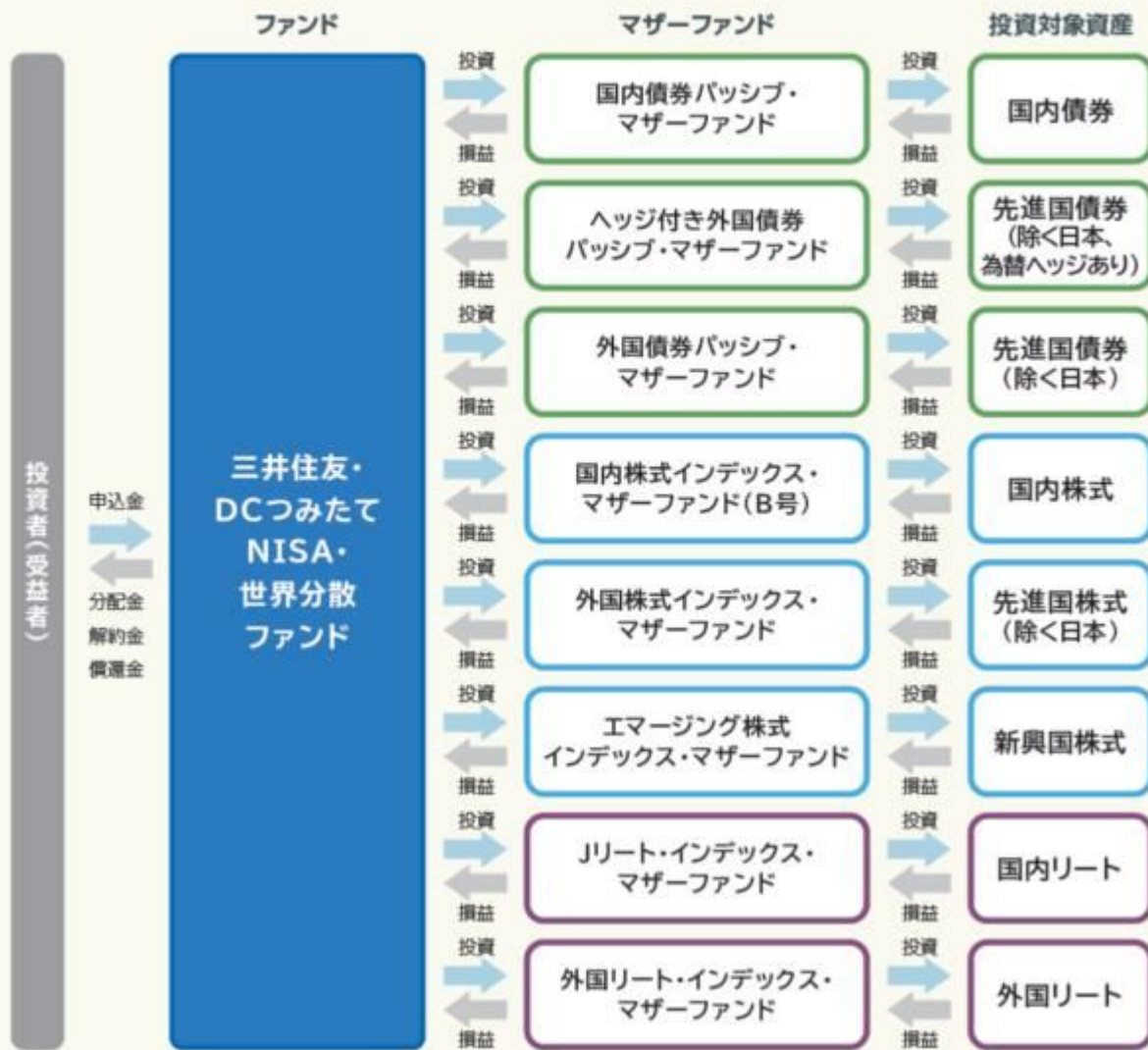
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

NOMURA-BPI(総合)は野村證券株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社東京証券取引所、MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが、それぞれ公表している指数で各社の知的財産です。

上記各指数に関する知的所有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。

## 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れを通じて、実際の運用を行います。



## 各マザーファンドの投資方針等

## ▶ 債券

## 国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● NOMURA-BPI(総合)の動きと連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

## 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり)…為替ヘッジあり

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

## 先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。</li> <li>● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>● 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。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

## ▶ 株式

## 国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指します。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## 新興国株式…為替ヘッジなし

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

## ▶リート

## 国内リート

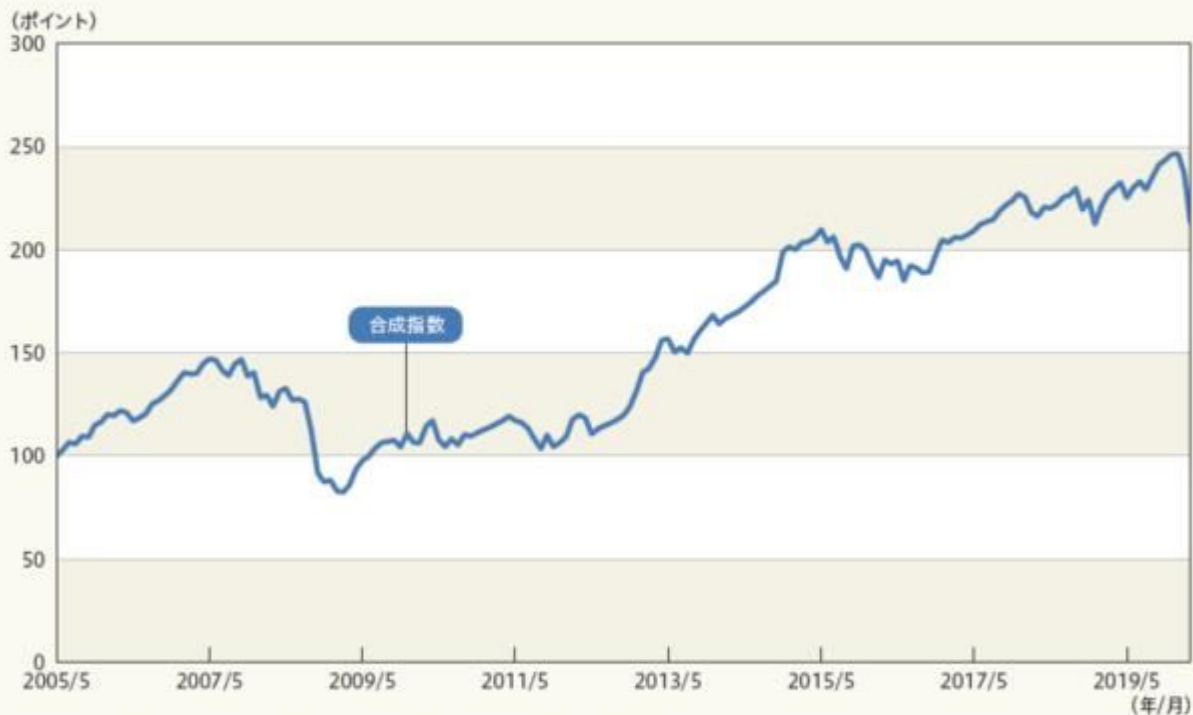
ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>◦ 東証REIT指数(配当込み)の動きと連動する投資成果を目指します。</li> <li>◦ 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 外国リート…為替ヘッジなし

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

## ベンチマークの推移

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



※データは2005年5月末～2020年3月末。2005年5月末を100として指数化。

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

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

ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 2」をご覧ください。

(出所)FactSetのデータを基に委託会社作成

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、国内債券パッシブ・マザーファンド、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンド、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、外国株式インデックス・マザーファンド、エマージング株式インデックス・マザーファンド、リート・インデックス・マザーファンド、外国リート・インデックス・マザーファンドの受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価

証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券(ただし、投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 八 投資対象とする金融商品

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

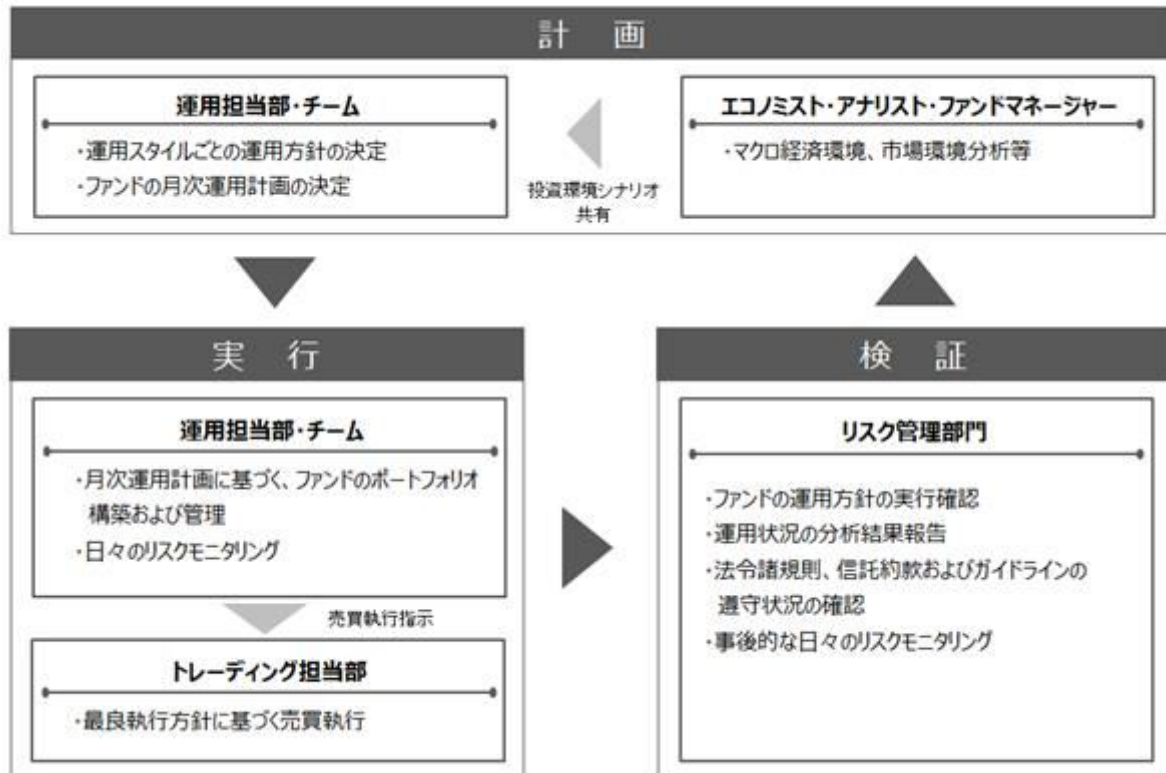
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの



## 6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

## (3) 【運用体制】

## イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

## 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9月10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、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

## （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- 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、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 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るものとします。
  - （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。
  - （ニ）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、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

口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八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、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの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「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。
- (ニ) 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、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。
- (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られたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、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、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 - B P I (総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) NOMURA - B P I (総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  20. 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
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 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(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、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。

(ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

(イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと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) 保有する外貨建て資産については、対円で為替のフルヘッジを原則とします。

(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

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す。)

17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)



18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 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

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 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）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10%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割合には、制限を設けません。
- （ホ）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。
- （ヘ）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。
- （ト）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。
- （チ）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。
- （リ）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と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と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

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す。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 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。

## （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部に上場され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

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. 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券
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。

### （外国株式インデックス・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

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

#### （２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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．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. 預託証券(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券

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

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5で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。

#### (エマージング株式インデックス・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

イ 基本方針

M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として新興国の株式(預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。

(ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

(ニ) 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

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、有価証券にかかるものに限りません。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 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) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。))への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(ニ) 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%以下とします。

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

整を行うこととします。

- (ヘ) 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。
- (ト) 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。

## ( J リート・インデックス・マザーファンド )

### ( 1 ) 投資方針等

#### イ 基本方針

日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）されている不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 不動産投資信託（REIT）などへの投資にあたっては、東証REIT指数（配当込み）採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
- (ハ) 不動産投資信託（REIT）の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 運用の効率化を図るため、東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- (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。

### ( 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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 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。）
5. 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。）
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

#### 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) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は行いません。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (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

スポン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。

(ホ) 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。

## (外国リート・インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)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) 不動産投資信託(REIT)などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ニ) 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。

(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。

### (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(デリバティブ取引を除きます。)

#### ロ 投資対象とする有価証券

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 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。)
5. 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。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

#### 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) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

(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



スポン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。

- (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。

### 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) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

#### (ニ) 信用リスク

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

#### (ホ) 為替変動リスク

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

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

#### (ヘ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になる

ことや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

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

#### (ト) 市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、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。

#### (チ) 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、マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額、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。

#### (リ) 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。

#### (ヌ) 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。

#### (ル) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

#### ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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



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

### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

## 各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。  
※上記各指数に関する知的財産権その他の権利は、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0.231%（税抜き0.21%）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0.09%	ファンドの運用等の対価
販売会社	年0.10%	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。

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

(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、マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

(イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申

込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

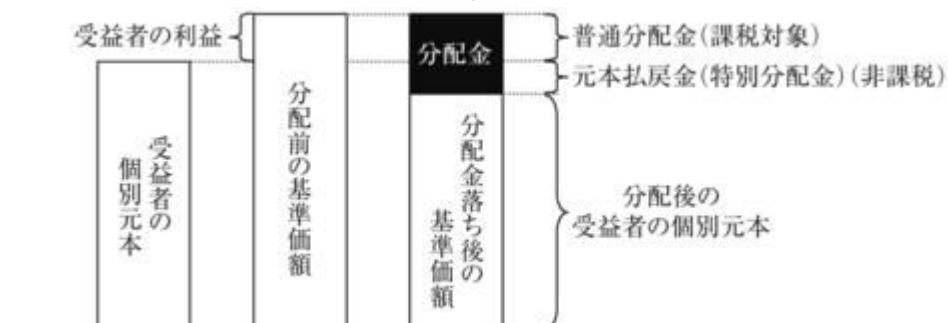
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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


当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」の適用対象です。

ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※つみたてNISA、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。

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

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2020年3月末現在の情報をもとに作成  
 しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2020年 3月31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	368,199,811	98.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,653,316	1.77
合計(純資産総額)		374,853,127	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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

#### イ 主要投資銘柄

2020年 3月31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	外国株式インデックス・マザーファンド	24,370,050	3.5690	86,976,709	3.1452	76,648,681	20.45
日本	親投資信託受益証券	外国債券バッシブ・マザーファンド	37,958,293	1.8046	68,502,055	1.8646	70,777,033	18.88
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	35,531,564	2.0661	73,411,765	1.6524	58,712,356	15.66
日本	親投資信託受益証券	国内債券バッシブ・マザーファンド	41,703,364	1.3029	54,336,571	1.2846	53,572,141	14.29
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	34,566,901	1.2607	43,578,543	1.0663	36,858,686	9.83
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)	15,994,398	2.5004	39,993,754	2.2719	36,337,672	9.69
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド	11,604,478	1.4807	17,182,751	1.5253	17,700,310	4.72
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	8,949,503	2.4840	22,230,922	1.9658	17,592,932	4.69

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 3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.23
合計	98.23

## 【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
2019年 3月末日	202,438,231		10,308	
4月末日	216,938,975		10,430	
5月末日	226,539,823		10,098	
6月末日	256,080,669		10,302	
7月末日	275,449,778		10,430	
8月末日	284,860,766		10,261	
9月末日	309,146,537		10,505	
10月末日	335,372,044		10,777	
11月末日	353,932,092		10,876	
12月末日	373,898,534		10,995	
2020年 1月末日	394,407,508		11,002	
2月末日	395,819,025		10,579	
3月末日	374,853,127		9,525	



## 【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	0
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	0

## 【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率（％）
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期（中間期）	5.5

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

## （４）【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期（中間期）	124,069,957	28,609,933

（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

国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年 3月31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	96,863,295,680	77.34
地方債証券	日本	8,511,799,700	6.80

特殊債券	日本	13,081,524,443	10.45
社債券	日本	5,875,417,000	4.69
	オーストラリア	200,028,000	0.16
	フランス	199,884,000	0.16
	小計	6,275,329,000	5.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		509,187,956	0.40
合計(純資産総額)		125,241,136,779	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 3月31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	12,177,038,867	49.60
	フランス	2,304,354,188	9.39
	イタリア	2,094,640,188	8.53
	イギリス	1,511,155,615	6.16
	ドイツ	1,427,496,985	5.82
	スペイン	1,276,721,865	5.20
	ベルギー	531,959,733	2.17
	カナダ	442,417,562	1.80
	オーストラリア	418,899,139	1.71
	オーストリア	409,009,553	1.67
	オランダ	386,646,088	1.58
	シンガポール	206,431,080	0.84
	アイルランド	190,122,146	0.77
	メキシコ	166,037,806	0.68
	ポーランド	135,378,196	0.55
	フィンランド	118,469,148	0.48
	デンマーク	115,515,103	0.47
	南アフリカ	98,526,125	0.40
	スウェーデン	64,003,318	0.26
ノルウェー	51,750,106	0.21	
	小計	24,126,572,811	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		421,492,487	1.72
合計(純資産総額)		24,548,065,298	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		24,110,826,700	98.21

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 3月31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	78,508,632,199	49.37
	フランス	14,752,525,916	9.28
	イタリア	13,413,886,689	8.44
	イギリス	9,760,079,481	6.14
	ドイツ	8,768,057,260	5.51
	スペイン	8,307,724,544	5.22
	ベルギー	3,673,153,366	2.31
	カナダ	2,849,050,365	1.79
	オランダ	2,823,426,336	1.78
	オーストラリア	2,706,782,634	1.70
	オーストリア	2,350,340,687	1.48
	フィンランド	1,128,684,583	0.71
	メキシコ	1,089,424,385	0.69
	アイルランド	1,035,038,436	0.65
	ポーランド	882,847,154	0.56
	デンマーク	768,939,887	0.48
	マレーシア	732,887,121	0.46
	南アフリカ	661,366,277	0.42
	シンガポール	638,072,207	0.40
	スウェーデン	415,473,420	0.26
ノルウェー	361,459,800	0.23	
	小計	155,627,852,747	97.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,377,417,791	2.12
合計(純資産総額)		159,005,270,538	100.00

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2020年 3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	150,788,529,780	97.49
新株予約権証券	日本	0	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,883,817,463	2.51
合計(純資産総額)		154,672,347,243	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	2,988,390,000	1.93
合計	買建	-	2,988,390,000	1.93

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 3月31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	120,859,081,477	64.89
	イギリス	9,279,546,244	4.98
	スイス	7,325,316,591	3.93
	フランス	6,403,394,792	3.44
	カナダ	6,087,193,393	3.27
	ドイツ	5,181,298,169	2.78
	アイルランド	3,430,140,127	1.84
	オーストラリア	3,376,825,256	1.81
	オランダ	3,316,630,815	1.78
	香港	1,688,253,104	0.91
	スペイン	1,642,507,213	0.88
	スウェーデン	1,589,205,875	0.85
	デンマーク	1,388,431,105	0.75
	イタリア	1,142,243,122	0.61
	フィンランド	710,284,439	0.38
	シンガポール	690,822,392	0.37
	バミューダ	639,382,218	0.34
	ベルギー	542,147,148	0.29
	ジャージー	501,408,971	0.27
	イスラエル	378,870,476	0.20
ケイマン諸島	373,005,841	0.20	
ノルウェー	335,157,685	0.18	

	ニュージーランド	192,889,605	0.10
	ルクセンブルグ	143,511,248	0.08
	ポルトガル	112,616,987	0.06
	オーストリア	106,782,912	0.06
	キュラソー	106,145,852	0.06
	リベリア	29,275,457	0.02
	マン島	15,893,077	0.01
	パプアニューギニア	10,867,515	0.01
	英ヴァージン諸島	7,626,398	0.00
	小計	177,606,755,504	95.36
投資証券	アメリカ	3,702,004,085	1.99
	オーストラリア	413,509,271	0.22
	香港	128,580,145	0.07
	フランス	127,182,390	0.07
	イギリス	102,381,920	0.05
	シンガポール	86,402,803	0.05
	カナダ	38,558,934	0.02
	小計	4,598,619,548	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,051,254,177	2.17
合計(純資産総額)		186,256,629,229	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	2,855,977,804	1.53
	買建	ドイツ	639,183,639	0.34
	買建	イギリス	199,942,003	0.10
	買建	オーストラリア	317,342,700	0.17
合計	買建	-	4,012,446,146	2.14

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		989,580,700	0.53

売建		194,545,600	0.10
----	--	-------------	------

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	877,314,854	13.38
	台湾	489,019,427	7.46
	韓国	473,177,989	7.22
	中国	363,668,184	5.55
	インド	307,371,822	4.69
	ブラジル	197,544,181	3.01
	香港	157,426,200	2.40
	南アフリカ	138,550,808	2.11
	タイ	86,970,365	1.33
	マレーシア	75,743,853	1.16
	メキシコ	74,071,066	1.13
	インドネシア	59,732,153	0.91
	フィリピン	32,350,549	0.49
	バミューダ	32,321,131	0.49
	ポーランド	29,182,430	0.45
	チリ	24,430,306	0.37
	トルコ	17,361,816	0.26
	アメリカ	14,759,276	0.23
	コロンビア	9,696,322	0.15
	ハンガリー	9,591,463	0.15
	ギリシャ	8,265,718	0.13
	エジプト	5,352,035	0.08
	チェコ	4,370,802	0.07
	ルクセンブルグ	4,266,896	0.07
アルゼンチン	2,567,528	0.04	
ペルー	1,397,917	0.02	
マン島	1,304,867	0.02	
シンガポール	1,304,456	0.02	

	ベルギー	416,866	0.01
	小計	3,499,531,280	53.38
投資信託受益証券	アメリカ	198,869,886	3.03
	香港	193,415,768	2.95
	小計	392,285,654	5.98
投資証券	アメリカ	105,069,597	1.60
	ブラジル	5,556,707	0.08
	南アフリカ	3,000,307	0.05
	メキシコ	1,965,684	0.03
	小計	115,592,295	1.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,548,289,414	38.88
合計(純資産総額)		6,555,698,643	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	2,545,664,296	38.83
合計	買建	-	2,545,664,296	38.83

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,208,541,393	33.68
	売建		590,808,597	9.01

Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	4,721,201,045	96.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		151,515,658	3.11
合計(純資産総額)		4,872,716,703	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物取引	買建	日本	95,160,000	1.95
合計	買建	-	95,160,000	1.95

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	3,934,545,197	74.19
	イギリス	259,492,068	4.89
	オーストラリア	258,667,972	4.88
	シンガポール	209,284,458	3.95
	フランス	127,084,856	2.40
	香港	108,189,993	2.04
	カナダ	92,618,534	1.75
	ベルギー	68,661,403	1.29
	スペイン	27,677,823	0.52
	ニュージーランド	21,537,904	0.41
	ドイツ	15,012,506	0.28
	オランダ	9,549,321	0.18
	アイルランド	4,453,022	0.08
	イスラエル	4,247,342	0.08
	イタリア	1,470,809	0.03
	ガーンジー	1,195,214	0.02
マン島	729,212	0.01	
	小計	5,144,417,634	97.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		158,612,611	2.99
合計(純資産総額)		5,303,030,245	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		21,074,676	0.39

## (2) 投資資産



## 投資有価証券の主要銘柄

## 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 3月31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	103.00	2,091,021,800	0.800	2023/6/20	1.67
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	105.02	1,528,099,200	1.700	2022/12/20	1.22
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	103.24	1,326,659,700	0.800	2023/9/20	1.06
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	102.34	1,294,638,950	0.800	2022/9/20	1.03
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	103.39	1,256,261,400	1.000	2023/3/20	1.00
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	108.82	1,110,035,400	2.100	2024/3/20	0.89
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	107.05	1,097,354,750	1.900	2023/9/20	0.88
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	107.52	1,096,795,800	1.900	2023/12/20	0.88
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	102.04	1,086,736,650	0.900	2022/3/20	0.87
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	101.25	1,048,030,650	0.100	2029/3/20	0.84
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	101.53	1,015,360,000	1.200	2021/6/30	0.81
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	980,000,000	101.93	998,981,600	101.64	996,140,600	0.100	2028/3/20	0.80
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	960,000,000	103.30	991,718,400	102.23	981,484,800	1.000	2022/3/20	0.78
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	133.08	987,468,440	129.71	962,492,720	2.400	2034/3/20	0.77
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	114.36	972,119,500	112.24	954,065,500	2.000	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	890,000,000	101.86	906,554,000	101.35	902,032,800	0.100	2026/3/20	0.72
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	857,000,000	103.12	883,738,400	102.47	878,236,460	0.300	2025/12/20	0.70
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	860,000,000	103.53	890,358,000	101.15	869,933,000	0.100	2029/6/20	0.69
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	113.12	882,367,200	110.68	863,350,800	2.400	2024/6/20	0.69
日本	国債証券	第56回利付国債(20年)	818,000,000	106.68	872,650,580	104.75	856,871,360	2.000	2022/6/20	0.68
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	117.53	872,080,020	115.16	854,509,460	2.300	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	838,000,000	101.95	854,341,000	101.59	851,349,340	0.100	2026/12/20	0.68
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	734,000,000	117.17	860,027,800	115.11	844,966,120	2.100	2026/12/20	0.67
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	815,000,000	103.76	845,644,000	102.86	838,382,350	0.600	2024/3/20	0.67

日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	730,000,000	115.74	844,941,950	113.56	829,046,400	1.200	2034/12/20	0.66
日本	国債証券	第72回利付国債(20年)	753,000,000	112.17	844,677,750	110.00	828,330,120	2.100	2024/9/20	0.66
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	805,000,000	103.34	831,927,250	102.62	826,123,200	0.400	2025/3/20	0.66
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	793,000,000	103.56	821,270,450	102.69	814,331,700	0.600	2023/12/20	0.65
日本	国債証券	第99回利付国債(20年)	693,000,000	119.10	825,411,510	117.29	812,882,070	2.100	2027/12/20	0.65
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	800,000,000	101.73	813,840,000	101.40	811,216,000	0.100	2028/12/20	0.65

## ロ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.34
地方債証券	6.80
特殊債券	10.45
社債券	5.01
合計	99.59

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,700,000	11,201.87	190,431,823	11,636.30	197,817,230	2.125	2024/2/29	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,700,000	11,008.11	187,137,912	11,240.09	191,081,673	1.625	2022/8/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	1,500,000	12,189.13	182,836,951	12,260.37	183,905,695	8.000	2021/11/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,500,000	11,359.05	170,385,820	11,735.78	176,036,776	2.125	2024/9/30	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,450,000	10,829.25	157,024,169	11,550.43	167,481,293	1.500	2026/8/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,400,000	11,027.80	154,389,285	11,367.63	159,146,869	2.000	2022/10/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,200,000	11,782.12	141,385,475	12,234.87	146,818,472	2.625	2026/1/31	0.60
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	1,150,000	12,995.32	149,446,227	12,606.06	144,969,797	0.500	2029/5/25	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	900,000	13,036.64	117,329,793	14,884.20	133,957,826	3.000	2044/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,150,000	11,039.86	126,958,484	11,457.75	131,764,221	1.500	2024/11/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,100,000	11,153.89	122,692,884	11,434.80	125,782,822	2.125	2022/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,050,000	11,100.53	116,555,578	11,978.10	125,770,070	1.750	2029/11/15	0.51
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	850,000	15,198.60	129,188,121	14,737.40	125,267,957	3.500	2026/4/25	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,000,000	11,770.11	117,701,193	12,230.62	122,306,215	2.875	2025/4/30	0.50

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,000,000	11,411.84	114,118,458	11,839.51	118,395,137	2.500	2024/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,000,000	11,371.88	113,718,848	11,831.01	118,310,114	2.375	2024/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,000,000	11,259.55	112,595,518	11,676.26	116,762,687	2.250	2024/1/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,160.17	111,601,764	11,609.95	116,099,504	2.000	2024/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,224.79	112,247,942	11,414.39	114,143,964	2.000	2023/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	11,073.93	110,739,313	11,371.88	113,718,847	1.750	2023/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	11,058.57	110,585,733	11,337.87	113,378,754	1.750	2023/1/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	700,000	14,769.42	103,385,949	16,196.96	113,378,753	3.625	2043/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	10,951.86	109,518,691	11,330.22	113,302,233	1.625	2023/5/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,000,000	11,135.09	111,350,944	11,326.82	113,268,223	2.500	2022/1/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	10,951.01	109,510,188	11,325.97	113,259,722	1.625	2023/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	11,016.48	110,164,868	11,307.26	113,072,670	1.875	2022/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	10,979.07	109,790,765	11,284.31	112,843,106	1.750	2022/9/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	10,996.93	109,969,314	11,252.85	112,528,520	1.875	2022/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,006.28	110,062,841	11,200.13	112,001,375	2.000	2021/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,000,000	10,865.57	108,655,702	11,190.78	111,907,848	1.500	2022/8/15	0.46

## ロ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.28
合計	98.28

## 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 3月31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	10,891.50	1,285,197,276	11,522.37	1,359,640,397	1.750	2024/6/30	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	10,500,000	10,890.65	1,143,518,477	11,108.31	1,166,372,777	1.750	2021/7/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	12,451.24	672,366,976	15,277.43	824,981,562	3.000	2048/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,558.93	728,212,991	12,730.55	802,025,238	2.625	2029/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	11,060.69	718,945,438	11,651.61	757,354,772	2.125	2024/3/31	0.48

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	11,993.12	683,608,162	13,149.72	749,534,315	3.125	2028/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,138.92	701,751,997	11,816.55	744,443,112	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	11,753.64	646,450,200	12,874.24	708,083,689	2.875	2028/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,758.01	650,859,944	11,610.80	702,453,438	1.625	2026/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,234.14	640,346,370	11,839.51	674,852,282	2.500	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	11,187.38	626,493,499	11,831.01	662,536,637	2.375	2024/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,200,000	11,335.73	589,458,105	12,529.90	651,555,009	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,450,000	10,623.98	579,007,160	11,830.16	644,743,779	1.625	2029/8/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	12,986.11	649,305,938	12,857.96	642,898,058	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	4,000,000	13,069.80	522,792,112	15,710.63	628,425,231	3.375	2044/5/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	21,532.03	624,428,897	21,546.97	624,862,266	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,000,000	11,440.75	572,037,688	12,195.76	609,788,094	2.750	2025/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	11,617.60	557,644,920	12,691.44	609,189,531	2.750	2028/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	11,109.16	577,676,442	11,676.26	607,165,973	2.250	2024/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,327.67	577,711,303	11,889.67	606,373,552	2.750	2024/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	11,293.66	553,389,500	12,279.08	601,675,157	2.375	2027/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	11,002.71	550,135,650	11,919.43	595,971,788	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	4,000,000	12,075.87	483,035,156	14,686.94	587,477,944	2.875	2045/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	4,800,000	11,394.50	546,936,048	12,220.41	586,580,098	2.625	2025/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000	13,553.58	487,929,103	16,258.18	585,294,542	3.625	2044/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	11,186.53	559,326,687	11,678.81	583,940,969	2.500	2023/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3,800,000	12,469.53	473,842,419	15,322.92	582,271,108	3.000	2049/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,000,000	10,742.60	537,130,465	11,642.25	582,112,968	1.625	2026/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	4,900,000	11,081.10	542,974,128	11,819.95	579,177,955	2.125	2025/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3,800,000	12,559.66	477,267,163	15,152.87	575,809,327	3.125	2044/8/15	0.36

□ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.88
合計	97.88

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 3月31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	851,900	7,616.65	6,488,624,135	6,501.00	5,538,201,900	3.58
日本	株式	ソニー	電気機器	483,000	6,910.82	3,337,926,060	6,421.00	3,101,343,000	2.01
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,000,700	2,759.77	2,761,701,839	2,575.50	2,577,302,850	1.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	69,200	37,389.92	2,587,382,464	34,830.00	2,410,236,000	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	594,500	4,194.04	2,493,356,780	3,788.00	2,251,966,000	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	635,500	4,382.59	2,785,135,945	3,308.00	2,102,234,000	1.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,148,700	567.18	2,920,239,666	403.00	2,074,926,100	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	46,800	42,552.05	1,991,435,940	41,610.00	1,947,348,000	1.26
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	552,900	3,002.23	1,659,932,967	3,377.00	1,867,143,300	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	558,400	3,130.49	1,748,065,616	3,190.00	1,781,296,000	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	218,400	6,917.79	1,510,845,336	7,434.00	1,623,585,600	1.05
日本	株式	花王	化学	182,900	8,620.47	1,576,683,963	8,830.00	1,615,007,000	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	522,500	3,893.95	2,034,588,875	2,796.00	1,460,910,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	600,500	3,039.99	1,825,513,995	2,430.00	1,459,215,000	0.94
日本	株式	HOYA	精密機器	152,700	9,921.26	1,514,976,402	9,200.00	1,404,840,000	0.91
日本	株式	信越化学工業	化学	128,300	11,724.26	1,504,222,558	10,730.00	1,376,659,000	0.89
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	521,000	3,900.29	2,032,051,090	2,623.00	1,366,583,000	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	268,900	5,896.04	1,585,445,156	4,950.00	1,331,055,000	0.86
日本	株式	ダイキン工業	機械	97,200	15,495.93	1,506,204,396	13,170.00	1,280,124,000	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,221,300	165.27	1,689,274,251	123.60	1,263,352,680	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	224,200	6,400.97	1,435,097,474	5,472.00	1,226,822,400	0.79
日本	株式	三菱商事	卸売業	527,200	2,858.43	1,506,964,296	2,291.50	1,208,078,800	0.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	524,900	2,408.42	1,264,179,658	2,242.50	1,177,088,250	0.76
日本	株式	日立製作所	電気機器	366,900	4,196.59	1,539,728,871	3,143.00	1,153,166,700	0.75
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	661,400	1,867.22	1,234,979,308	1,671.00	1,105,199,400	0.71
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	63,500	21,737.51	1,380,331,885	17,320.00	1,099,820,000	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	134,400	9,902.19	1,330,854,336	8,176.00	1,098,854,400	0.71
日本	株式	S M C	機械	23,900	49,085.02	1,173,131,978	45,750.00	1,093,425,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	77,600	14,988.93	1,163,140,968	13,820.00	1,072,432,000	0.69
日本	株式	ファナック	電気機器	72,600	20,666.30	1,500,373,380	14,655.00	1,063,953,000	0.69

## ロ 種類別・業種別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
----	-------	----	-------------

株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.20
		建設業	2.63
		食料品	4.11
		繊維製品	0.52
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.37
		医薬品	6.39
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.57
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.54
		機械	4.78
		電気機器	13.83
		輸送用機器	7.12
		精密機器	2.50
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.74
		陸運業	4.39
		海運業	0.13
		空運業	0.40
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.42
		卸売業	4.84
		小売業	4.69
		銀行業	5.03
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.15
その他金融業	1.10		
不動産業	2.10		
サービス業	4.78		
新株予約権証券			
合計		97.49	

## 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 3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----------	----	-----	----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	376,974	16,465.82	6,207,189,624	17,437.83	6,573,608,866	3.53
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	231,115	28,954.23	6,691,758,476	27,730.97	6,409,043,663	3.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,928	196,446.96	4,307,689,145	213,736.67	4,686,817,886	2.52
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	125,374	21,591.33	2,706,991,592	18,060.33	2,264,296,879	1.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,069	140,490.98	2,257,549,680	124,808.42	2,005,546,511	1.08
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	136,781	14,871.81	2,034,181,292	14,475.47	1,979,970,397	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,597	140,350.54	2,189,047,452	124,752.91	1,945,771,251	1.04
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	155,165	11,672.88	1,811,223,592	11,298.35	1,753,109,719	0.94
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	163,341	13,959.79	2,280,207,565	10,175.60	1,662,093,496	0.89
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	129,916	13,137.57	1,706,781,746	12,515.44	1,625,957,202	0.87
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	89,307	19,847.71	1,772,539,685	18,018.98	1,609,221,324	0.86
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	226,977	6,256.19	1,420,012,183	6,038.97	1,370,708,814	0.74
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	68,576	23,607.41	1,618,902,401	19,935.47	1,367,095,435	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,435	30,114.49	1,488,709,974	27,346.80	1,351,889,177	0.73
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	215,877	6,477.02	1,398,241,192	5,960.61	1,286,760,569	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	46,654	31,364.66	1,463,287,094	27,561.19	1,285,840,108	0.69
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,601	34,702.04	1,270,129,443	34,959.24	1,279,543,436	0.69
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	381,287	4,001.41	1,525,686,497	3,289.93	1,254,407,883	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	56,903	23,708.65	1,349,093,586	21,341.56	1,214,398,959	0.65
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,912	9,353.00	1,243,127,243	8,374.46	1,113,067,357	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	446,319	3,509.97	1,566,567,376	2,398.61	1,070,546,645	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	212,668	5,720.12	1,216,488,398	4,897.35	1,041,509,630	0.56
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	289,194	4,116.03	1,190,334,049	3,555.47	1,028,222,355	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	94,149	16,004.71	1,506,827,880	10,861.23	1,022,574,320	0.55
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	72,888	14,621.79	1,065,753,631	13,655.98	995,357,683	0.53

スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	112,292	10,225.41	1,148,231,891	8,807.73	989,038,515	0.53
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	221,711	4,855.44	1,076,505,698	4,388.02	972,873,544	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	74,367	12,882.00	957,996,231	12,536.12	932,274,209	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	22,915	34,566.10	792,082,234	40,371.57	925,114,682	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	237,304	4,722.39	1,120,643,714	3,862.37	916,557,440	0.49

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.41
		素材	3.89
		資本財	6.10
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	0.91
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	1.44
		メディア・娯楽	6.12
		小売	5.20
		食品・生活必需品小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	4.97
		家庭用品・パーソナル用品	2.30
		ヘルスケア機器・サービス	5.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.27
		銀行	6.01
		各種金融	4.19
		保険	3.35
		不動産	0.76
		ソフトウェア・サービス	11.01
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.96		
電気通信サービス	2.36		
公益事業	3.88		
半導体・半導体製造装置	3.59		
投資証券			2.47
合計			97.82



## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR	小売	13,616	21,820.54	297,108,536	20,815.91	283,429,486	4.32
ケイマン 諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・ 娯楽	45,000	4,731.27	212,907,292	5,287.46	237,935,880	3.63
香港	投資信託受 益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		338,000	600.76	203,058,607	572.23	193,415,768	2.95
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半 導体製造装 置	193,000	1,098.06	211,925,856	960.32	185,342,725	2.83
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	37,472	4,525.17	169,567,382	4,268.22	159,938,740	2.44
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		45,184	4,495.19	203,110,965	2,942.76	132,965,812	2.03
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		41,650	3,178.63	132,390,258	2,522.67	105,069,597	1.60
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	756,000	87.70	66,307,411	87.60	66,232,858	1.01
南アフリ カ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	3,498	12,906.23	45,146,011	15,178.72	53,095,177	0.81
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	44,000	1,245.26	54,791,483	1,058.61	46,579,104	0.71
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		25,362	1,899.24	48,168,538	1,626.35	41,247,628	0.63
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	48,500	833.01	40,401,264	784.83	38,064,546	0.58
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	513,000	78.23	40,135,009	73.28	37,597,154	0.57
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	22,471	2,246.82	50,488,351	1,504.45	33,806,653	0.52
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半 導体製造装 置	4,308	7,296.71	31,434,267	7,466.03	32,163,700	0.49
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	12,937	3,353.04	43,378,342	2,275.77	29,441,701	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD	銀行	628,000	44.11	27,705,377	40.71	25,569,648	0.39
ケイマン 諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	5,781	3,600.38	20,813,839	4,395.64	25,411,216	0.39
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェ ア・サービ ス	26,905	1,025.95	27,603,251	914.98	24,617,591	0.38
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	97,800	315.96	30,901,087	251.30	24,577,140	0.37
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI UAE ETF		22,888	1,474.13	33,739,961	1,034.97	23,688,469	0.36
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	6,448	3,683.86	23,753,536	3,608.14	23,265,287	0.35
ケイマン 諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	2,151	12,908.81	27,766,863	10,768.72	23,163,535	0.35
ブラジル	株式	VALE SA	素材	25,000	1,037.48	25,937,079	873.82	21,845,710	0.33
ブラジル	株式	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	銀行	38,000	722.81	27,466,796	504.38	19,166,486	0.29

ケイマン諸島	株式	NETEASE.COM INC -ADR	メディア・娯楽	557	34,361.75	19,139,496	33,401.01	18,604,366	0.28
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	7,057	3,002.96	21,191,918	2,596.61	18,324,277	0.28
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	電気通信サービス	266,500	68.75	18,322,724	65.07	17,342,967	0.26
インド	株式	ICICI BANK LIMITED	銀行	37,805	749.03	28,317,123	457.56	17,298,207	0.26
ケイマン諸島	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	消費者サービス	3,019	4,905.54	14,809,852	5,659.15	17,085,004	0.26

## ロ 種類別・業種別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.23
		素材	3.02
		資本財	1.52
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	0.87
		自動車・自動車部品	1.04
		耐久消費財・アパレル	0.70
		消費者サービス	0.91
		メディア・娯楽	5.29
		小売	6.57
		食品・生活必需品小売り	0.90
		食品・飲料・タバコ	1.78
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	0.54
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.30
		銀行	7.55
		各種金融	1.08
		保険	2.06
		不動産	1.46
		ソフトウェア・サービス	1.06
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.86		
電気通信サービス	2.33		
公益事業	1.33		
半導体・半導体製造装置	4.05		
投資信託受益証券			5.98
投資証券			1.76
合計			61.13

リート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	555	872,586.48	484,285,500	724,000	401,820,000	8.25
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	573	792,983.31	454,379,441	633,000	362,709,000	7.44
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	1,848	192,326.5	355,419,388	136,600	252,436,800	5.18
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	861	313,580.64	269,992,933	271,200	233,503,200	4.79
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	817	296,106.66	241,919,146	263,700	215,442,900	4.42
日本	投資証券	G L P 投資法人	1,425	150,095.18	213,885,634	121,600	173,280,000	3.56
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	543	338,544.54	183,829,688	313,500	170,230,500	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,141	228,934.44	261,214,199	142,000	162,022,000	3.33
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,285	184,341.4	236,878,705	107,500	138,137,500	2.83
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	1,083	228,232.62	247,175,928	122,200	132,342,600	2.72
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	377	485,640.23	183,086,369	325,000	122,525,000	2.51
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	1,672	92,480.58	154,627,534	69,200	115,702,400	2.37
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	190	716,142.21	136,067,020	584,000	110,960,000	2.28
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	738	183,150.29	135,164,921	146,200	107,895,600	2.21
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	177	880,803.16	155,902,160	569,000	100,713,000	2.07
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	287	558,301.82	160,232,624	349,000	100,163,000	2.06
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	658	184,638.51	121,492,141	143,500	94,423,000	1.94
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	375	288,736.67	108,276,254	239,900	89,962,500	1.85
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	132	886,076.68	116,962,123	596,000	78,672,000	1.61
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	531	178,521.18	94,794,747	145,800	77,419,800	1.59
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	249	352,406.58	87,749,239	307,500	76,567,500	1.57
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	163	513,336.77	83,673,895	456,000	74,328,000	1.53
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	530	193,994.33	102,816,997	124,200	65,826,000	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	616	143,291.57	88,267,611	103,500	63,756,000	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	374	207,290.68	77,526,718	168,300	62,944,200	1.29
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	203	435,937.62	88,495,338	304,500	61,813,500	1.27
日本	投資証券	プレミアム投資法人	517	161,639.62	83,567,685	119,100	61,574,700	1.26
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	487	203,272.31	98,993,616	125,200	60,972,400	1.25
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	2,509	48,939.44	122,789,065	24,230	60,793,070	1.25
日本	投資証券	日本リート投資法人	186	509,826.55	94,827,740	319,000	59,334,000	1.22

## ロ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	96.89
合計	96.89

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	36,407	10,258.92	373,496,825	9,019.83	328,384,965	6.19
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4,152	69,665.28	289,250,256	70,181.20	291,392,351	5.49
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,092	14,667.93	192,032,581	15,215.52	199,201,618	3.76
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	7,232	24,646.73	178,245,152	21,943.39	158,694,617	2.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	17,526	9,130.03	160,012,906	6,810.58	119,362,250	2.25
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,764	24,572.72	166,209,917	16,553.04	111,964,783	2.11
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	20,380	9,104.67	185,553,181	5,134.59	104,643,136	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	105,300	1,047.76	110,329,198	905.58	95,357,574	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,003	18,146.31	108,932,324	15,742.25	94,500,784	1.78
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	16,074	8,746.89	140,597,564	5,782.13	92,942,085	1.75
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,642	15,321.08	224,331,362	6,123.86	89,665,618	1.69
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,280	34,607.59	113,512,922	24,542.25	80,498,591	1.52
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	7,314	15,225.25	111,357,507	10,116.83	73,994,544	1.40
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	18,801	4,011.37	75,417,904	3,596.83	67,624,029	1.28
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,169	11,841.79	73,052,017	10,529.30	64,955,267	1.22
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,335	4,037.59	98,254,826	2,650.01	64,488,006	1.22
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,424	15,879.38	86,129,786	11,658.95	63,238,188	1.19
オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	79,095	1,062.06	84,004,134	788.45	62,362,745	1.18
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,449	18,565.79	82,599,235	13,312.08	59,225,469	1.12
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	25,551	3,400.93	86,897,354	2,306.10	58,923,358	1.11
アメリカ	投資証券	UDR INC	14,232	5,498.09	78,248,840	4,105.06	58,423,322	1.10
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	56,237	1,179.12	66,310,730	999.63	56,216,380	1.06
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	17,895	6,861.73	122,790,685	3,133.21	56,068,895	1.06
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,777	8,323.31	73,053,766	6,159.77	54,064,372	1.02
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	8,165	9,606.42	78,436,453	6,454.70	52,702,685	0.99
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,093	2,605.39	65,377,056	1,914.31	48,036,024	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,983	1,788.07	62,552,294	1,242.83	43,478,223	0.82
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,641	12,975.80	60,220,692	9,069.89	42,093,370	0.79
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	14,979	3,514.58	52,644,929	2,704.42	40,509,590	0.76
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	21,940	2,992.82	65,662,580	1,745.63	38,299,192	0.72

## ロ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.01
合計	97.01

## 投資不動産物件

## 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。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 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。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 3月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	108,950,000.00	11,739,124,168	11,850,491,500	48.27
	カナダドル	売建	5,730,000.00	462,216,807	438,746,100	1.78
	メキシコペソ	売建	38,030,000.00	206,843,268	173,036,500	0.70
	ユーロ	売建	75,680,000.00	9,040,826,791	9,045,273,600	36.84
	英ポンド	売建	11,120,000.00	1,538,446,209	1,481,962,400	6.03
	スウェーデンクローナ	売建	6,060,000.00	68,184,696	65,448,000	0.26

ノルウェークローネ	売建	5,030,000.00	57,800,635	51,557,500	0.21
デンマーククロネ	売建	7,500,000.00	119,906,250	120,000,000	0.48
ポーランドズロチ	売建	5,170,000.00	142,252,394	135,971,000	0.55
オーストラリアドル	売建	6,460,000.00	454,731,984	426,747,600	1.73
シンガポールドル	売建	2,700,000.00	209,442,780	206,118,000	0.83
南アフリカランド	売建	19,150,000.00	131,273,671	115,474,500	0.47

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年 3月31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	213	日本円	2,928,264,300	2,988,390,000	1.93

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 3月31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 2006	買建	201	米ドル	24,418,078	2,657,419,428	26,242,560	2,855,977,804	1.53
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 2006	買建	197	ユーロ	5,137,474	614,185,017	5,346,580	639,183,639	0.34
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 2006	買建	37	オーストラリアドル	4,526,616.5	299,164,084	4,801,675	317,342,700	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 2006	買建	27	英ポンド	1,451,829	193,557,841	1,499,715	199,942,003	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 3月31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	5,960,000.00	641,474,800	648,567,200	0.34
	カナダドル	買建	400,000.00	30,620,000	30,636,000	0.01

ユーロ	買建	850,000.00	101,507,000	101,609,000	0.05
英ポンド	買建	800,000.00	106,864,800	106,648,000	0.05
スイスフラン	買建	300,000.00	33,858,000	33,960,000	0.01
スウェーデンクローナ	買建	800,000.00	8,648,000	8,640,000	0.00
ノルウェークローネ	買建	170,000.00	1,728,900	1,742,500	0.00
デンマーククローネ	買建	420,000.00	6,724,200	6,720,000	0.00
オーストラリアドル	買建	400,000.00	26,646,800	26,432,000	0.01
ニュージーランドドル	買建	50,000.00	3,239,000	3,237,500	0.00
香港ドル	買建	850,000.00	11,798,000	11,925,500	0.00
シンガポールドル	買建	100,000.00	7,531,000	7,636,000	0.00
イスラエルシュケル	買建	60,000.00	1,808,400	1,827,000	0.00
米ドル	売建	1,500,000.00	163,158,000	163,230,000	0.08
カナダドル	売建	100,000.00	7,656,020	7,659,000	0.00
ユーロ	売建	100,000.00	11,956,700	11,954,000	0.00
スウェーデンクローナ	売建	400,000.00	4,311,600	4,320,000	0.00
ニュージーランドドル	売建	20,000.00	1,302,620	1,295,000	0.00
香港ドル	売建	200,000.00	2,786,600	2,806,000	0.00
シンガポールドル	売建	35,000.00	2,655,485	2,672,600	0.00
イスラエルシュケル	売建	20,000.00	605,408	609,000	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 3月31日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 2006	買建	560	米ドル	24,827,425	2,701,968,663	23,391,200	2,545,664,296	38.83

(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 3月31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	20,375,428.89	2,117,950,460	2,208,541,393	33.68
	米ドル	売建	5,438,000.11	584,000,000	589,316,070	8.98
	メキシコペソ	売建	20,760.40	94,459	94,666	0.00
	香港ドル	売建	97,750.00	1,357,747	1,371,432	0.02
	南アフリカランド	売建	4,375.80	26,254	26,429	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。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 3月31日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数 先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	60	日本円	108,768,700	95,160,000	1.95

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 3月31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	147,586.28	16,000,000	16,059,327	0.30
	ユーロ	買建	8,373.81	1,000,000	1,001,005	0.01
	英ポンド	買建	7,480.55	1,000,000	997,232	0.01
	オーストラリアドル	買建	15,130.88	1,000,000	999,848	0.01
	香港ドル	買建	72,046.11	1,000,000	1,010,806	0.01
	シンガポールドル	買建	13,180.44	1,000,000	1,006,458	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 参考情報



基準日:2020年3月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

### ■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.77
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	外国株式インデックス・マザーファンド	20.45
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	18.88
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	15.66
日本	親投資信託受益証券	国内債券/パッシブ・マザーファンド	14.29
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.83
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)	9.69
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券/パッシブ・マザーファンド	4.72
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	4.69

※比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が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	77.34
特殊債券	日本	10.45
地方債証券	日本	6.80
社債券	日本	4.69
	オーストラリア	0.16
	フランス	0.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.40
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	1.67
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.22
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	1.06
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	1.03
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	1.00
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.89
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1.900	2023/09/20	0.88
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1.900	2023/12/20	0.88
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	0.900	2022/03/20	0.87
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	0.100	2029/03/20	0.84

## ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・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	49.60
	フランス	9.39
	イタリア	8.53
	イギリス	6.16
	ドイツ	5.82
	スペイン	5.20
	ベルギー	2.17
	その他	11.42
	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 2.125	2.125	2024/02/29	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2022/08/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	8.000	2021/11/15	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/09/30	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2026/08/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2022/10/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2026/01/31	0.60
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	0.500	2029/05/25	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2044/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2024/11/30	0.54

## ■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	49.37
	フランス	9.28
	イタリア	8.44
	イギリス	6.14
	ドイツ	5.51
	スペイン	5.22
	ベルギー	2.31
	その他	11.60
	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	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2021/07/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3.125	2028/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.42

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.51
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.93%

## 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	3.58
日本	株式	ソニー	電気機器	2.01
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.67
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.36
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	1.26
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.15

## ■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	64.89
	イギリス	4.98
	スイス	3.93
	フランス	3.44
	カナダ	3.27
	ドイツ	2.78
	その他	12.06
	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)		2.17
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.14%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.53
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	3.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.52
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.08
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	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.04
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.94
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.89
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品/パーソナル用品	0.87

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	13.38
	台湾	7.46
	韓国	7.22
	中国	5.55
	インド	4.69
	その他	15.09
	投資信託受益証券	アメリカ・その他
投資証券	アメリカ・その他	1.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		38.88
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 38.83%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	4.32
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	3.63
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	2.95
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	2.83
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.44
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.03
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	1.60
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1.01
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	0.81
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	0.71

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■Jリート・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(%)
投資証券	日本	96.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.11
合計(純資産総額)		100.00

※リート指数先物取引の買建て 1.95%

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	8.25
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	7.44
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.18
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.79
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.42
日本	投資証券	GLP投資法人	3.56
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.33
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.83
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2.72

## ■外国リート・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(%)
投資証券	アメリカ	74.19
	イギリス	4.89
	オーストラリア	4.88
	シンガポール	3.95
	フランス	2.40
	香港	2.04
	カナダ	1.75
	その他	2.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.99
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(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.19
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.49
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.76
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.99
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.25
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.11
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	1.97
香港	投資証券	LINK REIT	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1.78
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	1.75

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年10月3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3月31日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマーク(合成指数)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取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

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

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

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

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

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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、「DC世界分散」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

2017年10月3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9月11日から翌年9月10日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (ロ) 償還金

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

## 八 信託約款の変更等

- (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け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、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、)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てします。)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。

#### 八 一部解約実行請求権

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

#### 二 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使用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2期(平成30年9月11日から令和1年9月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月10日現在)	第2期 (令和 1年 9月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,600,545	3,622,120
親投資信託受益証券	113,908,771	292,899,986
流動資産合計	115,509,316	296,522,106
資産合計	115,509,316	296,522,106
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	359,086	654,548
未払受託者報酬	8,027	26,309
未払委託者報酬	76,200	249,938
未払利息	4	7
その他未払費用	2,396	7,960
流動負債合計	445,713	938,762
負債合計	445,713	938,762
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	114,481,559	283,071,447
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	582,044	12,511,897
元本等合計	115,063,603	295,583,344
純資産合計	115,063,603	295,583,344
負債純資産合計	115,509,316	296,522,106

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成29年10月 3日 至 平成30年 9月10日	自	平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		84,771		10,288,215
営業収益合計		84,771		10,288,215
営業費用				
支払利息		377		1,079
受託者報酬		11,204		42,190
委託者報酬		106,379		400,746
その他費用		3,458		13,443
営業費用合計		121,418		457,458
営業利益又は営業損失（ ）		36,647		9,830,757
経常利益又は経常損失（ ）		36,647		9,830,757
当期純利益又は当期純損失（ ）		36,647		9,830,757
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（ ）		59,942		499,085
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		582,044
剰余金増加額又は欠損金減少額		860,159		2,787,388
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		860,159		2,787,388
剰余金減少額又は欠損金増加額		181,526		189,207
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		181,526		189,207
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（ ）		582,044		12,511,897

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第2期
	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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	第2期
	( 平成30年 9月10日現在 )	( 令和 1年 9月10日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	114,481,559口	283,071,447口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0051円 (10,000口当たりの純資産額 10,051円)	1口当たり純資産額 1.0442円 (10,000口当たりの純資産額 10,442円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	自 平成29年10月 3日 至 平成30年 9月10日	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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（1,140,443円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（176,188円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は1,316,631円（1万口当たり115.00円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,428,726円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,858,097円）、収益調整金（3,261,815円）、および分配準備積立金（963,259円）より、分配対象収益は12,511,897円（1万口当たり441.98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2期 自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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、親投資信託受益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。 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	第2期 自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (令和 1年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第1期(自平成29年10月3日至平成30年9月10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	35,804円
合計	35,804円

第2期(自平成30年9月11日至令和1年9月10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	10,052,712円
合計	10,052,712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2期 自平成30年9月11日 至令和1年9月10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	第2期
	(平成30年9月10日現在)	(令和1年9月10日現在)
期首元本額	100,000円	114,481,559円
期中追加設定元本額	133,968,987円	198,345,231円
期中一部解約元本額	19,587,428円	29,755,343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）	11,942,118	29,394,329	
	外国株式インデックス・マザーファンド	16,546,398	59,611,708	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	9,490,431	14,091,391	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	32,391,000	58,255,213	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	33,042,147	43,192,694	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	5,609,434	14,375,296	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	19,863,845	44,085,817	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	23,577,205	29,893,538	
合計		152,462,578	292,899,986	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	945,771,951	742,374,174
国債証券	145,078,227,780	110,221,460,350
地方債証券	18,233,929,177	10,749,458,710
特殊債券	24,964,191,030	17,482,863,747
社債券	7,690,401,000	7,088,825,000
未収入金	356,446,500	-
未収利息	671,606,687	504,204,067
前払費用	13,335,237	5,064,361

	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
流動資産合計	197,953,909,362	146,794,250,409
資産合計	197,953,909,362	146,794,250,409
負債の部		
流動負債		
未払金	224,719,000	-
未払解約金	433,357,578	360,477,000
未払利息	2,565	1,539
その他未払費用	55,095	82,466
流動負債合計	658,134,238	360,561,005
負債合計	658,134,238	360,561,005
純資産の部		
元本等		
元本	157,109,944,339	112,020,381,328
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	40,185,830,785	34,413,308,076
元本等合計	197,295,775,124	146,433,689,404
純資産合計	197,295,775,124	146,433,689,404
負債純資産合計	197,953,909,362	146,794,250,409

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月11日 至令和 1年 9月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	157,109,944,339口	112,020,381,328口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2558円 12,558円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.3072円 13,072円)

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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	(令和 1年 9月10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 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

(平成30年 9月10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	177,346,901,879円
同期中における追加設定元本額	18,158,012,952円
同期中における一部解約元本額	38,394,970,492円

平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,137,737,122円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,343,912,915円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,630,007,483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)	448,046,499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)	53,710,355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)	159,191,966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)	268,285,824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)	223,652,169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)	86,584,420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)	186,482,940円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	72,742,915円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,721,406,072円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	436,580,789円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	403,282,500円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,473,869円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,753,414円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,600,333円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,107,366円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,359,434円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,669,123円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	13,834,280円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,835,498,623円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	20,739,465,552円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	8,008,806,199円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	19,610,733,849円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	362,538,660円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	629,074,675円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	2,980,578円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	301,786,908円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,214,392円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	2,136,089,504円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,354,397,695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>	3,079,694,171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>	11,921,755,417円
S M A M・バランスV A 株 4 0 T<適格機関投資家限定>	6,227,707円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	5,718,286,953円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	17,363,930,583円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	570,748,561円
S M A M・バランスファンドV A 2 0<適格機関投資家専用>	931,748,454円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	16,368,407,920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>	981,786,019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>	201,444,041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>	46,907,369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>	2,208,386,812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>	2,717,946,156円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T<適格機関投資家専用>	2,579,273,913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>	1,083,041,690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 >	251,752,028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 >	23,275,498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 >	380,231,209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 >	6,877,003,656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 >	311,416,414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 >	159,186,353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 >	1,512,520,541円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	724,788,784円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	1,778,755,223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 >	420,444円
合計	157,109,944,339円

## (令和1年9月10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	157,109,944,339円
同期中における追加設定元本額	19,557,082,854円
同期中における一部解約元本額	64,646,645,865円
令和1年9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,649,473,249円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,877,944,639円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,667,101,957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)	780,433,028円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	48,591,736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)	171,675,395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)	321,004,856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)	306,156,890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)	114,965,076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)	218,997,356円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	93,099,364円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,765,199,173円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,126,946,850円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	490,788,817円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,336,368円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	660,773,383円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	223,815,398円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	274,188,567円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	54,395,665円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,513,818円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,042,147円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	416,763円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	262,454円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	111,938円

S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,793,124,662円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	17,075,396,229円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	6,997,916,606円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	16,919,573,011円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	341,530,368円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	560,808,357円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	2,642,998円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	239,612,092円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	110,370,858円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,962,263,301円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,072,118,528円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,597,943,001円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	10,007,950,700円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	2,218,246円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,457,499,955円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	3,612,040,213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>	479,193,262円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,046,388,134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>	839,200,063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>	182,003,732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>	43,021,375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>	1,885,326,071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>	2,383,965,299円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用>	1,195,530,440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>	996,705,535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>	234,605,464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>	18,000,249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>	338,835,567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>	5,974,636,981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>	287,982,728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>	149,530,083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>	708,265,865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>	990,387,454円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	2,618,559,014円
合計	112,020,381,328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)	220,000,000	221,628,000	
	第129回利付国債(5年)	250,000,000	252,010,000	
	第130回利付国債(5年)	660,000,000	666,039,000	
	第131回利付国債(5年)	140,000,000	141,421,000	
	第132回利付国債(5年)	95,000,000	96,062,100	
	第133回利付国債(5年)	108,000,000	109,368,360	
	第134回利付国債(5年)	110,000,000	111,509,200	
	第135回利付国債(5年)	190,000,000	192,874,700	
	第136回利付国債(5年)	400,000,000	406,568,000	
	第137回利付国債(5年)	500,000,000	508,665,000	
	第138回利付国債(5年)	650,000,000	661,823,500	
	第140回利付国債(5年)	500,000,000	510,175,000	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	63,316,400	
	第2回利付国債(40年)	242,000,000	373,785,940	
	第3回利付国債(40年)	195,000,000	304,120,050	
	第4回利付国債(40年)	262,000,000	413,084,920	
	第5回利付国債(40年)	270,000,000	413,348,400	
	第6回利付国債(40年)	280,000,000	423,544,800	
	第7回利付国債(40年)	290,000,000	423,626,200	
	第8回利付国債(40年)	350,000,000	479,741,500	
	第9回利付国債(40年)	481,000,000	496,829,710	
	第10回利付国債(40年)	490,000,000	592,140,500	
	第11回利付国債(40年)	400,000,000	470,684,000	
	第12回利付国債(40年)	160,000,000	171,003,200	
	第313回利付国債(10年)	35,000,000	35,847,000	
	第317回利付国債(10年)	55,000,000	56,556,500	
	第318回利付国債(10年)	895,000,000	918,511,650	
	第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,011,291,400	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	988,454,400		
第321回利付国債(10年)	960,000,000	991,564,800		

第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,097,312,100	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	320,354,000	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	401,937,900	
第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,307,870,850	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	79,571,800	
第327回利付国債(10年)	275,000,000	285,095,250	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	134,257,500	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,116,802,800	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,343,673,100	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	824,434,520	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	849,197,400	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	329,042,700	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	52,107,000	
第336回利付国債(10年)	470,000,000	490,933,800	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	124,057,200	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	838,278,700	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	818,959,100	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	804,796,300	
第341回利付国債(10年)	1,057,000,000	1,100,358,140	
第342回利付国債(10年)	950,000,000	977,540,500	
第343回利付国債(10年)	910,000,000	937,427,400	
第344回利付国債(10年)	1,021,000,000	1,052,947,090	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	968,775,780	
第346回利付国債(10年)	840,000,000	868,182,000	
第347回利付国債(10年)	630,000,000	651,867,300	
第348回利付国債(10年)	705,000,000	729,985,200	
第349回利付国債(10年)	970,000,000	1,004,619,300	
第350回利付国債(10年)	990,000,000	1,025,065,800	
第351回利付国債(10年)	920,000,000	952,292,000	
第352回利付国債(10年)	920,000,000	951,924,000	
第353回利付国債(10年)	800,000,000	827,368,000	
第354回利付国債(10年)	495,000,000	511,646,850	
第355回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,094,969,400	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	650,051,100	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	403,923,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	370,190,800	

第7回利付国債(30年)	474,000,000	619,788,180	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	119,775,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	643,195,050	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	534,726,500	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	768,610,700	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	1,004,957,380	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	641,104,800	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	610,164,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	666,179,500	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	471,828,900	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	442,540,350	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	463,455,720	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	437,840,900	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	414,888,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	509,390,640	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	628,636,800	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	554,956,060	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	252,531,210	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	667,620,400	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	441,825,300	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	558,035,400	
第33回利付国債(30年)	518,000,000	713,317,080	
第34回利付国債(30年)	477,000,000	680,144,760	
第35回利付国債(30年)	345,000,000	479,543,100	
第36回利付国債(30年)	210,000,000	293,353,200	
第37回利付国債(30年)	450,000,000	621,805,500	
第38回利付国債(30年)	335,000,000	457,459,250	
第39回利付国債(30年)	270,000,000	375,869,700	
第40回利付国債(30年)	310,000,000	425,158,800	
第41回利付国債(30年)	325,000,000	438,870,250	
第42回利付国債(30年)	245,000,000	331,673,650	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	427,026,600	
第44回利付国債(30年)	370,000,000	502,863,300	
第45回利付国債(30年)	355,000,000	466,026,250	
第46回利付国債(30年)	375,000,000	492,772,500	
第47回利付国債(30年)	270,000,000	362,199,600	

第48回利付国債(30年)	385,000,000	498,051,400	
第49回利付国債(30年)	395,000,000	512,042,450	
第50回利付国債(30年)	385,000,000	440,401,500	
第51回利付国債(30年)	450,000,000	456,790,500	
第52回利付国債(30年)	433,000,000	461,569,340	
第53回利付国債(30年)	177,000,000	193,310,550	
第54回利付国債(30年)	125,000,000	143,070,000	
第55回利付国債(30年)	365,000,000	418,217,000	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	492,582,200	
第57回利付国債(30年)	475,000,000	543,989,000	
第58回利付国債(30年)	440,000,000	503,751,600	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	447,112,000	
第60回利付国債(30年)	420,000,000	492,542,400	
第61回利付国債(30年)	335,000,000	374,586,950	
第62回利付国債(30年)	145,000,000	154,117,600	
第63回利付国債(30年)	370,000,000	382,724,300	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	755,092,800	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,020,111,150	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	870,474,700	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,551,728,400	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,272,105,000	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,117,547,250	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,117,634,400	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,132,699,800	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	882,609,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	845,837,370	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	750,200,480	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	556,635,100	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	667,225,100	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	712,169,200	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	976,565,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	748,941,750	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	876,576,540	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,489,000	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	684,782,800	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	866,281,480	

第93回利付国債(20年)	632,000,000	744,698,240	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	368,546,750	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	816,834,350	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	834,108,660	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	251,919,000	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	438,236,850	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	566,638,870	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	474,836,700	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	453,904,900	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	461,897,100	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	469,162,200	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	410,291,600	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	478,813,700	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	527,464,560	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	450,101,850	
第116回利付国債(20年)	210,000,000	263,596,200	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	247,624,000	
第119回利付国債(20年)	315,000,000	383,093,550	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	238,846,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	313,950,900	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	402,586,800	
第123回利付国債(20年)	230,000,000	289,344,600	
第124回利付国債(20年)	260,000,000	324,103,000	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	261,170,000	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	225,104,400	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	179,636,150	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	267,178,350	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	233,840,600	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	166,623,750	
第131回利付国債(20年)	560,000,000	684,348,000	
第132回利付国債(20年)	680,000,000	833,652,800	
第133回利付国債(20年)	160,000,000	198,145,600	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	62,084,500	
第135回利付国債(20年)	145,000,000	178,205,000	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	145,957,200	
第137回利付国債(20年)	45,000,000	55,443,600	

	第138回利付国債(20年)	25,000,000	30,155,500	
	第139回利付国債(20年)	160,000,000	195,064,000	
	第140回利付国債(20年)	530,000,000	654,597,700	
	第141回利付国債(20年)	270,000,000	334,254,600	
	第142回利付国債(20年)	230,000,000	287,817,400	
	第143回利付国債(20年)	170,000,000	208,608,700	
	第144回利付国債(20年)	180,000,000	218,424,600	
	第145回利付国債(20年)	215,000,000	267,363,250	
	第146回利付国債(20年)	275,000,000	342,727,000	
	第147回利付国債(20年)	520,000,000	642,423,600	
	第148回利付国債(20年)	344,000,000	420,756,720	
	第149回利付国債(20年)	625,000,000	765,750,000	
	第150回利付国債(20年)	401,000,000	486,441,070	
	第151回利付国債(20年)	575,000,000	680,909,250	
	第152回利付国債(20年)	395,000,000	468,201,400	
	第153回利付国債(20年)	377,000,000	453,225,630	
	第154回利付国債(20年)	560,000,000	665,016,800	
	第155回利付国債(20年)	400,000,000	462,836,000	
	第156回利付国債(20年)	440,000,000	465,995,200	
	第157回利付国債(20年)	415,000,000	425,350,100	
	第158回利付国債(20年)	460,000,000	494,109,000	
	第159回利付国債(20年)	453,000,000	493,973,850	
	第160回利付国債(20年)	425,000,000	470,526,000	
	第161回利付国債(20年)	440,000,000	479,670,400	
	第162回利付国債(20年)	370,000,000	403,111,300	
	第163回利付国債(20年)	450,000,000	490,378,500	
	第164回利付国債(20年)	455,000,000	487,204,900	
	第165回利付国債(20年)	610,000,000	653,151,400	
	第166回利付国債(20年)	375,000,000	415,455,000	
	第167回利付国債(20年)	390,000,000	417,132,300	
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	199,386,000	
	第169回利付国債(20年)	750,000,000	772,342,500	
	国債証券合計	95,943,000,000	110,221,460,350	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,693,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,704,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,835,000	

第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	546,648,000	
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	673,170,000	
第684回東京都公募公債	100,000,000	100,965,000	
第685回東京都公募公債	100,000,000	100,864,000	
第688回東京都公募公債	193,500,000	195,318,900	
第689回東京都公募公債	200,000,000	202,166,000	
第705回東京都公募公債	100,000,000	102,592,000	
第710回東京都公募公債	100,000,000	102,162,000	
平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,480,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,615,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,761,000	
平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,093,000	
平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,694,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,998,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,963,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,267,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,482,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,972,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,310,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,877,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	111,744,600	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,980,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,102,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	332,781,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	137,735,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	225,800,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,301,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,894,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,872,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,933,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,279,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,470,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,949,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,323,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,786,000	

	第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,484,500	
	第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,185,000	
	第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,394,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	614,412,000	
	第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,731,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,252,000	
	第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,760,000	
	第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,820,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	216,696,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	111,501,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	141,457,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,853,000	
	平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,035,000	
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,313,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,000,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,531,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,261,000	
	第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,032,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,409,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	104,734,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,252,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	150,664,710	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,102,000	
地方債証券合計		10,000,500,000	10,749,458,710	
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	218,406,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,077,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,696,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,740,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,244,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,465,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,399,000	
	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	307,254,000	
	第7回道路債券	100,000,000	107,404,000	



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	103,018,000	
第9回道路債券	100,000,000	135,184,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	164,069,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	477,852,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,004,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,160,000	
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	141,421,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	51,000,000	51,038,250	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	362,178,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	159,855,420	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,476,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,157,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,780,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,097,000	
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	1,022,640,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,253,000	
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	307,974,000	
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	205,606,000	
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	307,902,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	120,957,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,508,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,346,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	129,639,840	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,315,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,414,000	

第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,982,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	301,000,000	304,241,770	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,134,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,725,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 (6年)	800,000,000	801,208,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,306,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	237,668,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,402,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,060,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,460,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,104,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,238,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,089,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,404,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,631,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,429,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,500,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,189,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,438,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	100,575,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	106,505,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	106,417,000	
第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,061,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,056,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,236,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,325,000	12,670,469	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,720,000	15,492,211	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,819,000	13,183,700	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,570,000	19,593,092	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,298,000	17,258,604	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,960,000	9,969,661	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,836,000	29,186,881	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,425,000	17,535,330	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,197,000	45,310,629	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,120,000	17,058,828	

第1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	17,382,000	18,576,143	
第1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,117,000	11,289,980	
第1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,619,000	14,918,835	
第1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	34,512,000	35,475,229	
第1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,229,000	22,786,571	
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,722,000	47,396,396	
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,124,000	73,601,169	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,887,000	26,937,439	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,036,000	29,243,759	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,576,000	14,021,971	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,776,000	32,369,489	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,157,000	31,650,798	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,193,000	15,802,087	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,800,000	62,246,554	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,971,000	16,710,776	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,005,000	34,342,645	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,964,000	34,141,707	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,367,000	14,954,753	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,695,000	16,589,144	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,446,000	31,089,086	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,911,000	44,853,152	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,556,000	37,086,190	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,944,000	69,608,927	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,090,000	34,298,433	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,009,000	14,724,999	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,744,000	75,477,481	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,487,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,748,000	15,491,151	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,898,000	99,055,279	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,204,000	47,151,080	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,777,000	49,922,753	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,524,000	96,594,539	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,444,000	150,650,589	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,577,000	48,368,135	

	第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,433,000	54,187,751	
	第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,712,000	111,443,934	
	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,956,000	97,300,482	
	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,832,000	55,096,379	
	第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,604,000	
	第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,381,000	78,960,089	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,614,000	93,656,992	
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,628,000	93,421,159	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,005,000	93,921,464	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,041,000	95,006,025	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,737,000	94,763,303	
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,578,000	95,990,440	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	243,076,000	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,503,000	99,044,889	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,244,000	29,452,278	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,686,000	32,267,556	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,272,000	16,137,311	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,653,000	15,370,997	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,542,000	33,306,774	
	い第810号農林債	300,000,000	300,234,000	
	第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,171,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	102,414,000	
	第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,062,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,224,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,628,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,828,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,533,000	
特殊債券合計		16,458,091,000	17,482,863,747	
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	201,228,000	
	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	200,552,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,800,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディング ス無担保社債	100,000,000	102,101,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	101,501,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,405,000	

第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	202,666,000	
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	101,230,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,645,000	
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,425,000	
第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,561,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,109,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,388,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,462,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,770,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,251,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,207,000	
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	118,807,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	304,197,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,142,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,429,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,515,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	116,816,000	
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	102,716,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,511,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	116,965,000	
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	99,926,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,365,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
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	100,134,000	
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	100,958,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,145,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,517,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,250,000	

第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,503,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,400,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,733,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	241,032,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,646,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,790,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,571,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,833,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,386,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,657,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,524,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,098,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,337,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,532,000	
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	103,448,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,922,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,244,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,734,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	209,222,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,709,000	
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	103,723,000	
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	101,519,000	
社債券合計	6,800,000,000	7,088,825,000	
合計		145,542,607,807	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	137,985,029	488,309,026
コール・ローン	615,732,823	384,984,892
国債証券	44,836,206,791	26,593,716,170
派生商品評価勘定	105,585,907	-
未収入金	583,497,358	440,682
未収利息	305,465,850	152,160,666
前払費用	11,527,274	14,339,472
流動資産合計	46,596,001,032	27,633,950,908
資産合計		
	46,596,001,032	27,633,950,908
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,131,639	445,236,880
未払金	607,944,468	348,574,752
未払解約金	120,568,000	142,910,000
未払利息	1,670	798
その他未払費用	8,257	21,261
流動負債合計	735,654,034	936,743,691
負債合計		
	735,654,034	936,743,691
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	33,423,877,582	17,979,833,935
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,436,469,416	8,717,373,282
元本等合計	45,860,346,998	26,697,207,217
純資産合計		
	45,860,346,998	26,697,207,217
負債純資産合計		
	46,596,001,032	27,633,950,908

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	33,423,877,582口	17,979,833,935口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3721円 (10,000口当たりの純資産額 13,721円)	1口当たり純資産額 1.4848円 (10,000口当たりの純資産額 14,848円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10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、国債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、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。



3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	613,446,116	-	609,333,871	4,112,245
	米ドル	275,622,645	-	274,117,372	1,505,273
	カナダドル	16,677,272	-	16,587,097	90,175
	ユーロ	253,414,542	-	251,294,171	2,120,371
	英ポンド	40,172,605	-	40,178,842	6,237
	ポーランドズロチ	9,221,453	-	9,123,475	97,978
	オーストラリアドル	18,337,599	-	18,032,914	304,685
	売建	45,321,242,474	-	45,218,675,961	102,566,513
	米ドル	20,331,843,896	-	20,320,874,809	10,969,087
	カナダドル	941,213,464	-	933,066,000	8,147,464
	メキシコペソ	379,137,000	-	376,860,000	2,277,000
	ユーロ	18,197,393,360	-	18,135,964,000	61,429,360
	英ポンド	3,022,661,420	-	3,023,845,669	1,184,249
	スウェーデンクローナ	173,490,460	-	175,318,000	1,827,540
	ノルウェークローネ	104,318,710	-	103,806,000	512,710
	デンマーククローネ	277,937,520	-	276,920,000	1,017,520
	ポーランドズロチ	283,573,251	-	281,865,000	1,708,251
	オーストラリアドル	962,158,843	-	952,562,483	9,596,360
	シンガポールドル	403,360,000	-	401,500,000	1,860,000
南アフリカランド	244,154,550	-	236,094,000	8,060,550	
合計		45,934,688,590	-	45,828,009,832	98,454,268

（令和 1年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	売建	26,511,447,120	-	26,956,684,000	445,236,880
	米ドル	12,681,946,224	-	12,843,758,000	161,811,776
	カナダドル	509,000,736	-	521,024,000	12,023,264
	メキシコペソ	198,844,500	-	207,100,000	8,255,500
	ユーロ	10,147,384,106	-	10,324,290,000	176,905,894
	英ポンド	1,649,090,950	-	1,696,256,000	47,165,050
	スウェーデンク ローナ	88,513,260	-	91,184,000	2,670,740
	ノルウェークロー ネ	60,357,440	-	62,504,000	2,146,560
	デンマーククロー ネ	140,785,200	-	143,190,000	2,404,800
	ポーランドズロチ	149,020,144	-	152,992,000	3,971,856
	オーストラリアド ル	520,178,800	-	537,499,000	17,320,200
	シンガポールドル	228,570,000	-	233,010,000	4,440,000
	南アフリカランド	137,755,760	-	143,877,000	6,121,240
	合計	26,511,447,120	-	26,956,684,000	445,236,880

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 9月11日

至 令和 1年 9月10日

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

## （その他の注記）

（平成30年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	43,166,382,056円
同期中における追加設定元本額	6,913,891,174円
同期中における一部解約元本額	16,656,395,648円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	9,701,552,054円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	5,048,039,641円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,234,886,641円
イオン・バランス戦略ファンド	573,796,891円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	67,301,340円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	23,979,793円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	48,068,152円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	14,197,014円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	6,718,967円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,144,006円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,323,704,828円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T ＜適格機関投資家限定＞	5,695,409円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	4,987,196,406円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド ＜適格機関投資家限定＞	3,620,361,540円
S M A M ・年金Wリスクリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	74,594,874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＞	636,786,192円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 ＜適格機関投資家限定＞	305,130,365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＞	747,723,469円
合計	33,423,877,582円

（令和 1年 9月10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	33,423,877,582円
同期中における追加設定元本額	8,321,263,196円
同期中における一部解約元本額	23,765,306,843円
令和 1年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	4,870,186,685円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,984,949,690円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	867,795,402円
イオン・バランス戦略ファンド	638,596,085円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	44,542,125円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	4,912,620円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	8,979,459円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	3,962,368円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,749,100円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,490,431円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,255,064,175円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,964,126円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	304,109,668円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,017,845,382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>	76,378,386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>	370,161,329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>	516,146,904円
合計	17,979,833,935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	1,400,000.00	1,387,968.75	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	693,492.19	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	990,546.88	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	990,625.00	
		US TREASURY N/B 1.125	400,000.00	396,156.25	
		US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	496,523.44	
		US TREASURY N/B 1.25	200,000.00	198,546.87	
		US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,493,789.07	
		US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	199,078.12	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	995,234.38	
		US TREASURY N/B 1.375	2,750,000.00	2,736,250.00	
		US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,094,414.06	
		US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	199,078.12	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	994,843.75	
		US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	599,156.25	
		US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	499,687.50	
		US TREASURY N/B 1.5	850,000.00	846,480.47	
		US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,198,406.25	
		US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,203,937.49	
		US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,003,984.38	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,004,609.38			

US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,205,718.75
US TREASURY N/B 1.625	1,400,000.00	1,405,796.88
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	803,375.00
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	699,835.94
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	200,953.12
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	603,375.00
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	301,640.62
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,006,796.88
US TREASURY N/B 1.75	1,100,000.00	1,109,195.31
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	603,937.50
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	705,140.62
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	503,750.00
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,008,046.88
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,008,359.38
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,010,234.38
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	305,367.18
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,020,468.75
US TREASURY N/B 2	400,000.00	401,156.25
US TREASURY N/B 2	800,000.00	804,500.00
US TREASURY N/B 2	800,000.00	805,875.00
US TREASURY N/B 2	250,000.00	252,109.37
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,008,750.00
US TREASURY N/B 2	600,000.00	606,468.75
US TREASURY N/B 2	700,000.00	709,406.25
US TREASURY N/B 2	800,000.00	811,687.50
US TREASURY N/B 2	1,400,000.00	1,422,640.63
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,022,265.63
US TREASURY N/B 2	500,000.00	511,523.44
US TREASURY N/B 2	600,000.00	613,781.25
US TREASURY N/B 2	200,000.00	205,953.12
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	502,656.25
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	806,625.00
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,009,609.38
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	404,218.75
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,049,218.74
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,019,531.25
US TREASURY N/B 2.125	4,600,000.00	4,722,546.89
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	517,929.69
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,821,218.76
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	605,015.62
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	504,531.25
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,031,015.63

US TREASURY N/B 2.25	3,550,000.00	3,662,046.87
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	829,312.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	933,257.81
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	518,867.19
US TREASURY N/B 2.25	950,000.00	989,113.28
US TREASURY N/B 2.25	650,000.00	681,027.34
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	944,367.19
US TREASURY N/B 2.25	1,100,000.00	1,155,257.81
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	826,000.00
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	310,078.12
US TREASURY N/B 2.375	900,000.00	907,207.02
US TREASURY N/B 2.375	100,000.00	100,992.18
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	505,312.50
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	408,218.75
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,041,093.75
US TREASURY N/B 2.375	900,000.00	952,171.87
US TREASURY N/B 2.375	1,300,000.00	1,386,125.00
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	311,320.31
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,044,843.75
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,050,312.50
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	952,312.50
US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	542,187.50
US TREASURY N/B 2.5	600,000.00	650,578.12
US TREASURY N/B 2.625	700,000.00	711,757.81
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	409,468.75
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	529,218.75
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	425,656.25
US TREASURY N/B 2.625	1,100,000.00	1,195,562.50
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	941,765.62
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	630,093.75
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	532,070.31
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	960,468.75
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	748,015.62
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	545,234.37
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	452,187.50
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	683,578.12
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	683,953.12
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	719,195.31
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	949,921.87
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	857,937.50
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	644,062.50
US TREASURY N/B 2.875	1,750,000.00	1,929,101.55
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,104,375.00

US TREASURY N/B 2.875	400,000.00	462,031.25	
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,624,875.00	
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,047,726.56	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	433,531.25	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	470,750.00	
US TREASURY N/B 3	900,000.00	1,064,742.19	
US TREASURY N/B 3	200,000.00	237,093.75	
US TREASURY N/B 3	900,000.00	1,068,609.37	
US TREASURY N/B 3	250,000.00	298,242.18	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	954,125.00	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	955,687.50	
US TREASURY N/B 3	100,000.00	119,656.25	
US TREASURY N/B 3	850,000.00	1,019,070.31	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	819,625.00	
US TREASURY N/B 3.125	550,000.00	620,167.96	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	359,906.25	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	360,164.06	
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	480,468.75	
US TREASURY N/B 3.125	500,000.00	603,476.56	
US TREASURY N/B 3.375	1,050,000.00	1,345,558.59	
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	378,070.31	
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,232,906.25	
US TREASURY N/B 3.625	500,000.00	651,289.06	
US TREASURY N/B 3.75	250,000.00	327,851.56	
US TREASURY N/B 3.75	100,000.00	132,515.62	
US TREASURY N/B 3.875	1,400,000.00	1,862,218.75	
US TREASURY N/B 4.25	450,000.00	623,496.08	
US TREASURY N/B 4.25	300,000.00	418,921.87	
US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	278,734.37	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	423,304.68	
US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	284,593.75	
US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	138,554.68	
US TREASURY N/B 4.625	300,000.00	436,757.81	
US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	262,093.75	
US TREASURY N/B 5.25	100,000.00	131,851.56	
US TREASURY N/B 5.375	100,000.00	138,703.12	
US TREASURY N/B 6.25	200,000.00	290,390.62	
US TREASURY N/B 6.5	300,000.00	400,781.25	
US TREASURY N/B 8	300,000.00	340,945.31	
米ドル 小計	111,850,000.00	118,350,152.18	(12,716,723,851)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	400,000.00	390,276.00



	CANADA-GOV'T 0.75	100,000.00	99,403.00
	CANADA-GOV'T 0.75	600,000.00	592,590.00
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	296,100.00
	CANADA-GOV'T 1	200,000.00	195,180.00
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	401,208.00
	CANADA-GOV'T 1.5	750,000.00	757,125.00
	CANADA-GOV'T 2	300,000.00	316,566.00
	CANADA-GOV'T 2.25	550,000.00	577,060.00
	CANADA-GOV'T 2.25	200,000.00	216,700.00
	CANADA-GOV'T 2.75	450,000.00	465,705.00
	CANADA-GOV'T 2.75	250,000.00	321,125.00
	CANADA-GOV'T 3.25	500,000.00	514,175.00
	CANADA-GOV'T 3.5	200,000.00	283,680.00
	CANADA-GOV'T 4	350,000.00	507,174.50
	CANADA-GOV'T 5	250,000.00	384,622.50
	カナダドル 小計	5,800,000.00	6,318,690.00 (515,289,169)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	2,000,000.00	2,278,678.00
	MEXICAN BONOS 5.75	3,500,000.00	3,291,680.00
	MEXICAN BONOS 6.5	6,000,000.00	5,953,260.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,962,520.00
	MEXICAN BONOS 7.5	5,300,000.00	5,469,865.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,051,940.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,049,250.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,226,380.00
	MEXICAN BONOS 8	4,500,000.00	4,689,540.00
	MEXICAN BONOS 8.5	1,000,000.00	1,106,150.00
	MEXICAN BONOS 8.5	2,000,000.00	2,235,360.00
	メキシコペソ 小計	36,300,000.00	37,314,623.00 (204,857,280)
ユーロ	BELGIAN 0.8	100,000.00	107,996.00
	BELGIAN 0.8	300,000.00	328,368.00
	BELGIAN 0.8	200,000.00	219,756.00
	BELGIAN 0304 5	250,000.00	436,490.00
	BELGIAN 0308 4	300,000.00	336,903.00
	BELGIAN 0320 4.25	200,000.00	357,510.00
	BELGIAN 0321 4.25	100,000.00	110,380.00
	BELGIAN 0324 4.5	100,000.00	133,409.00
	BELGIAN 0328 2.25	400,000.00	445,928.00
	BELGIAN 0332 2.6	100,000.00	115,754.00
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	105,722.00
	BELGIAN 1	200,000.00	220,308.00
	BELGIAN 1	250,000.00	282,172.50

BELGIAN 1.9	400,000.00	514,348.00
BELGIAN 2.15	200,000.00	288,812.00
BELGIAN 3.75	300,000.00	533,151.00
BTPS 0.35	400,000.00	405,024.00
BTPS 0.45	500,000.00	506,250.00
BTPS 0.65	200,000.00	202,218.00
BTPS 0.65	300,000.00	306,384.00
BTPS 0.95	600,000.00	617,952.00
BTPS 1.25	100,000.00	104,695.00
BTPS 1.35	350,000.00	363,216.00
BTPS 1.45	200,000.00	208,852.00
BTPS 1.45	500,000.00	528,735.00
BTPS 1.5	1,000,000.00	1,059,620.00
BTPS 1.6	100,000.00	107,048.00
BTPS 1.65	1,100,000.00	1,158,069.00
BTPS 1.85	300,000.00	322,299.00
BTPS 2.05	150,000.00	165,561.00
BTPS 2.2	400,000.00	445,592.00
BTPS 2.25	650,000.00	723,580.00
BTPS 2.3	2,100,000.00	2,211,069.00
BTPS 2.45	300,000.00	343,098.00
BTPS 2.5	600,000.00	666,378.00
BTPS 2.7	800,000.00	930,368.00
BTPS 2.8	200,000.00	228,596.00
BTPS 3.45	200,000.00	262,230.00
BTPS 3.75	700,000.00	742,238.00
BTPS 3.75	400,000.00	426,616.00
BTPS 3.75	400,000.00	467,264.00
BTPS 4	450,000.00	612,063.00
BTPS 4.5	200,000.00	250,696.00
BTPS 4.75	300,000.00	329,583.00
BTPS 4.75	500,000.00	671,620.00
BTPS 4.75	200,000.00	308,894.00
BTPS 5	200,000.00	225,552.00
BTPS 5	400,000.00	590,152.00
BTPS 5	250,000.00	385,807.50
BTPS 5	200,000.00	308,784.00
BTPS 5.25	200,000.00	281,968.00
BTPS 5.5	100,000.00	117,114.00
BTPS 5.75	200,000.00	307,736.00
BTPS 6	400,000.00	609,612.00
BTPS 6.5	700,000.00	1,019,305.00
BTPS 9	550,000.00	749,628.00

BUNDESUBL-173 0	500,000.00	506,740.00	
BUNDESUBL-174 0	200,000.00	203,722.00	
DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	159,031.50	
DEUTSCHLAND REP 0.25	100,000.00	107,753.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	433,380.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	250,000.00	271,825.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	350,000.00	385,185.50	
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	328,434.00	
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	222,454.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	100,000.00	137,476.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	429,168.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	300,000.00	327,090.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	668,526.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	107,591.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	111,963.00	
DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	267,000.00	
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	223,318.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	200,000.00	212,484.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	200,000.00	209,164.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	400,000.00	662,936.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	400,000.00	680,052.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	100,000.00	107,525.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	950,000.00	1,709,230.50	
DEUTSCHLAND REP 4	100,000.00	177,518.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	300,000.00	620,418.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	500,000.00	855,765.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	633,056.40	
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	262,970.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	100,000.00	158,310.00	
FINNISH GOV'T 0.75	100,000.00	111,391.00	
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	108,998.00	
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	118,069.00	
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	324,573.00	
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	107,294.00	
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	225,440.00	
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	157,168.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	128,325.00	
FRANCE O.A.T. 0	500,000.00	505,720.00	
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	709,555.00	
FRANCE O.A.T. 0	500,000.00	509,885.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	204,412.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	500,000.00	505,985.00	

FRANCE O.A.T. 0.25	100,000.00	105,507.00
FRANCE O.A.T. 0.5	500,000.00	532,620.00
FRANCE O.A.T. 0.5	1,800,000.00	1,938,816.00
FRANCE O.A.T. 0.75	100,000.00	109,965.00
FRANCE O.A.T. 0.75	300,000.00	330,270.00
FRANCE O.A.T. 1	1,600,000.00	1,760,304.00
FRANCE O.A.T. 1	450,000.00	501,579.00
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	352,455.00
FRANCE O.A.T. 1.25	700,000.00	824,845.00
FRANCE O.A.T. 1.5	650,000.00	776,275.50
FRANCE O.A.T. 1.75	650,000.00	711,984.00
FRANCE O.A.T. 1.75	500,000.00	640,720.00
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	272,146.00
FRANCE O.A.T. 2	100,000.00	137,989.00
FRANCE O.A.T. 2.25	700,000.00	767,578.00
FRANCE O.A.T. 2.25	200,000.00	228,334.00
FRANCE O.A.T. 2.5	150,000.00	155,475.00
FRANCE O.A.T. 2.5	400,000.00	518,104.00
FRANCE O.A.T. 2.75	800,000.00	1,012,584.00
FRANCE O.A.T. 3	250,000.00	275,262.50
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	434,852.00
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	670,536.00
FRANCE O.A.T. 3.5	950,000.00	1,212,561.00
FRANCE O.A.T. 3.75	200,000.00	214,878.00
FRANCE O.A.T. 4	100,000.00	204,295.00
FRANCE O.A.T. 4	300,000.00	640,863.00
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	726,618.00
FRANCE O.A.T. 4.5	300,000.00	563,235.00
FRANCE O.A.T. 4.75	400,000.00	691,020.00
FRANCE O.A.T. 5.5	200,000.00	314,052.00
FRANCE O.A.T. 5.75	700,000.00	1,241,359.00
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	564,776.00
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	268,482.00
IRISH GOVT 0.8	100,000.00	103,562.00
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	119,635.00
IRISH GOVT 2	300,000.00	386,880.00
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	235,856.00
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	232,024.00
IRISH GOVT 5	600,000.00	637,506.00
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	396,753.00
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	305,928.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	422,616.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	324,117.00

NETHERLANDS GOVT 0.75	700,000.00	773,836.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	111,381.00	
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	455,072.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	100,000.00	108,998.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	100,000.00	138,397.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	100,000.00	176,128.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	400,000.00	430,484.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	231,498.00	
NETHERLANDS GOVT 4	450,000.00	783,612.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	606,508.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	700,000.00	752,724.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	400,000.00	439,904.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	222,454.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	100,000.00	130,973.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	300,000.00	335,940.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	300,000.00	331,101.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	150,000.00	204,265.50	
REP OF AUSTRIA 3.15	100,000.00	170,447.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	226,910.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	217,290.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	226,892.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	200,000.00	343,088.00	
SPANISH GOV'T 0.05	100,000.00	100,844.00	
SPANISH GOV'T 0.25	1,300,000.00	1,335,529.00	
SPANISH GOV'T 0.35	1,700,000.00	1,748,382.00	
SPANISH GOV'T 0.4	500,000.00	512,135.00	
SPANISH GOV'T 0.45	300,000.00	308,610.00	
SPANISH GOV'T 0.75	1,600,000.00	1,639,424.00	
SPANISH GOV'T 1.3	200,000.00	219,382.00	
SPANISH GOV'T 1.4	100,000.00	111,415.00	
SPANISH GOV'T 1.45	200,000.00	223,058.00	
SPANISH GOV'T 1.45	100,000.00	112,089.00	
SPANISH GOV'T 1.5	300,000.00	334,437.00	
SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	330,675.00	
SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	681,918.00	
SPANISH GOV'T 2.35	500,000.00	622,535.00	
SPANISH GOV'T 2.7	150,000.00	207,139.50	
SPANISH GOV'T 2.75	500,000.00	578,235.00	
SPANISH GOV'T 2.9	300,000.00	425,436.00	
SPANISH GOV'T 3.45	100,000.00	166,068.00	
SPANISH GOV'T 3.8	200,000.00	238,586.00	
SPANISH GOV'T 4.2	170,000.00	267,967.60	

	SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	321,425.00
	SPANISH GOV'T 4.7	200,000.00	350,192.00
	SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	614,015.00
	SPANISH GOV'T 4.85	200,000.00	212,486.00
	SPANISH GOV'T 4.9	100,000.00	177,288.00
	SPANISH GOV'T 5.15	700,000.00	1,019,886.00
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	382,942.00
	SPANISH GOV'T 5.5	200,000.00	219,918.00
	SPANISH GOV'T 5.75	300,000.00	503,730.00
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	692,106.00
	SPANISH GOV'T 6	500,000.00	774,270.00
	ユーロ 小計	70,030,000.00	85,420,617.50 (10,136,864,678)
英bond	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	501,730.00
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	202,702.00
	UK TSY GILT 1	250,000.00	256,955.00
	UK TSY GILT 1.25	150,000.00	159,330.00
	UK TSY GILT 1.5	150,000.00	152,046.00
	UK TSY GILT 1.5	400,000.00	430,268.00
	UK TSY GILT 1.5	200,000.00	219,278.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	494,361.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	312,045.00
	UK TSY GILT 1.75	200,000.00	225,488.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	367,902.00
	UK TSY GILT 2	150,000.00	164,701.50
	UK TSY GILT 2.25	250,000.00	268,380.00
	UK TSY GILT 2.5	200,000.00	308,938.00
	UK TSY GILT 2.75	300,000.00	334,977.00
	UK TSY GILT 3.25	1,200,000.00	1,752,108.00
	UK TSY GILT 3.5	400,000.00	781,848.00
	UK TSY GILT 3.75	200,000.00	206,380.00
	UK TSY GILT 3.75	250,000.00	266,477.50
	UK TSY GILT 3.75	50,000.00	87,123.00
	UK TSY GILT 4	250,000.00	496,222.50
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	392,949.00
	UK TSY GILT 4.25	350,000.00	500,895.50
	UK TSY GILT 4.25	450,000.00	682,065.00
	UK TSY GILT 4.25	250,000.00	403,572.50
	UK TSY GILT 4.25	100,000.00	174,387.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	362,340.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	393,122.00
	UK TSY GILT 4.5	150,000.00	227,997.00
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	341,674.00

	UK TSY GILT 4.75	300,000.00	435,492.00	
	UK TSY GILT 4.75	130,000.00	216,781.50	
	UK TSY GILT 5	150,000.00	187,527.00	
	UK TSY GILT 8	300,000.00	339,402.00	
英ポンド 小計		9,430,000.00	12,647,465.00	(1,677,812,706)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	700,000.00	764,204.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	800,000.00	881,256.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	600,000.00	652,542.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,100,000.00	1,289,563.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	2,000,000.00	2,225,240.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	700,000.00	1,129,338.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	1,000,000.00	1,068,400.00	
スウェーデンクローナ 小計		6,900,000.00	8,010,543.00	(89,077,238)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,025,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,032,100.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	300,000.00	308,850.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	1,000,000.00	1,068,100.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	600,000.00	647,940.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	1,000,000.00	1,043,500.00	
ノルウェークローネ 小計		4,900,000.00	5,125,490.00	(61,710,899)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	950,000.00	1,044,240.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	500,000.00	555,150.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	800,000.00	880,320.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	400,000.00	464,680.00	
	DENMARK - BULLET 3	1,500,000.00	1,627,500.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	1,700,000.00	3,406,800.00	
	DENMARK - BULLET 7	520,000.00	734,968.00	
デンマーククローネ 小計		6,370,000.00	8,713,658.00	(138,634,298)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	700,000.00	702,100.00	
	POLAND GOVT BOND 2	200,000.00	201,100.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	900,000.00	928,710.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,100,000.00	1,136,806.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	400,000.00	428,408.00	
	POLAND GOVT BOND 4	500,000.00	542,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	600,000.00	650,400.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	700,000.00	783,132.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	100,000.00	132,200.00	
ポーランドズロチ 小計		5,200,000.00	5,504,856.00	

オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2	300,000.00	307,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	600,000.00	658,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	435,267.60
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	283,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	460,228.40
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	100,000.00	120,290.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	260,587.20
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	250,000.00	281,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	450,000.00	539,010.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	259,880.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	412,959.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	600,000.00	725,160.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	350,000.00	495,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	500,000.00	582,325.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	600,000.00	648,228.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	600,000.00	682,260.00
オーストラリアドル 小計		6,100,000.00	7,152,895.20 (527,311,434)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	400,000.00	397,016.00
	SINGAPORE GOV'T 2.125	200,000.00	205,707.58
	SINGAPORE GOV'T 2.25	200,000.00	202,156.14
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	312,269.31
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	113,385.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	228,827.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	300,000.00	331,335.48
	SINGAPORE GOV'T 3	100,000.00	106,596.52
	SINGAPORE GOV'T 3.125	300,000.00	313,091.13
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	296,337.50
	SINGAPORE GOV'T 3.5	400,000.00	451,123.12
	シンガポールドル 小計		2,750,000.00
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	10,000,000.00	7,080,000.00
	REP SOUTH AFRICA 7	10,800,000.00	9,251,280.00
	REP SOUTH AFRICA 7.75	3,500,000.00	3,549,350.00
南アフリカランド 小計		24,300,000.00	19,880,630.00 (144,532,180)
合計			26,593,716,170 (26,593,716,170)

(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	145銘柄	47.6%	47.8%
カナダドル	国債証券	16銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	11銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券	194銘柄	38.0%	38.1%
英ポンド	国債証券	34銘柄	6.3%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7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	16銘柄	2.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	11銘柄	0.9%	0.9%
南アフリカランド	国債証券	3銘柄	0.5%	0.5%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	334,475,306	359,861,426
コール・ローン	593,592,045	304,105,412
国債証券	171,481,158,482	152,381,911,523
未収利息	1,226,047,648	971,694,786
前払費用	27,866,530	27,360,488
流動資産合計	173,663,140,011	154,044,933,635
資産合計	173,663,140,011	154,044,933,635
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	337,070
未払解約金	188,804,322	176,807,023
未払利息	1,610	630
その他未払費用	16,210	24,932
流動負債合計	188,822,142	177,169,655
負債合計	188,822,142	177,169,655
純資産の部		
元本等		
元本	100,766,478,176	85,552,532,956
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	72,707,839,693	68,315,231,024
元本等合計	173,474,317,869	153,867,763,980
純資産合計	173,474,317,869	153,867,763,980
負債純資産合計	173,663,140,011	154,044,933,635

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,766,478,176口	85,552,532,956口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7215円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,215円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.7985円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,985円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和1年9月10日現在)
----	---------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月10日現在)

該当事項はありません。

(令和 1年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	51,636,240	-	51,973,310	337,070
	マレーシアリングット	51,636,240	-	51,973,310	337,070
合計		51,636,240	-	51,973,310	337,070

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月10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	112,404,835,124円
同期中における追加設定元本額	6,106,076,616円
同期中における一部解約元本額	17,744,433,564円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	10,223,588,732円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	547,964,053円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,527,722,221円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	792,053,996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)	24,512,720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)	9,082,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,884,240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)	82,824,374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)	93,161,714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)	48,200,531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)	115,935,484円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	14,089,333円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	71,212,214円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	201,009,979円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	310,292,679円
イオン・バランス戦略ファンド	50,903,769円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,897,550円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	9,189,135円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,606,175円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	21,327,892円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	11,280,540円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	10,729,602円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	13,377,486円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,817,257,370円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	286,524,890円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	13,157,520,721円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,339,642,136円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,312,997,823円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,184,531円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	115,867,667円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	600,777円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	896,419,146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>	130,475,879円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,371,137,002円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,727,753,184円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,237,066,485円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,424,426,646円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	4,498,529円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,950,077,478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)	987,615,102円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,093,920,428円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	206,182,810円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	674,903,636円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,637,771,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	165,635,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	43,915,013円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,610,319円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	163,934,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	597,006,926円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	193,702,523円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	182,591,770円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	55,444,546円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,191,746円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,504,616,610円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,493,972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>	4,332,818,566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>	1,941,980,208円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,817,026,530円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	907,615,879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>	14,193,917円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,524,456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>	422,899,795円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	202,618,815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>	495,930,810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>	35,016円
合計	100,766,478,176円

(令和1年9月10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	100,766,478,176円
同期中における追加設定元本額	8,406,111,355円
同期中における一部解約元本額	23,620,056,575円
令和 1年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	11,781,084,481円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	624,034,740円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,658,861,937円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	816,230,829円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,916,951円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,477,790円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	87,658,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	121,608,738円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	64,354,968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)	139,595,794円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	18,345,535円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	168,536,737円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	184,947,939円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	178,697,308円
イオン・バランス戦略ファンド	26,882,224円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,831,207円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	37,548,866円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,023,792円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	71,922,383円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	30,131,496円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,168,572円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	32,391,000円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,364円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,738,760,543円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,992,477,306円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,580,003,468円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,498,783,912円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,984,328円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	550,315円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	719,074,489円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,249,804,938円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,538,130,778円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,918,853,792円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,343,994,831円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,624,200円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,716,683,112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)	391,323,984円

三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	432,873,574円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	177,116,717円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	168,408,030円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20A <適格機関投資家専用>	141,761,439円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35A <適格機関投資家専用>	40,602,622円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50A <適格機関投資家専用>	13,631,242円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20L <適格機関投資家専用>	140,663,432円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25L <適格機関投資家専用>	538,237,993円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20T <適格機関投資家専用>	89,596,986円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20A2 <適格機関投資家専用>	166,962,548円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35A2 <適格機関投資家専用>	51,587,486円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50A2 <適格機関投資家専用>	5,611,476円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25L2 <適格機関投資家専用>	1,325,471,719円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20T2 <適格機関投資家専用>	21,829,928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>	2,970,600,439円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A <適格機関投資家限定>	1,466,158,024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>	5,936,761,816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>	668,036,293円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	8,879,303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>	36,780,079円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	195,516,151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>	272,287,686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>	506,071,933円
合計	85,552,532,956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	3,767,343.75	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,972,109.39	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,457,460.96	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,674,687.50	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,079,820.32	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,574,968.76	
		US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,474,570.33	



US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,970,703.14
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,983,437.52
US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,287,882.82
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,986,406.25
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,682,945.33
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,985,703.14
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,388,000.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,979,687.52
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,482,226.58
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,488,476.57
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,984,531.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,995,781.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,998,593.75
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,998,125.00
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,493,789.07
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,495,351.58
US TREASURY N/B 1.625	5,500,000.00	5,518,046.87
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,409,562.50
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,512,031.25
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,011,953.14
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,013,828.14
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,014,296.89
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,409,937.51
US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,075,523.43
US TREASURY N/B 1.625	1,900,000.00	1,900,296.87
US TREASURY N/B 1.75	3,700,000.00	3,699,132.83
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,999,843.76
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,010,546.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,014,296.89
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,809,843.75
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,412,562.51
US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,123,062.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,016,406.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,018,046.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,020,390.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,022,968.75
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,747,648.46
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,417,625.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,016,093.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,025,078.14
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,026,953.14
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,715,937.50

US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,040,937.52
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,032,812.50
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,832,203.13
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,265,500.00
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,304,671.87
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,315,320.33
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,010,546.89
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,012,656.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,016,875.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,022,031.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,025,312.50
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,337,625.00
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,533,085.95
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,133,421.87
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,040,312.50
US TREASURY N/B 2	500,000.00	507,304.69
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,044,765.64
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,588,945.34
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,044,531.26
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,376,054.70
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,557,421.87
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,586,953.12
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,410,523.45
US TREASURY N/B 2	3,900,000.00	4,016,085.95
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,008,671.89
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,714,343.75
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,714,078.12
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,038,437.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,640.64
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,037,265.64
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,049,218.75
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,078,125.00
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,177,984.37
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,053,281.26
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,108,750.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,602,265.62
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,120,625.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,855,406.25
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,058,867.21
US TREASURY N/B 2.125	6,300,000.00	6,525,914.09
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,030,312.52
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,025,078.14
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,540,781.25

US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,831,500.00	
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,375,921.87	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,093,046.89	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,364,125.00	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,554,960.94	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,532,804.71	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,216,976.57	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,164,687.52	
US TREASURY N/B 2.25	7,600,000.00	7,927,750.00	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,448,218.77	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,456,343.77	
US TREASURY N/B 2.25	5,600,000.00	5,881,312.52	
US TREASURY N/B 2.25	3,700,000.00	3,820,250.00	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,016,015.62	
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	5,049,609.40	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,021,250.00	
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,673,968.76	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,233,562.50	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,245,187.50	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,830,125.00	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,184,046.87	
US TREASURY N/B 2.375	6,200,000.00	6,610,750.00	
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,940,375.00	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,577,656.25	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,188,671.90	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,955,609.37	
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,831,437.50	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,481,375.00	
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,984,531.25	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,144,687.50	
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	5,313,054.71	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,555,429.71	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	507,773.44	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,067,187.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,070,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,071,015.64	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,148,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,551,281.25	
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	6,172,015.65	
US TREASURY N/B 2.625	6,900,000.00	7,499,437.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,084,687.52	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,432,046.88	

US TREASURY N/B 2.75	4,900,000.00	5,112,843.75
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,092,812.50
US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,389,273.46
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,510,968.75
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,373,726.58
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,128,281.26
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,335,937.50
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	641,156.25
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,234,250.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,262,031.26
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,165,312.50
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,734,312.51
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,709,882.82
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,109,687.52
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,110,937.50
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,359,328.13
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,180,781.25
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,695,507.82
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,960,546.87
US TREASURY N/B 2.875	3,400,000.00	3,754,875.00
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,465,234.39
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,642,500.00
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,190,906.26
US TREASURY N/B 2.875	300,000.00	351,656.25
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,335,312.52
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,363,257.82
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	2,118,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,732,187.52
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,741,875.00
US TREASURY N/B 3	4,200,000.00	4,986,843.75
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,982,421.87
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,623,843.75
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,703,289.07
US TREASURY N/B 3	1,900,000.00	2,273,468.75
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,555,843.75
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,073,593.75
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	6,427,195.34
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,319,656.25
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,401,093.76
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,762,695.32
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	4,586,421.89
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,934,937.50
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	5,019,687.52

	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,972,601.57
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,008,187.50
	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,137,109.40
	US TREASURY N/B 3.625	3,400,000.00	4,417,609.39
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,689,281.26
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,967,109.37
	US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	5,300,625.00
	US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,995,234.37
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,385,546.88
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	837,843.75
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	696,835.94
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	987,710.94
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,981,546.88
	US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,561,343.75
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,039,160.16
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	283,609.37
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,430,546.88
	US TREASURY N/B 4.625	1,200,000.00	1,747,031.25
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,232,656.25
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	741,289.06
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	655,234.37
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	443,850.00
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	661,953.12
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,272,812.50
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,348,359.38
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	944,687.50
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	667,968.75
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,477,429.69
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,063,593.75
	米ドル 小計	639,620,000.00	677,505,042.73 (72,797,916,841)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,951,380.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,900,000.00	1,888,657.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,975,300.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,974,000.00
	CANADA-GOV'T 1	700,000.00	690,473.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	975,900.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,006,040.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,006,600.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,009,500.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,111,495.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	949,698.00

	CANADA-GOV'T 2.25	400,000.00	414,792.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,468,880.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,516,900.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,207,499.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,300,000.00	1,345,370.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,412,950.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	699,450.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,028,350.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,100,000.00	2,126,670.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,127,600.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,173,605.00
	CANADA-GOV'T 5	950,000.00	1,461,565.50
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	838,596.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	921,468.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	743,880.00
	カナダドル 小計	32,550,000.00	36,026,618.50 (2,937,970,738)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,458,848.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,809,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	34,000,000.00	33,681,420.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,801,250.00
	MEXICAN BONOS 8	22,000,000.00	22,926,640.00
	MEXICAN BONOS 8.5	31,000,000.00	34,290,650.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	44,707,200.00
	メキシコペソ 小計	204,000,000.00	216,675,608.00 (1,189,549,087)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,058,253.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,403,948.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	766,192.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	549,390.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,016,620.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,793,536.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	786,107.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,681,325.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,434,940.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,334,090.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,963,976.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,672,230.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	578,770.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	713,110.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,057,220.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	719,700.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	480,016.00

BELGIAN 1	1,400,000.00	1,542,156.00
BELGIAN 1	1,300,000.00	1,467,297.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	465,892.00
BELGIAN 1.6	800,000.00	1,000,408.00
BELGIAN 1.9	500,000.00	642,935.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	722,030.00
BELGIAN 3.75	900,000.00	1,599,453.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	1,005,980.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,518,840.00
BTPS 0.45	1,500,000.00	1,518,750.00
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,617,744.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,042,560.00
BTPS 0.9	1,400,000.00	1,438,584.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,059,840.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,034,040.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	2,093,900.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,075,520.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,088,520.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,903,446.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,057,080.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,860,974.00
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,284,576.00
BTPS 1.65	2,400,000.00	2,526,696.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,074,330.00
BTPS 2	2,300,000.00	2,512,359.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,765,744.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,655,610.00
BTPS 2.15	500,000.00	526,765.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,113,980.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,335,840.00
BTPS 2.3	600,000.00	631,734.00
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,258,026.00
BTPS 2.5	600,000.00	666,378.00
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,233,067.00
BTPS 2.7	1,200,000.00	1,395,552.00
BTPS 2.8	300,000.00	351,759.00
BTPS 2.8	900,000.00	1,028,682.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,206,740.00
BTPS 3.1	1,700,000.00	2,079,593.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,905,855.00
BTPS 3.35	850,000.00	1,067,557.50
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,835,610.00
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,363,296.00

BTPS 3.75	2,500,000.00	2,650,850.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,133,080.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,441,600.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,336,320.00	
BTPS 3.85	200,000.00	278,192.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,604,350.00	
BTPS 4	2,100,000.00	2,856,294.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,666,160.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,567,960.00	
BTPS 4.5	2,600,000.00	3,259,048.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,856,386.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,945,950.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,358,100.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,471,152.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,255,520.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,249,240.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,054,036.60	
BTPS 5	1,800,000.00	2,777,814.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,624,664.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,397,676.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,342,280.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,615,756.00	
BTPS 6	2,700,000.00	4,114,881.00	
BTPS 6.5	1,200,000.00	1,747,380.00	
BTPS 7.25	400,000.00	584,404.00	
BTPS 9	300,000.00	408,888.00	
BUNDESOBL-172 0.25	2,000,000.00	2,023,460.00	
BUNDESOBL-173 0	2,500,000.00	2,533,700.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,055,830.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,300,000.00	3,486,846.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,939,554.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,142,005.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,500,000.00	1,627,035.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,689,450.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	978,570.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,650,795.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,207,520.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,423,214.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,280,153.50	
DEUTSCHLAND REP 1.25	550,000.00	756,118.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,710,750.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,417,390.00	



DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,228,420.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,367,002.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,239,260.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,674,885.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,487,388.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,568,730.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,646,148.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,570,273.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,159,028.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,195,324.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,823,335.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,391,888.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,408,657.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,515,702.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,540,377.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,544,040.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,577,820.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	867,155.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,583,100.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	408,152.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	432,408.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	556,955.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	236,138.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,081,910.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,072,940.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,127,200.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	785,840.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	769,950.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,069,010.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,276,780.00
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,257,330.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,066,180.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,056,560.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,032,460.00
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,275,504.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,327,531.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	2,110,140.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,089,196.00
FRANCE O.A.T. 0.5	1,500,000.00	1,606,845.00
FRANCE O.A.T. 0.5	1,100,000.00	1,184,832.00
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,628,845.00
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,871,530.00
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,255,389.50

FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,786,550.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,997,245.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,828,040.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,359,085.50	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,381,440.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,100,000.00	3,496,428.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,794,016.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,088,584.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,759,780.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,900,000.00	3,179,966.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,881,678.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,300,000.00	3,420,450.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	2,000,000.00	2,590,520.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,050,000.00	5,126,206.50	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,505,250.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,717,825.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,000,000.00	3,352,680.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,190,950.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,652,926.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,418,160.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	2,390,251.50	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	3,204,315.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,633,090.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,444,605.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,800,610.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,318,215.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,965,436.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,235,820.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	805,446.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	407,776.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	724,934.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	761,089.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,087,250.00	
IRISH GOVT 1.1	1,100,000.00	1,217,205.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	358,905.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,289,600.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	748,260.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,179,280.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	580,060.00	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,062,510.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,983,765.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,835,568.00	

NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,796,118.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	300,000.00	320,910.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,620,585.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,547,672.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,200,000.00	1,336,572.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,762,384.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,137,680.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,634,970.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,383,970.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	2,289,664.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	860,968.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	810,243.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,432,053.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,915,496.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,061,389.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,130,965.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,150,640.00
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	916,597.50
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	981,927.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	219,952.00
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	444,908.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	286,558.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	654,865.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,231,780.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,103,670.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	817,062.00
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	1,022,682.00
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	680,730.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,086,450.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,116,460.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	1,134,460.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,230,072.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,360,680.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,539,710.00
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,109,284.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,048,540.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,049,280.00
SPANISH GOV'T 1.15	900,000.00	913,806.00
SPANISH GOV'T 1.3	1,200,000.00	1,316,292.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,227,760.00
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,782,640.00
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	669,174.00
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,250,581.00

	SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,672,185.00	
	SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,424,950.00	
	SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	471,184.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	400,000.00	454,612.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	2,006,765.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,282,680.00	
	SPANISH GOV'T 2.35	600,000.00	747,042.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	650,000.00	897,604.50	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,428,587.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,985,368.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,826,748.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,266,567.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,600,862.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,397,320.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,314,260.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	3,151,728.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,456,060.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,124,860.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,659,320.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,185,470.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,297,652.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,697,727.50	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,968,893.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,518,650.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,537,722.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	706,420.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,406,788.00	
	ユーロ 小計	396,440,000.00	489,511,646.10 (58,090,347,042)	
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,806,228.00	
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	760,132.50	
	UK TSY GILT 1.25	1,500,000.00	1,593,300.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,050,000.00	1,064,322.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,075,670.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,863,863.00	
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	566,302.50	
	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,538,012.00	
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,120,450.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,050,000.00	1,183,812.00	
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	349,149.00	
	UK TSY GILT 2	400,000.00	405,012.00	
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,207,811.00	

	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,898,504.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,471,504.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,898,203.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,336,144.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,528,278.50
	UK TSY GILT 3.5	1,700,000.00	3,322,854.00
	UK TSY GILT 3.75	1,550,000.00	1,599,445.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	532,955.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,787,936.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,634,280.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,374,313.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,440,813.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,003,582.00
	UK TSY GILT 4.25	1,350,000.00	2,046,195.00
	UK TSY GILT 4.25	850,000.00	1,351,262.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,098,577.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,615,805.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,536,380.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,341,537.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,051,973.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,306,299.50
	UK TSY GILT 4.75	1,000,000.00	1,451,640.00
	UK TSY GILT 4.75	1,100,000.00	1,834,305.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	2,000,288.00
	UK TSY GILT 6	950,000.00	1,423,774.50
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,832,770.80
	英bond 小計	52,870,000.00	72,253,682.30 (9,585,173,493)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	7,400,000.00	8,151,618.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,612,990.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,861,650.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,900,960.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,421,364.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	7,800,000.00	8,333,520.00
	スウェーデンクローナ 小計	39,800,000.00	46,282,102.00 (514,656,974)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,587,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,160,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,177,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,272,400.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,319,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,261,000.00
		28,500,000.00	29,778,000.00

ノルウェークローネ 小計			(358,527,120)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,544,450.00
	DENMARK - BULLET 0.5	3,200,000.00	3,517,440.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,502,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,970,200.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,595,000.00
	DENMARK - BULLET 4.5	11,500,000.00	23,046,000.00
デンマーククローネ 小計		36,200,000.00	50,175,090.00 (798,285,681)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,009,000.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,011,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,643,550.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,100,380.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,900,000.00	6,319,018.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,926,800.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	1,200,000.00	1,249,200.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,336,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,685,024.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,850,800.00
ポーランドズロチ 小計		30,100,000.00	32,130,772.00 (879,740,537)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1,200,000.00	1,211,292.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,024,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	417,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,900,000.00	2,086,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	800,000.00	913,360.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,720,422.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,494,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,071,027.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,508,390.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	962,320.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,433,229.60
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,142,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,515,380.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,150,000.00	1,494,310.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,651,836.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,350,000.00	2,840,210.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,981,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,926,060.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,200,000.00	2,562,230.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,025,064.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,183,880.00	

オーストラリアドル 小計		35,200,000.00	41,165,351.90 (3,034,709,742)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,111,858.77
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,040,897.70
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	453,540.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	800,894.50
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	444,326.44
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	746,175.64
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	834,909.68
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	812,386.32
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	592,675.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,100,000.00	1,240,588.58
シンガポールドル 小計		7,500,000.00	8,078,252.63 (628,649,619)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	8,068,224.00
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	7,975,309.91
	MALAYSIA GOVT 3.955	2,500,000.00	2,585,820.25
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,442,886.00
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,441,426.60
マレーシアリングgit 小計		26,400,000.00	27,513,666.76 (708,752,055)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,480,000.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	16,021,920.00
	REP SOUTH AFRICA 7	54,000,000.00	46,256,400.00
	REP SOUTH AFRICA 8	14,000,000.00	13,210,400.00
南アフリカランド 小計		144,000,000.00	117,968,720.00 (857,632,594)
合計			152,381,911,523 (152,381,911,523)

(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 206銘柄	47.3%	47.8%
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 7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 257銘柄	37.8%	38.1%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.2%	6.3%
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 6銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	2.0%	2.0%

シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	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

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,179,965,453	2,844,592,131
株式	170,989,260,450	162,317,778,960
派生商品評価勘定	243,800	9,394,560
未収入金	193,143,702	82,093,400
未収配当金	87,569,185	87,854,297
前払金	31,885,000	-
差入委託証拠金	47,915,000	-
流動資産合計	175,529,982,590	165,341,713,348
資産合計	175,529,982,590	165,341,713,348
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,280,000	-
前受金	-	9,576,000
未払金	2,086,404,711	75,412,440
未払解約金	87,035,125	314,201,129
未払利息	11,337	5,898
その他未払費用	163,644	80,285
流動負債合計	2,205,894,817	399,275,752
負債合計	2,205,894,817	399,275,752
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,586,990,177	67,012,358,207
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	106,737,097,596	97,930,079,389
元本等合計	173,324,087,773	164,942,437,596
純資産合計	173,324,087,773	164,942,437,596
負債純資産合計	175,529,982,590	165,341,713,348

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
-----	--------------------------------



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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,637,600,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,873,200,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,586,990,177口	67,012,358,207口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.6030円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,030円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.4614円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 24,614円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,391,736,200	-	2,359,700,000	32,036,200
	東証株価指数先物	2,391,736,200	-	2,359,700,000	32,036,200
合計		2,391,736,200	-	2,359,700,000	32,036,200

(令和 1年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,577,805,440	-	2,587,200,000	9,394,560
	東証株価指数先物	2,577,805,440	-	2,587,200,000	9,394,560
合計		2,577,805,440	-	2,587,200,000	9,394,560

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 平成30年 9月10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	75,802,647,990円
同期中における追加設定元本額	11,022,118,498円
同期中における一部解約元本額	20,237,776,311円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,099,270,406円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	716,306,262円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,457,770,772円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,559,329,482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）	86,725,367円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	6,983,129円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	23,303,718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）	57,354,699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）	81,562,911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）	47,632,840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）	119,707,931円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,730,641,028円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	6,372,902,883円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	466,988,792円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	655,087,331円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	634,617,892円
イオン・バランス戦略ファンド	29,799,528円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,524,546円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	3,300,685円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	4,388,498円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	21,108,658円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	17,407,453円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	54,709,485円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,349,232円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	6,273,900,103円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	27,273,737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＞	782,961,562円

SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,655,636,480円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,525,914,762円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,281,043,684円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	57,070,190円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	224,385,726円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,654円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,025,614,036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>	55,784,848円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	380,046,357円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,094,310,631円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	968,009,581円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,183,125,486円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,958,497円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,371,352,227円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	67,722,044円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	107,674,530円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,572,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	47,179,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,068,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	213,768,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	387,104,118円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	162,473,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	115,344,686円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	59,920,850円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	10,985,484円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	76,185,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	968,969,824円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	205,175,335円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,535,802円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	1,730,910,414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>	249,740,027円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,683,022,698円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	156,929,929円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	12,907,991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>	127,663,987円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	61,164,812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>	150,752,258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>	20,857円
合計	66,586,990,177円

(令和1年9月10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	66,586,990,177円
同期中における追加設定元本額	14,402,624,359円
同期中における一部解約元本額	13,977,256,329円
令和 1年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,297,535,093円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	936,629,094円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,372,622,152円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,077,596,599円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	79,548,105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）	7,521,416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）	26,449,717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）	69,280,114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）	114,015,385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）	72,611,248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）	162,043,173円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,881,721,931円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	10,681,862,873円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	703,214,947円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	704,638,089円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	657,634,234円
イオン・バランス戦略ファンド	20,200,789円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,674,460円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	50,643,496円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	43,779,782円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	118,883,698円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	67,721,066円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	97,101,612円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,942,118円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）	84,449円
三井住友D S ・年金バランス50（標準型）	145,980円
三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）	205,814円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	4,295,208,817円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	25,179,682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＞	225,151,325円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,425,849,637円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,478,628,566円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	9,114,813,234円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	61,727,246円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	228,715,429円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	820,636円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	944,525,520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＞	59,055,804円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	383,289,354円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,117,775,166円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	946,532,566円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,069,470,019円

S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,178,238円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	320,817,705円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	64,850,126円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	124,813,482円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	106,238,219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 >	50,196,487円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	23,479,637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 >	210,333,929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 >	391,125,797円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	88,869,499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 >	124,403,903円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	62,637,257円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,693,725円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	77,976,450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 >	944,546,625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 )	205,369,341円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	21,266,288円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	1,371,586,190円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	216,497,008円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	133,073,322円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	12,426,668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 >	62,248,962円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	85,931,741円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	83,433,172円
合計	67,012,358,207円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	2,818.00	9,863,000	
日本水産	100,400	623.00	62,549,200	
マルハニチロ	14,400	2,697.00	38,836,800	
カネコ種苗	4,000	1,140.00	4,560,000	
サカタのタネ	11,300	3,675.00	41,527,500	
ホクト	8,100	1,918.00	15,535,800	
日鉄鉱業	2,400	4,015.00	9,636,000	
三井松島ホールディングス	5,300	1,211.00	6,418,300	

国際石油開発帝石	399,800	937.30	374,732,540
石油資源開発	14,000	2,701.00	37,814,000
K & O エナジーグループ	5,100	1,337.00	6,818,700
ヒノキヤグループ	3,200	1,852.00	5,926,400
ショーボンドホールディングス	14,000	3,700.00	51,800,000
ミライト・ホールディングス	26,700	1,593.00	42,533,100
タマホーム	6,000	1,454.00	8,724,000
ベステラ	2,700	1,225.00	3,307,500
スペースバリューホールディングス	13,800	473.00	6,527,400
安藤・間	64,300	715.00	45,974,500
東急建設	29,100	763.00	22,203,300
コムシスホールディングス	34,600	2,904.00	100,478,400
ミサワホーム	8,500	1,102.00	9,367,000
高松コンストラクショングループ	6,300	2,356.00	14,842,800
東建コーポレーション	2,900	6,300.00	18,270,000
大成建設	80,800	3,950.00	319,160,000
大林組	241,400	1,018.00	245,745,200
清水建設	247,300	936.00	231,472,800
飛鳥建設	8,200	1,154.00	9,462,800
長谷工コーポレーション	101,400	1,200.00	121,680,000
松井建設	11,200	692.00	7,750,400
銭高組	1,300	3,915.00	5,089,500
鹿島建設	189,500	1,365.00	258,667,500
不動テトラ	7,000	1,147.00	8,029,000
大末建設	5,400	929.00	5,016,600
鉄建建設	5,400	2,640.00	14,256,000
西松建設	18,600	1,924.00	35,786,400
三井住友建設	61,500	553.00	34,009,500
大豊建設	5,800	2,664.00	15,451,200
前田建設工業	60,300	883.00	53,244,900
奥村組	14,200	2,809.00	39,887,800
東鉄工業	9,400	3,150.00	29,610,000
浅沼組	3,300	3,620.00	11,946,000
戸田建設	95,700	600.00	57,420,000
熊谷組	11,800	3,000.00	35,400,000
北野建設	2,300	2,326.00	5,349,800
矢作建設工業	13,900	679.00	9,438,100
ピーエス三菱	11,100	671.00	7,448,100
日本ハウスホールディングス	20,000	475.00	9,500,000
大東建託	29,200	14,090.00	411,428,000
新日本建設	10,200	749.00	7,639,800
N I P P O	20,700	1,878.00	38,874,600



東亜道路工業	2,300	3,235.00	7,440,500
前田道路	25,300	2,423.00	61,301,900
日本道路	2,400	6,140.00	14,736,000
東亜建設工業	8,300	1,311.00	10,881,300
日本国土開発	15,000	553.00	8,295,000
若築建設	5,800	1,495.00	8,671,000
東洋建設	32,900	436.00	14,344,400
五洋建設	100,700	573.00	57,701,100
世紀東急工業	15,400	688.00	10,595,200
福田組	2,800	3,860.00	10,808,000
住友林業	56,900	1,361.00	77,440,900
巴コーポレーション	16,600	404.00	6,706,400
大和ハウス工業	225,800	3,390.00	765,462,000
ライト工業	16,100	1,359.00	21,879,900
積水ハウス	249,500	1,989.50	496,380,250
日特建設	9,500	628.00	5,966,000
ユアテック	13,800	654.00	9,025,200
中電工	10,800	2,266.00	24,472,800
関電工	33,800	927.00	31,332,600
きんでん	53,100	1,571.00	83,420,100
東京エネシス	9,400	882.00	8,290,800
トーエネック	2,900	3,235.00	9,381,500
住友電設	6,000	1,975.00	11,850,000
日本電設工業	12,700	2,143.00	27,216,100
協和エクシオ	31,700	2,573.00	81,564,100
新日本空調	7,500	1,748.00	13,110,000
九電工	16,100	3,330.00	53,613,000
三機工業	18,500	1,252.00	23,162,000
日揮	71,200	1,358.00	96,689,600
中外炉工業	3,200	1,455.00	4,656,000
ヤマト	10,600	650.00	6,890,000
太平電業	5,800	2,360.00	13,688,000
高砂熱学工業	19,200	1,723.00	33,081,600
朝日工業社	2,300	2,864.00	6,587,200
明星工業	15,300	720.00	11,016,000
大気社	11,300	3,160.00	35,708,000
ダイダン	5,900	2,001.00	11,805,900
日比谷総合設備	7,900	1,906.00	15,057,400
東芝プラントシステム	17,600	1,751.00	30,817,600
OSJBホールディングス	41,700	233.00	9,716,100
レイズネクスト	15,500	1,173.00	18,181,500
日本製粉	21,200	1,666.00	35,319,200

日清製粉グループ本社	81,900	1,968.00	161,179,200
日東富士製粉	800	6,540.00	5,232,000
昭和産業	6,400	3,100.00	19,840,000
鳥越製粉	9,100	824.00	7,498,400
中部飼料	9,400	1,144.00	10,753,600
フィード・ワン	52,400	156.00	8,174,400
日本甜菜製糖	5,300	1,769.00	9,375,700
三井製糖	5,500	2,240.00	12,320,000
日新製糖	3,300	1,940.00	6,402,000
森永製菓	18,300	5,060.00	92,598,000
中村屋	2,500	4,285.00	10,712,500
江崎グリコ	22,200	4,660.00	103,452,000
名糖産業	3,900	1,271.00	4,956,900
井村屋グループ	3,600	2,068.00	7,444,800
不二家	4,500	1,988.00	8,946,000
山崎製パン	55,000	1,844.00	101,420,000
モロゾフ	1,600	4,685.00	7,496,000
亀田製菓	4,500	4,740.00	21,330,000
寿スピリッツ	7,600	6,470.00	49,172,000
カルビー	33,400	3,265.00	109,051,000
森永乳業	14,900	4,335.00	64,591,500
六甲バター	5,600	1,633.00	9,144,800
ヤクルト本社	53,900	6,030.00	325,017,000
明治ホールディングス	51,300	7,490.00	384,237,000
雪印メグミルク	17,900	2,447.00	43,801,300
プリマハム	10,000	2,165.00	21,650,000
日本ハム	30,200	4,175.00	126,085,000
丸大食品	7,000	2,135.00	14,945,000
S Foods	6,600	3,060.00	20,196,000
伊藤ハム米久ホールディングス	46,800	654.00	30,607,200
サッポロホールディングス	25,500	2,537.00	64,693,500
アサヒグループホールディングス	153,100	5,103.00	781,269,300
キリンホールディングス	309,700	2,095.00	648,821,500
宝ホールディングス	55,200	1,051.00	58,015,200
オエノンホールディングス	24,800	369.00	9,151,200
養命酒製造	3,200	1,900.00	6,080,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	51,300	2,368.00	121,478,400
サントリー食品インターナショナル	48,400	4,665.00	225,786,000
ダイドーグループホールディングス	4,000	4,385.00	17,540,000
伊藤園	22,200	4,935.00	109,557,000
キーコーヒー	7,200	2,150.00	15,480,000
日清オイリオグループ	9,300	3,340.00	31,062,000

不二製油グループ本社	18,100	2,966.00	53,684,600
かどや製油	1,000	3,525.00	3,525,000
J・オイルミルズ	3,700	4,040.00	14,948,000
キッコーマン	47,900	4,895.00	234,470,500
味の素	162,700	1,887.00	307,014,900
キューピー	40,800	2,513.00	102,530,400
ハウス食品グループ本社	27,300	3,925.00	107,152,500
カゴメ	29,600	2,711.00	80,245,600
焼津水産化学工業	5,700	1,042.00	5,939,400
アリアケジャパン	6,600	8,060.00	53,196,000
ニチレイ	37,900	2,381.00	90,239,900
東洋水産	37,300	4,355.00	162,441,500
イトアンド	3,800	1,722.00	6,543,600
日清食品ホールディングス	30,900	7,490.00	231,441,000
永谷園ホールディングス	4,600	2,073.00	9,535,800
一正蒲鉾	3,900	1,082.00	4,219,800
フジッコ	8,000	1,897.00	15,176,000
ロック・フィールド	7,000	1,371.00	9,597,000
日本たばこ産業	421,500	2,274.50	958,701,750
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,143.00	10,072,100
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,757.00	8,960,700
なとり	5,500	1,569.00	8,629,500
ピクルスコーポレーション	2,300	2,404.00	5,529,200
北の達人コーポレーション	25,600	731.00	18,713,600
ユーグレナ	31,100	885.00	27,523,500
ミヨシ油脂	4,300	1,100.00	4,730,000
理研ビタミン	3,000	3,435.00	10,305,000
片倉工業	10,000	1,213.00	12,130,000
ゲンゼ	4,900	4,450.00	21,805,000
東洋紡	31,700	1,418.00	44,950,600
ユニチカ	25,300	333.00	8,424,900
富士紡ホールディングス	4,300	2,692.00	11,575,600
倉敷紡績	6,900	2,109.00	14,552,100
シキボウ	6,300	924.00	5,821,200
日本毛織	23,800	932.00	22,181,600
ガイドーリミテッド	15,000	268.00	4,020,000
帝国繊維	8,400	1,710.00	14,364,000
帝人	56,900	1,995.00	113,515,500
東レ	554,600	777.80	431,367,880
住江織物	2,600	2,934.00	7,628,400
アツギ	8,700	815.00	7,090,500
ダイニック	6,200	700.00	4,340,000

セーレン	17,900	1,254.00	22,446,600
小松マテーレ	13,700	752.00	10,302,400
ワコールホールディングス	20,400	2,569.00	52,407,600
ホギメディカル	9,200	2,974.00	27,360,800
T S Iホールディングス	27,000	558.00	15,066,000
マツオカコーポレーション	3,000	2,029.00	6,087,000
ワールド	9,400	2,420.00	22,748,000
三陽商会	5,100	1,346.00	6,864,600
オンワードホールディングス	43,500	523.00	22,750,500
ルックホールディングス	3,000	1,034.00	3,102,000
ゴールドウイン	6,500	16,450.00	106,925,000
デサント	17,600	1,449.00	25,502,400
特種東海製紙	4,400	3,740.00	16,456,000
王子ホールディングス	317,200	511.00	162,089,200
日本製紙	34,300	1,824.00	62,563,200
三菱製紙	14,800	480.00	7,104,000
北越コーポレーション	46,900	555.00	26,029,500
中越パルプ工業	4,000	1,512.00	6,048,000
巴川製紙所	3,700	886.00	3,278,200
大王製紙	34,600	1,373.00	47,505,800
レンゴー	74,100	774.00	57,353,400
トモク	5,200	1,545.00	8,034,000
ザ・パック	5,400	3,435.00	18,549,000
クラレ	111,200	1,295.00	144,004,000
旭化成	506,800	1,014.00	513,895,200
昭和電工	50,600	2,988.00	151,192,800
住友化学	559,700	500.00	279,850,000
住友精化	3,500	3,420.00	11,970,000
日産化学	43,400	4,495.00	195,083,000
ラサ工業	3,600	1,243.00	4,474,800
クレハ	6,600	6,120.00	40,392,000
多木化学	2,200	4,815.00	10,593,000
テイカ	6,000	1,924.00	11,544,000
石原産業	14,300	922.00	13,184,600
日本曹達	11,400	2,561.00	29,195,400
東ソー	108,600	1,438.00	156,166,800
トクヤマ	21,000	2,379.00	49,959,000
セントラル硝子	16,300	2,318.00	37,783,400
東亜合成	45,600	1,111.00	50,661,600
大阪ソーダ	7,800	2,495.00	19,461,000
関東電化工業	17,700	745.00	13,186,500
デンカ	27,900	2,918.00	81,412,200

信越化学工業	125,700	11,285.00	1,418,524,500
日本カーバイド工業	3,200	1,221.00	3,907,200
堺化学工業	5,200	2,447.00	12,724,400
第一稀元素化学工業	8,400	837.00	7,030,800
エア・ウォーター	57,600	1,857.00	106,963,200
大陽日酸	58,700	2,075.00	121,802,500
日本化学工業	2,900	2,285.00	6,626,500
日本パーカラライジング	40,100	1,180.00	47,318,000
高压ガス工業	12,800	786.00	10,060,800
四国化成工業	12,300	1,081.00	13,296,300
戸田工業	2,200	2,072.00	4,558,400
ステラ ケミファ	4,600	2,670.00	12,282,000
保土谷化学工業	3,100	2,973.00	9,216,300
日本触媒	12,100	6,390.00	77,319,000
大日精化工業	6,000	2,967.00	17,802,000
カネカ	18,100	3,365.00	60,906,500
三菱瓦斯化学	72,100	1,360.00	98,056,000
三井化学	63,500	2,383.00	151,320,500
J S R	71,700	1,788.00	128,199,600
東京応化工業	12,600	4,000.00	50,400,000
大阪有機化学工業	8,300	976.00	8,100,800
三菱ケミカルホールディングス	474,000	804.10	381,143,400
K Hネオケム	11,000	2,188.00	24,068,000
ダイセル	105,700	874.00	92,381,800
住友ベークライト	12,600	4,085.00	51,471,000
積水化学工業	152,900	1,647.00	251,826,300
日本ゼオン	64,300	1,291.00	83,011,300
アイカ工業	21,700	3,080.00	66,836,000
宇部興産	35,600	2,174.00	77,394,400
積水樹脂	11,800	2,020.00	23,836,000
タキロンシーアイ	17,300	626.00	10,829,800
旭有機材	5,700	1,275.00	7,267,500
日立化成	33,000	3,425.00	113,025,000
ニチバン	4,300	1,548.00	6,656,400
リケンテクノス	21,800	471.00	10,267,800
大倉工業	4,300	1,578.00	6,785,400
積水化成成品工業	12,000	732.00	8,784,000
群栄化学工業	2,500	2,317.00	5,792,500
ダイキョーニシカワ	15,400	771.00	11,873,400
森六ホールディングス	4,400	2,511.00	11,048,400
日本化薬	44,900	1,241.00	55,720,900
カーリットホールディングス	9,500	571.00	5,424,500

日本精化	7,300	1,168.00	8,526,400
扶桑化学工業	7,200	2,316.00	16,675,200
トリケミカル研究所	1,800	6,230.00	11,214,000
A D E K A	35,700	1,324.00	47,266,800
日油	26,700	3,485.00	93,049,500
ハリマ化成グループ	6,500	1,219.00	7,923,500
花王	174,200	7,637.00	1,330,365,400
第一工業製薬	3,000	2,751.00	8,253,000
三洋化成工業	4,700	4,955.00	23,288,500
大日本塗料	9,300	1,075.00	9,997,500
日本ペイントホールディングス	58,600	5,140.00	301,204,000
関西ペイント	80,400	2,272.00	182,668,800
中国塗料	24,000	854.00	20,496,000
日本特殊塗料	6,900	1,051.00	7,251,900
藤倉化成	12,600	539.00	6,791,400
太陽ホールディングス	5,900	3,390.00	20,001,000
D I C	29,900	2,920.00	87,308,000
サカタインクス	16,000	1,073.00	17,168,000
東洋インキS Cホールディングス	13,900	2,330.00	32,387,000
T & K T O K A	6,600	941.00	6,210,600
富士フィルムホールディングス	150,900	4,678.00	705,910,200
資生堂	144,600	8,337.00	1,205,530,200
ライオン	94,600	2,010.00	190,146,000
高砂香料工業	5,200	2,639.00	13,722,800
マンダム	16,500	2,611.00	43,081,500
ミルボン	9,100	4,920.00	44,772,000
ファンケル	32,600	2,595.00	84,597,000
コーセー	12,300	17,960.00	220,908,000
コタ	4,800	1,165.00	5,592,000
ポーラ・オルビスホールディングス	31,100	2,462.00	76,568,200
ノエビアホールディングス	7,000	5,560.00	38,920,000
エステー	5,800	1,569.00	9,100,200
アグロ カネショウ	3,800	1,437.00	5,460,600
コニシ	13,100	1,493.00	19,558,300
長谷川香料	9,100	2,029.00	18,463,900
星光P M C	8,000	755.00	6,040,000
小林製薬	20,500	7,880.00	161,540,000
荒川化学工業	7,300	1,377.00	10,052,100
メック	6,900	1,384.00	9,549,600
タカラバイオ	19,100	2,234.00	42,669,400
J C U	9,800	1,911.00	18,727,800
デクセリアルズ	19,400	753.00	14,608,200

アース製薬	5,500	5,080.00	27,940,000
北興化学工業	10,500	472.00	4,956,000
大成ラミック	2,700	2,792.00	7,538,400
クミアイ化学工業	30,500	924.00	28,182,000
日本農薬	15,700	478.00	7,504,600
アキレス	5,900	1,689.00	9,965,100
有沢製作所	13,100	1,030.00	13,493,000
日東電工	50,200	5,310.00	266,562,000
レック	8,100	954.00	7,727,400
藤森工業	6,400	2,949.00	18,873,600
前澤化成工業	5,700	1,135.00	6,469,500
未来工業	4,700	1,876.00	8,817,200
J S P	4,800	1,783.00	8,558,400
エフピコ	8,000	6,610.00	52,880,000
天馬	5,600	1,952.00	10,931,200
信越ポリマー	14,000	752.00	10,528,000
東リ	24,400	248.00	6,051,200
ニフコ	29,100	2,536.00	73,797,600
バルカー	6,200	2,270.00	14,074,000
ユニ・チャーム	141,000	3,256.00	459,096,000
協和キリン	72,200	1,978.00	142,811,600
武田薬品工業	635,300	3,629.00	2,305,503,700
アステラス製薬	639,600	1,535.50	982,105,800
大日本住友製薬	54,300	1,826.00	99,151,800
塩野義製薬	92,800	5,783.00	536,662,400
田辺三菱製薬	74,800	1,223.00	91,480,400
あすか製薬	9,900	1,027.00	10,167,300
日本新薬	19,100	8,540.00	163,114,000
中外製薬	75,800	7,670.00	581,386,000
科研製薬	12,600	5,060.00	63,756,000
エーザイ	87,400	5,378.00	470,037,200
ロート製薬	37,500	2,690.00	100,875,000
小野薬品工業	172,500	1,961.00	338,272,500
久光製薬	21,500	4,480.00	96,320,000
持田製薬	11,200	4,025.00	45,080,000
参天製薬	135,400	1,814.00	245,615,600
扶桑薬品工業	3,800	1,904.00	7,235,200
日本ケミファ	1,800	2,795.00	5,031,000
ツムラ	23,100	2,966.00	68,514,600
日医工	18,700	1,213.00	22,683,100
キッセイ薬品工業	13,300	2,506.00	33,329,800
生化学工業	14,600	1,084.00	15,826,400

栄研化学	13,100	1,625.00	21,287,500
鳥居薬品	4,200	2,800.00	11,760,000
J C R ファーマ	5,200	7,430.00	38,636,000
東和薬品	10,500	2,414.00	25,347,000
富士製薬工業	5,300	1,301.00	6,895,300
沢井製薬	15,300	5,660.00	86,598,000
ゼリア新薬工業	14,700	1,884.00	27,694,800
第一三共	208,100	6,712.00	1,396,767,200
キョーリン製薬ホールディングス	16,700	1,754.00	29,291,800
大幸薬品	4,100	2,246.00	9,208,600
ダイト	4,200	2,841.00	11,932,200
大塚ホールディングス	138,500	4,460.00	617,710,000
大正製薬ホールディングス	15,100	7,440.00	112,344,000
ペプチドリーム	36,800	5,140.00	189,152,000
日本コークス工業	75,000	86.00	6,450,000
ニチレキ	10,100	1,041.00	10,514,100
ユシロ化学工業	4,800	1,324.00	6,355,200
富士石油	23,300	244.00	5,685,200
MORESCO	3,800	1,308.00	4,970,400
出光興産	83,400	3,060.00	255,204,000
J X T Gホールディングス	1,203,800	473.80	570,360,440
コスモエネルギーホールディングス	21,300	2,104.00	44,815,200
横浜ゴム	42,600	2,134.00	90,908,400
TOYO TIRE	38,900	1,381.00	53,720,900
ブリヂストン	224,000	4,116.00	921,984,000
住友ゴム工業	66,300	1,261.00	83,604,300
オカモト	5,200	4,055.00	21,086,000
ニッタ	8,100	2,832.00	22,939,200
住友理工	14,600	835.00	12,191,000
三ツ星ベルト	10,000	1,761.00	17,610,000
バンドー化学	15,200	862.00	13,102,400
日東紡績	11,000	3,120.00	34,320,000
A G C	71,500	3,255.00	232,732,500
日本板硝子	22,900	656.00	15,022,400
日本山村硝子	4,500	1,236.00	5,562,000
日本電気硝子	29,400	2,417.00	71,059,800
オハラ	4,100	1,488.00	6,100,800
住友大阪セメント	15,200	4,625.00	70,300,000
太平洋セメント	46,000	2,843.00	130,778,000
日本ヒューム	8,900	687.00	6,114,300
日本コンクリート工業	20,500	243.00	4,981,500
三谷セキサン	3,700	2,969.00	10,985,300



アジアパイルホールディングス	11,700	507.00	5,931,900
東海カーボン	76,500	1,119.00	85,603,500
日本カーボン	3,600	3,870.00	13,932,000
東洋炭素	4,600	2,223.00	10,225,800
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	3,955.00	17,402,000
TOTO	55,900	3,960.00	221,364,000
日本碍子	88,000	1,520.00	133,760,000
日本特殊陶業	61,500	1,968.00	121,032,000
MARUWA	2,600	6,560.00	17,056,000
品川リフラクトリーズ	2,200	2,633.00	5,792,600
黒崎播磨	1,600	5,610.00	8,976,000
ヨータイ	8,700	582.00	5,063,400
東京窯業	12,600	290.00	3,654,000
ニッカトー	5,100	665.00	3,391,500
フジインコーポレーテッド	6,700	2,496.00	16,723,200
ニチアス	20,100	1,841.00	37,004,100
ニチハ	10,200	2,838.00	28,947,600
日本製鉄	334,500	1,542.50	515,966,250
神戸製鋼所	132,400	591.00	78,248,400
中山製鋼所	13,000	442.00	5,746,000
合同製鐵	4,300	2,178.00	9,365,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	194,000	1,335.50	259,087,000
東京製鐵	38,800	835.00	32,398,000
共英製鋼	8,300	1,931.00	16,027,300
大和工業	15,700	2,724.00	42,766,800
東京鐵鋼	4,700	1,226.00	5,762,200
大阪製鐵	5,600	1,335.00	7,476,000
淀川製鋼所	9,100	1,874.00	17,053,400
丸一鋼管	25,700	2,690.00	69,133,000
モリ工業	2,700	1,841.00	4,970,700
大同特殊鋼	11,900	4,295.00	51,110,500
日本冶金工業	62,700	232.00	14,546,400
山陽特殊製鋼	9,400	1,455.00	13,677,000
愛知製鋼	4,000	3,200.00	12,800,000
日立金属	77,100	1,217.00	93,830,700
大平洋金属	5,200	2,245.00	11,674,000
新日本電工	50,200	167.00	8,383,400
栗本鐵工所	4,600	1,455.00	6,693,000
三菱製鋼	6,300	1,122.00	7,068,600
シンニッタン	14,700	448.00	6,585,600
大紀アルミニウム工業所	11,500	739.00	8,498,500
日本輕金属ホールディングス	199,600	194.00	38,722,400

三井金属鉱業	19,100	2,433.00	46,470,300
東邦亜鉛	4,600	2,035.00	9,361,000
三菱マテリアル	47,100	2,739.00	129,006,900
住友金属鉱山	98,900	3,334.00	329,732,600
D O W Aホールディングス	16,700	3,510.00	58,617,000
古河機械金属	12,100	1,391.00	16,831,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,700	1,665.00	14,485,500
東邦チタニウム	13,400	818.00	10,961,200
U A C J	10,800	1,762.00	19,029,600
C Kサンエツ	1,800	2,839.00	5,110,200
古河電気工業	20,300	2,488.00	50,506,400
住友電気工業	267,800	1,335.50	357,646,900
フジクラ	90,900	379.00	34,451,100
昭和電線ホールディングス	10,000	799.00	7,990,000
タツタ電線	16,300	463.00	7,546,900
平河ヒューテック	4,000	1,080.00	4,320,000
リョービ	9,000	1,709.00	15,381,000
アーレスティ	11,000	548.00	6,028,000
アサヒホールディングス	13,500	2,311.00	31,198,500
稲葉製作所	5,700	1,399.00	7,974,300
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,518.00	5,009,400
トーカロ	18,800	867.00	16,299,600
アルファC o	4,300	1,173.00	5,043,900
S U M C O	86,700	1,469.00	127,362,300
川田テクノロジーズ	1,700	6,420.00	10,914,000
R S Technologies	2,200	3,405.00	7,491,000
東洋製罐グループホールディングス	45,500	1,634.00	74,347,000
ホッカンホールディングス	4,800	1,497.00	7,185,600
コロナ	5,900	1,024.00	6,041,600
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,571.00	21,679,800
三和ホールディングス	74,200	1,205.00	89,411,000
文化シャッター	22,000	910.00	20,020,000
三協立山	10,500	1,173.00	12,316,500
アルインコ	8,900	931.00	8,285,900
L I X I Lグループ	106,500	1,781.00	189,676,500
ノーリツ	15,500	1,248.00	19,344,000
長府製作所	7,200	2,249.00	16,192,800
リンナイ	13,000	7,000.00	91,000,000
日東精工	14,000	539.00	7,546,000
岡部	15,200	828.00	12,585,600
ジーテクト	8,000	1,625.00	13,000,000
東プレ	13,000	1,712.00	22,256,000

高周波熱錬	14,600	838.00	12,234,800
東京製鋼	7,000	934.00	6,538,000
パイオラックス	11,400	1,847.00	21,055,800
エイチワン	9,300	659.00	6,128,700
日本発條	72,200	819.00	59,131,800
三益半導体工業	6,200	1,818.00	11,271,600
日本製鋼所	22,500	2,117.00	47,632,500
三浦工業	31,400	3,120.00	97,968,000
タクマ	26,800	1,210.00	32,428,000
ツガミ	16,900	964.00	16,291,600
オークマ	9,200	5,670.00	52,164,000
東芝機械	8,200	2,234.00	18,318,800
アマダホールディングス	106,900	1,171.00	125,179,900
アイダエンジニアリング	19,500	838.00	16,341,000
F U J I	27,300	1,550.00	42,315,000
牧野フライス製作所	8,300	4,715.00	39,134,500
オーエスジー	33,900	2,160.00	73,224,000
旭ダイヤモンド工業	19,600	645.00	12,642,000
D M G 森精機	45,900	1,554.00	71,328,600
ソディック	16,100	784.00	12,622,400
ディスコ	9,700	19,740.00	191,478,000
日東工器	4,400	2,110.00	9,284,000
日進工具	2,400	1,924.00	4,617,600
豊和工業	5,300	754.00	3,996,200
津田駒工業	2,200	1,307.00	2,875,400
島精機製作所	10,000	2,555.00	25,550,000
オプトラン	7,200	3,210.00	23,112,000
フリー	7,600	936.00	7,113,600
ヤマシンフィルタ	13,200	713.00	9,411,600
日阪製作所	10,500	854.00	8,967,000
やまびこ	14,400	1,045.00	15,048,000
平田機工	3,400	6,690.00	22,746,000
ペガサスミシン製造	8,600	497.00	4,274,200
ナプテスコ	42,500	3,290.00	139,825,000
三井海洋開発	7,900	2,596.00	20,508,400
レオン自動機	7,300	1,532.00	11,183,600
S M C	21,300	44,560.00	949,128,000
ホソカワミクロン	2,600	3,840.00	9,984,000
ユニオンツール	2,600	3,230.00	8,398,000
オイレス工業	10,000	1,589.00	15,890,000
日精エー・エス・ビー機械	2,600	3,360.00	8,736,000
サトーホールディングス	8,900	2,739.00	24,377,100

技研製作所	6,200	3,435.00	21,297,000
日精樹脂工業	7,300	1,000.00	7,300,000
オカダアイヨン	3,200	1,150.00	3,680,000
小松製作所	329,100	2,414.00	794,447,400
住友重機械工業	41,000	3,265.00	133,865,000
日立建機	28,700	2,474.00	71,003,800
日工	2,800	3,175.00	8,890,000
巴工業	3,700	2,329.00	8,617,300
井関農機	7,900	1,415.00	11,178,500
TOWA	7,800	771.00	6,013,800
北川鉄工所	3,800	1,968.00	7,478,400
ローツェ	3,500	2,314.00	8,099,000
クボタ	389,900	1,570.50	612,337,950
荏原実業	3,500	2,082.00	7,287,000
三菱化工機	3,900	1,773.00	6,914,700
月島機械	15,000	1,328.00	19,920,000
帝国電機製作所	6,000	1,151.00	6,906,000
新東工業	17,600	930.00	16,368,000
澁谷工業	6,500	2,727.00	17,725,500
アイチ コーポレーション	14,200	667.00	9,471,400
小森コーポレーション	18,500	1,115.00	20,627,500
鶴見製作所	6,000	1,994.00	11,964,000
住友精密工業	2,000	2,957.00	5,914,000
酒井重工業	2,000	2,679.00	5,358,000
荏原製作所	32,600	2,680.00	87,368,000
西島製作所	9,800	1,028.00	10,074,400
北越工業	8,100	1,220.00	9,882,000
ダイキン工業	99,200	13,750.00	1,364,000,000
オルガノ	3,100	4,515.00	13,996,500
トーヨーカネツ	3,300	1,828.00	6,032,400
栗田工業	39,300	2,877.00	113,066,100
椿本チエイン	9,000	3,385.00	30,465,000
大同工業	6,000	810.00	4,860,000
アネスト岩田	12,800	903.00	11,558,400
ダイフク	39,700	5,270.00	209,219,000
加藤製作所	4,200	1,832.00	7,694,400
タダノ	36,300	1,011.00	36,699,300
フジテック	26,200	1,304.00	34,164,800
C K D	20,600	1,258.00	25,914,800
キトー	6,100	1,538.00	9,381,800
平和	20,400	2,101.00	42,860,400
理想科学工業	6,800	1,713.00	11,648,400

SANKYO	18,600	3,685.00	68,541,000
日本金銭機械	9,400	936.00	8,798,400
マースグループホールディングス	5,200	1,873.00	9,739,600
福島工業	4,600	3,075.00	14,145,000
ダイコク電機	4,300	1,524.00	6,553,200
竹内製作所	12,100	1,666.00	20,158,600
アマノ	20,900	3,210.00	67,089,000
JUKI	10,600	896.00	9,497,600
蛇の目ミシン工業	10,400	394.00	4,097,600
マックス	11,400	1,765.00	20,121,000
グローリー	20,700	3,015.00	62,410,500
新晃工業	7,400	1,709.00	12,646,600
大和冷機工業	10,800	1,072.00	11,577,600
セガサミーホールディングス	73,400	1,491.00	109,439,400
日本ピストンリング	3,800	1,293.00	4,913,400
リケン	3,400	3,700.00	12,580,000
T P R	9,700	1,759.00	17,062,300
ツバキ・ナカシマ	15,400	1,670.00	25,718,000
ホシザキ	21,400	7,780.00	166,492,000
大豊工業	6,900	800.00	5,520,000
日本精工	146,800	966.00	141,808,800
NTN	156,600	317.00	49,642,200
ジェイテクト	67,800	1,262.00	85,563,600
不二越	7,000	4,590.00	32,130,000
日本トムソン	23,600	461.00	10,879,600
THK	42,300	2,800.00	118,440,000
ユーシン精機	6,300	1,025.00	6,457,500
前澤給装工業	4,100	1,957.00	8,023,700
イーグル工業	9,700	1,025.00	9,942,500
日本ピラー工業	8,300	1,194.00	9,910,200
キッツ	30,000	707.00	21,210,000
マキタ	88,300	3,275.00	289,182,500
日立造船	57,100	339.00	19,356,900
三菱重工業	122,200	4,201.00	513,362,200
I H I	56,400	2,336.00	131,750,400
スター精密	12,400	1,554.00	19,269,600
日清紡ホールディングス	46,900	842.00	39,489,800
イビデン	45,200	2,104.00	95,100,800
コニカミノルタ	158,900	780.00	123,942,000
ブラザー工業	93,900	1,907.00	179,067,300
ミネベアミツミ	134,300	1,815.00	243,754,500
日立製作所	327,200	3,989.00	1,305,200,800

三菱電機	728,100	1,379.00	1,004,049,900
富士電機	47,100	3,260.00	153,546,000
東洋電機製造	4,400	1,517.00	6,674,800
安川電機	84,200	3,870.00	325,854,000
シンフォニアテクノロジー	10,500	1,214.00	12,747,000
明電舎	14,700	1,833.00	26,945,100
オリジン	3,200	1,402.00	4,486,400
山洋電気	3,600	4,640.00	16,704,000
デンヨー	7,700	1,647.00	12,681,900
東芝テック	9,100	3,120.00	28,392,000
芝浦メカトロニクス	1,700	2,918.00	4,960,600
マブチモーター	19,800	3,960.00	78,408,000
日本電産	87,500	14,290.00	1,250,375,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,200	790.00	4,108,000
トレックス・セミコンダクター	4,100	1,173.00	4,809,300
東光高岳	4,600	1,116.00	5,133,600
ダイヘン	8,200	3,185.00	26,117,000
ヤーマン	11,200	826.00	9,251,200
JVCケンウッド	57,500	306.00	17,595,000
ミマキエンジニアリング	7,700	513.00	3,950,100
第一精工	3,900	2,341.00	9,129,900
日新電機	17,300	1,304.00	22,559,200
大崎電気工業	16,200	658.00	10,659,600
オムロン	77,200	5,810.00	448,532,000
日東工業	12,100	2,014.00	24,369,400
I D E C	9,800	1,891.00	18,531,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,900	1,846.00	49,657,400
サクサホールディングス	2,700	1,775.00	4,792,500
メルコホールディングス	3,200	2,695.00	8,624,000
日本電気	94,100	4,470.00	420,627,000
富士通	70,200	8,448.00	593,049,600
沖電気工業	32,800	1,447.00	47,461,600
電気興業	4,100	2,918.00	11,963,800
サンケン電気	8,300	2,035.00	16,890,500
アイホン	5,400	1,588.00	8,575,200
ルネサスエレクトロニクス	345,900	678.00	234,520,200
セイコーエプソン	89,400	1,511.00	135,083,400
ワコム	53,300	347.00	18,495,100
アルバック	14,700	4,405.00	64,753,500
E I Z O	6,800	3,660.00	24,888,000
日本信号	18,800	1,192.00	22,409,600
京三製作所	18,500	357.00	6,604,500

能美防災	9,900	2,116.00	20,948,400
ホーチキ	5,500	1,400.00	7,700,000
エレコム	6,900	4,175.00	28,807,500
パナソニック	830,400	881.40	731,914,560
シャープ	72,700	1,226.00	89,130,200
アンリツ	47,000	1,897.00	89,159,000
富士通ゼネラル	23,200	1,759.00	40,808,800
ソニー	488,100	6,369.00	3,108,708,900
T D K	37,900	9,280.00	351,712,000
帝国通信工業	5,400	1,100.00	5,940,000
タムラ製作所	28,600	575.00	16,445,000
アルプスアルパイン	75,800	1,934.00	146,597,200
日本トリム	1,600	4,450.00	7,120,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	1,995.00	8,578,500
フォスター電機	8,000	1,857.00	14,856,000
S M K	2,600	2,754.00	7,160,400
ヨコオ	5,500	2,784.00	15,312,000
ホシデン	21,900	1,033.00	22,622,700
ヒロセ電機	10,400	13,370.00	139,048,000
日本航空電子工業	16,800	1,499.00	25,183,200
T O A	8,600	1,223.00	10,517,800
マクセルホールディングス	15,800	1,556.00	24,584,800
古野電気	10,100	942.00	9,514,200
ユニデンホールディングス	2,900	1,791.00	5,193,900
スミダコーポレーション	7,000	1,014.00	7,098,000
アイコム	4,700	2,164.00	10,170,800
リオン	4,000	2,202.00	8,808,000
本多通信工業	8,300	479.00	3,975,700
船井電機	10,700	549.00	5,874,300
横河電機	73,000	1,970.00	143,810,000
新電元工業	3,100	3,305.00	10,245,500
アズビル	45,700	2,835.00	129,559,500
東亜ディーケーケー	5,100	831.00	4,238,100
日本光電工業	32,800	2,937.00	96,333,600
チノー	4,500	1,361.00	6,124,500
共和電業	15,800	410.00	6,478,000
堀場製作所	14,600	5,980.00	87,308,000
アドバンテスト	49,700	4,410.00	219,177,000
エスベック	6,700	1,878.00	12,582,600
キーエンス	35,700	65,070.00	2,322,999,000
日置電機	4,000	3,320.00	13,280,000
シスメックス	57,000	6,844.00	390,108,000

日本マイクロニクス	13,400	860.00	11,524,000
メガチップス	6,300	1,617.00	10,187,100
O B A R A G R O U P	3,600	3,635.00	13,086,000
コーセル	11,200	1,081.00	12,107,200
イリソ電子工業	6,800	4,945.00	33,626,000
オブテックスグループ	12,200	1,557.00	18,995,400
千代田インテグレ	3,600	2,053.00	7,390,800
アイ・オー・データ機器	4,300	883.00	3,796,900
レーザーテック	14,900	6,310.00	94,019,000
スタンレー電気	51,200	2,722.00	139,366,400
岩崎電気	4,700	1,180.00	5,546,000
ウシオ電機	43,100	1,513.00	65,210,300
ハリオス テクノ ホールディング	8,800	549.00	4,831,200
日本セラミック	7,300	2,740.00	20,002,000
古河電池	6,800	585.00	3,978,000
山一電機	5,800	1,195.00	6,931,000
図研	5,400	1,857.00	10,027,800
日本電子	14,700	2,417.00	35,529,900
カシオ計算機	65,300	1,579.00	103,108,700
ファナック	69,100	19,470.00	1,345,377,000
日本シイエムケイ	19,400	562.00	10,902,800
エンプラス	3,700	3,345.00	12,376,500
ローム	34,700	8,280.00	287,316,000
浜松ホトニクス	52,000	3,755.00	195,260,000
三井ハイテック	8,700	1,386.00	12,058,200
新光電気工業	24,300	889.00	21,602,700
京セラ	111,000	6,681.00	741,591,000
太陽誘電	32,700	2,260.00	73,902,000
村田製作所	228,900	4,867.00	1,114,056,300
双葉電子工業	12,100	1,318.00	15,947,800
ニチコン	23,800	925.00	22,015,000
日本ケミコン	5,400	1,469.00	7,932,600
K O A	11,500	1,312.00	15,088,000
市光工業	11,700	834.00	9,757,800
小糸製作所	43,100	5,150.00	221,965,000
ミツバ	14,300	579.00	8,279,700
S C R E E Nホールディングス	12,800	6,310.00	80,768,000
キャノン電子	6,800	1,812.00	12,321,600
キャノン	391,700	2,858.00	1,119,478,600
リコー	218,500	1,004.00	219,374,000
象印マホービン	17,700	1,369.00	24,231,300
東京エレクトロン	48,500	20,375.00	988,187,500



トヨタ紡織	24,800	1,497.00	37,125,600	
ユニプレス	14,100	1,767.00	24,914,700	
豊田自動織機	58,900	6,090.00	358,701,000	
モリタホールディングス	12,900	1,680.00	21,672,000	
三櫻工業	11,900	527.00	6,271,300	
デンソー	160,400	4,659.00	747,303,600	
東海理化電機製作所	19,100	1,796.00	34,303,600	
三井E & Sホールディングス	25,700	892.00	22,924,400	
川崎重工業	56,600	2,260.00	127,916,000	
名村造船所	25,400	264.00	6,705,600	
日本車輛製造	3,300	2,379.00	7,850,700	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,110.00	10,212,000	
日産自動車	857,700	697.50	598,245,750	
いすゞ自動車	229,500	1,195.00	274,252,500	
トヨタ自動車	811,200	7,183.00	5,826,849,600	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,200	908.00	81,901,600	
三菱自動車工業	269,200	482.00	129,754,400	
エフテック	6,700	706.00	4,730,200	
武蔵精密工業	17,900	1,318.00	23,592,200	
日産車体	14,200	933.00	13,248,600	
新明和工業	30,400	1,328.00	40,371,200	
極東開発工業	14,900	1,229.00	18,312,100	
日信工業	13,200	1,424.00	18,796,800	
トピー工業	6,000	1,974.00	11,844,000	
ティラド	3,500	1,799.00	6,296,500	
タチエス	12,000	1,258.00	15,096,000	
N O K	39,000	1,588.00	61,932,000	
フタバ産業	21,300	732.00	15,591,600	
K Y B	7,400	3,025.00	22,385,000	
大同メタル工業	13,900	638.00	8,868,200	
プレス工業	37,100	473.00	17,548,300	
ミクニ	12,500	314.00	3,925,000	
太平洋工業	15,500	1,516.00	23,498,000	
ケーヒン	16,500	1,597.00	26,350,500	
河西工業	9,900	792.00	7,840,800	
アイシン精機	59,400	3,455.00	205,227,000	
マツダ	228,800	974.80	223,034,240	
今仙電機製作所	8,800	866.00	7,620,800	
本田技研工業	613,900	2,791.00	1,713,394,900	
スズキ	133,500	4,221.00	563,503,500	
S U B A R U	226,300	3,014.00	682,068,200	
安永	4,100	1,311.00	5,375,100	

ヤマハ発動機	94,200	1,865.00	175,683,000
ショーワ	17,100	1,424.00	24,350,400
T B K	16,500	396.00	6,534,000
エクセディ	9,700	2,092.00	20,292,400
豊田合成	23,500	2,118.00	49,773,000
愛三工業	12,900	790.00	10,191,000
日本プラスト	7,800	691.00	5,389,800
ヨロズ	7,900	1,290.00	10,191,000
エフ・シー・シー	13,100	2,031.00	26,606,100
シマノ	27,200	15,730.00	427,856,000
テイ・エス テック	17,000	3,080.00	52,360,000
ジャムコ	4,000	1,482.00	5,928,000
テルモ	205,700	3,101.00	637,875,700
日機装	22,500	1,151.00	25,897,500
島津製作所	92,900	2,662.00	247,299,800
J M S	10,000	624.00	6,240,000
長野計器	7,400	703.00	5,202,200
ブイ・テクノロジー	3,400	5,420.00	18,428,000
東京計器	6,000	882.00	5,292,000
インターアクション	4,300	1,979.00	8,509,700
東京精密	13,200	3,165.00	41,778,000
マニー	28,500	2,462.00	70,167,000
ニコン	126,400	1,382.00	174,684,800
トプコン	39,700	1,400.00	55,580,000
オリンパス	433,100	1,395.00	604,174,500
理研計器	6,400	1,945.00	12,448,000
タムロン	6,300	2,254.00	14,200,200
H O Y A	146,500	8,962.00	1,312,933,000
シード	3,700	874.00	3,233,800
ノーリツ鋼機	6,100	1,897.00	11,571,700
エー・アンド・デイ	7,900	711.00	5,616,900
朝日インテック	61,800	2,430.00	150,174,000
シチズン時計	81,400	533.00	43,386,200
リズム時計工業	3,500	899.00	3,146,500
メニコン	9,900	3,835.00	37,966,500
松風	5,100	1,485.00	7,573,500
セイコーホールディングス	11,100	2,307.00	25,607,700
ニプロ	51,700	1,167.00	60,333,900
スノーピーク	3,600	1,289.00	4,640,400
パラマウントベッドホールディングス	8,300	4,050.00	33,615,000
トランザクション	5,100	1,039.00	5,298,900
ニホンフラッシュ	3,600	2,365.00	8,514,000

前田工織	8,200	1,421.00	11,652,200
永大産業	14,700	323.00	4,748,100
アートネイチャー	10,700	645.00	6,901,500
バンダイナムコホールディングス	75,300	6,190.00	466,107,000
S H O E I	3,700	4,480.00	16,576,000
フランスベッドホールディングス	12,800	1,011.00	12,940,800
パイロットコーポレーション	13,000	3,730.00	48,490,000
萩原工業	4,700	1,447.00	6,800,900
トッパン・フォームズ	15,300	928.00	14,198,400
フジシールインターナショナル	16,400	2,773.00	45,477,200
タカラトミー	31,000	1,133.00	35,123,000
廣済堂	10,100	699.00	7,059,900
プロネクサス	7,900	1,062.00	8,389,800
大建工業	5,800	1,877.00	10,886,600
凸版印刷	106,000	1,821.00	193,026,000
大日本印刷	102,000	2,435.00	248,370,000
共同印刷	3,000	2,647.00	7,941,000
N I S S H A	15,400	981.00	15,107,400
宝印刷	5,100	1,622.00	8,272,200
アシックス	60,100	1,521.00	91,412,100
ヤマハ	43,100	4,645.00	200,199,500
河合楽器製作所	2,600	2,873.00	7,469,800
クリナップ	9,500	572.00	5,434,000
ピジョン	44,400	4,220.00	187,368,000
キングジム	8,800	855.00	7,524,000
リンテック	17,700	2,117.00	37,470,900
イトーキ	15,800	417.00	6,588,600
任天堂	41,700	41,660.00	1,737,222,000
三菱鉛筆	12,000	1,703.00	20,436,000
タカラスタンダード	14,600	1,668.00	24,352,800
コクヨ	35,600	1,440.00	51,264,000
ナカバヤシ	10,000	513.00	5,130,000
グローブライド	3,900	2,852.00	11,122,800
オカムラ	25,400	1,088.00	27,635,200
美津濃	7,400	2,642.00	19,550,800
東京電力ホールディングス	576,400	511.00	294,540,400
中部電力	222,300	1,507.00	335,006,100
関西電力	297,300	1,278.50	380,098,050
中国電力	101,000	1,352.00	136,552,000
北陸電力	71,100	672.00	47,779,200
東北電力	169,500	1,041.00	176,449,500
四国電力	66,700	1,013.00	67,567,100

九州電力	147,500	1,015.00	149,712,500
北海道電力	70,100	569.00	39,886,900
沖縄電力	13,300	1,636.00	21,758,800
電源開発	57,500	2,429.00	139,667,500
エフオン	5,800	720.00	4,176,000
イーレックス	12,400	1,069.00	13,255,600
レノバ	13,700	839.00	11,494,300
東京瓦斯	143,300	2,581.00	369,857,300
大阪瓦斯	139,500	1,885.00	262,957,500
東邦瓦斯	35,900	3,885.00	139,471,500
北海道瓦斯	5,400	1,496.00	8,078,400
広島ガス	21,900	330.00	7,227,000
西部瓦斯	8,000	2,253.00	18,024,000
静岡ガス	21,400	849.00	18,168,600
メタウォーター	3,900	3,565.00	13,903,500
SBSホールディングス	7,400	1,501.00	11,107,400
東武鉄道	75,600	3,345.00	252,882,000
相鉄ホールディングス	25,300	2,810.00	71,093,000
東急	197,600	1,899.00	375,242,400
京浜急行電鉄	99,800	1,921.00	191,715,800
小田急電鉄	115,600	2,402.00	277,671,200
京王電鉄	40,400	6,370.00	257,348,000
京成電鉄	54,000	4,125.00	222,750,000
富士急行	10,000	4,385.00	43,850,000
新京成電鉄	3,600	2,022.00	7,279,200
東日本旅客鉄道	129,400	9,989.00	1,292,576,600
西日本旅客鉄道	65,400	9,049.00	591,804,600
東海旅客鉄道	65,100	20,785.00	1,353,103,500
西武ホールディングス	90,800	1,819.00	165,165,200
鴻池運輸	11,200	1,656.00	18,547,200
西日本鉄道	20,900	2,400.00	50,160,000
ハマキョウレックス	5,700	3,590.00	20,463,000
サカイ引越センター	3,900	6,040.00	23,556,000
近鉄グループホールディングス	68,200	5,270.00	359,414,000
阪急阪神ホールディングス	92,000	4,085.00	375,820,000
南海電気鉄道	31,400	2,711.00	85,125,400
京阪ホールディングス	30,700	4,495.00	137,996,500
神戸電鉄	2,700	3,985.00	10,759,500
名古屋鉄道	56,000	3,180.00	178,080,000
山陽電気鉄道	6,000	2,126.00	12,756,000
日本通運	26,300	5,660.00	148,858,000
ヤマトホールディングス	122,100	1,864.00	227,594,400

山九	19,100	5,320.00	101,612,000
丸全昭和運輸	5,900	3,050.00	17,995,000
センコーグループホールディングス	37,700	839.00	31,630,300
トナミホールディングス	1,800	4,605.00	8,289,000
ニッコンホールディングス	26,200	2,423.00	63,482,600
福山通運	8,800	3,735.00	32,868,000
セイノーホールディングス	51,600	1,381.00	71,259,600
神奈川中央交通	2,500	3,825.00	9,562,500
日立物流	14,600	3,235.00	47,231,000
丸和運輸機関	3,600	5,090.00	18,324,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,193.00	10,259,800
九州旅客鉄道	58,000	3,225.00	187,050,000
S Gホールディングス	65,100	2,821.00	183,647,100
日本郵船	58,700	1,771.00	103,957,700
商船三井	41,400	2,808.00	116,251,200
川崎汽船	15,400	1,285.00	19,789,000
N S ユナイテッド海運	4,400	2,329.00	10,247,600
飯野海運	35,500	338.00	11,999,000
乾汽船	8,400	951.00	7,988,400
日本航空	126,400	3,408.00	430,771,200
A N Aホールディングス	126,100	3,640.00	459,004,000
トランコム	2,000	5,840.00	11,680,000
日新	6,500	1,469.00	9,548,500
三菱倉庫	24,300	2,673.00	64,953,900
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,632.00	14,035,200
住友倉庫	24,300	1,417.00	34,433,100
澁澤倉庫	5,500	1,897.00	10,433,500
東陽倉庫	20,300	305.00	6,191,500
日本トランスシティ	19,500	450.00	8,775,000
川西倉庫	2,800	1,049.00	2,937,200
安田倉庫	8,700	915.00	7,960,500
東洋埠頭	3,800	1,318.00	5,008,400
上組	42,800	2,470.00	105,716,000
キューソー流通システム	2,300	1,788.00	4,112,400
近鉄エクスプレス	12,800	1,487.00	19,033,600
エーアイティー	5,700	915.00	5,215,500
N E C ネットズエスアイ	7,900	2,803.00	22,143,700
システナ	25,500	1,492.00	38,046,000
デジタルアーツ	3,900	7,260.00	28,314,000
日鉄ソリューションズ	10,500	3,565.00	37,432,500
キューブシステム	6,800	770.00	5,236,000
コア	4,400	1,323.00	5,821,200

ソリトンシステムズ	5,200	1,025.00	5,330,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,400	1,704.00	7,497,600
T I S	23,800	6,240.00	148,512,000
ネオス	4,300	749.00	3,220,700
電算システム	3,500	2,920.00	10,220,000
グリー	49,700	475.00	23,607,500
コーエーテクモホールディングス	14,800	2,226.00	32,944,800
三菱総合研究所	3,300	3,480.00	11,484,000
ファインデックス	8,100	998.00	8,083,800
ブレインパッド	1,500	6,760.00	10,140,000
K L a b	13,400	1,244.00	16,669,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,300	997.00	10,269,100
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,763.00	2,997,100
ネクソン	202,600	1,401.00	283,842,600
アイスタイル	18,900	715.00	13,513,500
エムアップ	2,700	1,902.00	5,135,400
エイチーム	5,300	1,120.00	5,936,000
エニグモ	5,600	1,200.00	6,720,000
テクノスジャパン	7,300	505.00	3,686,500
コロプラ	24,600	684.00	16,826,400
ブロードリーフ	37,200	557.00	20,720,400
デジタルハーツホールディングス	4,300	931.00	4,003,300
システム情報	4,300	1,023.00	4,398,900
メディアドゥホールディングス	2,700	3,580.00	9,666,000
じげん	10,900	575.00	6,267,500
フィックスターズ	7,500	1,538.00	11,535,000
C A R T A H O L D I N G S	4,800	989.00	4,747,200
オブティム	3,700	2,781.00	10,289,700
セレス	2,800	1,274.00	3,567,200
ティーガイア	4,900	2,176.00	10,662,400
セック	1,400	3,065.00	4,291,000
豆蔵ホールディングス	6,500	1,628.00	10,582,000
テクマトリックス	5,500	2,277.00	12,523,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,700	2,310.00	40,887,000
G M O ペイメントゲートウェイ	11,800	7,820.00	92,276,000
インターネットイニシアティブ	12,000	2,433.00	29,196,000
さくらインターネット	11,000	605.00	6,655,000
ヴィンクス	3,000	1,244.00	3,732,000
G M O クラウド	2,000	2,568.00	5,136,000
S R A ホールディングス	4,300	2,537.00	10,909,100
e B A S E	5,800	1,006.00	5,834,800
アバント	3,100	1,924.00	5,964,400

アドソル日進	3,000	2,078.00	6,234,000
フリービット	5,800	1,132.00	6,565,600
コムチュア	4,200	3,825.00	16,065,000
アステリア	5,100	612.00	3,121,200
マークラインズ	3,900	1,814.00	7,074,600
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,059.00	7,413,000
g u m i	10,200	649.00	6,619,800
モバイルファクトリー	2,700	1,610.00	4,347,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,542.00	5,551,200
P C Iホールディングス	1,800	2,056.00	3,700,800
ダブルスタンダード	800	4,420.00	3,536,000
オープンドア	3,900	2,166.00	8,447,400
アカツキ	2,600	7,100.00	18,460,000
U b i c o mホールディングス	1,800	1,564.00	2,815,200
L I N E	16,600	4,075.00	67,645,000
チェンジ	1,500	2,114.00	3,171,000
オークネット	5,200	1,258.00	6,541,600
A O I T Y O H o l d i n g s	8,700	634.00	5,515,800
マクロミル	12,600	948.00	11,944,800
オロ	2,200	2,669.00	5,871,800
フェイス	5,300	741.00	3,927,300
プロトコーポレーション	7,200	1,219.00	8,776,800
野村総合研究所	135,700	2,166.00	293,926,200
サイバネットシステム	8,000	610.00	4,880,000
インテージホールディングス	10,700	915.00	9,790,500
ソースネクスト	28,800	461.00	13,276,800
インフォコム	8,100	2,434.00	19,715,400
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,391.00	11,823,500
フォーカスシステムズ	6,000	833.00	4,998,000
クレスコ	2,500	3,375.00	8,437,500
フジ・メディア・ホールディングス	75,100	1,428.00	107,242,800
オービック	24,800	11,850.00	293,880,000
ジャストシステム	10,100	3,555.00	35,905,500
T D C ソフト	7,400	724.00	5,357,600
ヤフー	468,900	289.00	135,512,100
トレンドマイクロ	32,100	5,060.00	162,426,000
日本オラクル	14,400	9,060.00	130,464,000
アルファシステムズ	2,900	2,711.00	7,861,900
フューチャー	8,800	1,738.00	15,294,400
C A C H o l d i n g s	7,200	1,331.00	9,583,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	2,020.00	6,868,000
オービックビジネスコンサルタント	7,200	4,240.00	30,528,000

伊藤忠テクノソリューションズ	32,500	2,860.00	92,950,000
アイティフォー	10,300	842.00	8,672,600
大塚商会	38,600	3,945.00	152,277,000
サイボウズ	10,600	984.00	10,430,400
ソフトブレーン	7,800	580.00	4,524,000
電通国際情報サービス	4,600	3,370.00	15,502,000
デジタルガレージ	14,300	3,505.00	50,121,500
E Mシステムズ	7,200	1,907.00	13,730,400
ウェザーニューズ	3,000	3,190.00	9,570,000
C I J	9,000	821.00	7,389,000
WOWOW	3,600	2,558.00	9,208,800
スカラ	7,700	991.00	7,630,700
I M A G I C A G R O U P	7,400	468.00	3,463,200
ネットワンシステムズ	25,600	2,749.00	70,374,400
アルゴグラフィックス	6,300	2,572.00	16,203,600
マーベラス	12,200	806.00	9,833,200
エイベックス	12,800	1,263.00	16,166,400
日本ユニシス	22,200	3,225.00	71,595,000
兼松エレクトロニクス	4,000	2,996.00	11,984,000
東京放送ホールディングス	47,700	1,727.00	82,377,900
日本テレビホールディングス	66,000	1,395.00	92,070,000
朝日放送グループホールディングス	10,500	706.00	7,413,000
テレビ朝日ホールディングス	20,400	1,717.00	35,026,800
スカパーJ S A Tホールディングス	49,400	432.00	21,340,800
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,139.00	13,047,900
ビジョン	2,300	4,915.00	11,304,500
コネクシオ	6,000	1,380.00	8,280,000
日本電信電話	488,400	5,126.00	2,503,538,400
K D D I	584,800	2,796.00	1,635,100,800
ソフトバンク	757,700	1,502.50	1,138,444,250
光通信	8,400	24,110.00	202,524,000
N T T ドコモ	452,300	2,751.00	1,244,277,300
エムティーアイ	9,800	675.00	6,615,000
G M O インターネット	26,500	1,842.00	48,813,000
K A D O K A W A	21,500	1,510.00	32,465,000
学研ホールディングス	2,600	5,280.00	13,728,000
ゼンリン	14,500	1,835.00	26,607,500
アイネット	5,200	1,360.00	7,072,000
松竹	4,900	12,530.00	61,397,000
東宝	47,200	4,415.00	208,388,000
東映	3,000	15,000.00	45,000,000
エヌ・ティ・ティ・データ	188,700	1,374.00	259,273,800



ピー・シー・エー	1,200	3,730.00	4,476,000
D T S	15,700	2,209.00	34,681,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,600	4,125.00	138,600,000
シーイーシー	7,700	2,232.00	17,186,400
カブコン	31,600	2,709.00	85,604,400
アイ・エス・ピー	2,200	1,516.00	3,335,200
ジャステック	5,800	1,066.00	6,182,800
S C S K	19,000	5,130.00	97,470,000
日本システムウエア	2,800	2,411.00	6,750,800
アイネス	10,300	1,075.00	11,072,500
T K C	6,000	4,450.00	26,700,000
富士ソフト	9,200	4,510.00	41,492,000
N S D	11,600	3,070.00	35,612,000
コナミホールディングス	29,400	4,880.00	143,472,000
福井コンピュータホールディングス	3,100	2,144.00	6,646,400
J B C Cホールディングス	6,600	1,551.00	10,236,600
ミロク情報サービス	7,300	2,782.00	20,308,600
ソフトバンクグループ	566,500	4,711.00	2,668,781,500
伊藤忠食品	2,000	4,155.00	8,310,000
エレマテック	7,800	987.00	7,698,600
J A L U X	2,400	2,304.00	5,529,600
あらた	5,400	3,745.00	20,223,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,053.00	7,801,400
フィールズ	8,500	493.00	4,190,500
双日	389,900	343.00	133,735,700
アルフレッサ ホールディングス	78,800	2,432.00	191,641,600
横浜冷凍	20,200	1,034.00	20,886,800
ラクーンホールディングス	5,800	618.00	3,584,400
アルコニックス	8,700	1,216.00	10,579,200
神戸物産	12,300	5,020.00	61,746,000
あい ホールディングス	10,700	1,746.00	18,682,200
ダイワボウホールディングス	6,600	4,225.00	27,885,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,800	1,450.00	28,710,000
ラクト・ジャパン	3,000	3,545.00	10,635,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,035.00	14,490,000
八洲電機	9,000	886.00	7,974,000
レスターホールディングス	8,400	1,759.00	14,775,600
ジュテックホールディングス	2,900	940.00	2,726,000
T O K A Iホールディングス	37,300	1,012.00	37,747,600
三洋貿易	4,400	2,198.00	9,671,200
ウイン・パートナーズ	5,300	1,065.00	5,644,500
シップヘルスケアホールディングス	15,100	4,655.00	70,290,500

コメダホールディングス	17,300	1,954.00	33,804,200
小野建	7,100	1,330.00	9,443,000
佐島電機	7,300	784.00	5,723,200
伯東	5,900	1,156.00	6,820,400
コンドーテック	8,000	892.00	7,136,000
ナガイレーベン	10,800	2,170.00	23,436,000
三菱食品	7,000	2,607.00	18,249,000
松田産業	6,200	1,433.00	8,884,600
第一興商	11,000	4,785.00	52,635,000
メディバルホールディングス	76,700	2,350.00	180,245,000
S P K	1,800	2,424.00	4,363,200
萩原電気ホールディングス	3,200	2,726.00	8,723,200
アズワン	5,200	8,800.00	45,760,000
尾家産業	4,100	1,151.00	4,719,100
シモジマ	5,400	1,089.00	5,880,600
ドウシシャ	6,500	1,763.00	11,459,500
高速	6,200	1,241.00	7,694,200
丸文	9,000	568.00	5,112,000
ハピネット	6,700	1,274.00	8,535,800
日本ライフライン	21,000	1,720.00	36,120,000
エクセル	3,300	1,110.00	3,663,000
マルカ	3,200	1,976.00	6,323,200
I D O M	26,700	423.00	11,294,100
日本エム・ディ・エム	5,100	1,722.00	8,782,200
進和	4,800	2,117.00	10,161,600
ダイトロン	4,100	1,249.00	5,120,900
シークス	9,400	1,451.00	13,639,400
オーハシテクニカ	5,900	1,397.00	8,242,300
伊藤忠商事	501,100	2,232.50	1,118,705,750
丸紅	706,200	725.40	512,277,480
長瀬産業	40,200	1,507.00	60,581,400
蝶理	5,200	1,722.00	8,954,400
豊田通商	79,600	3,585.00	285,366,000
三共生興	18,000	495.00	8,910,000
兼松	27,700	1,235.00	34,209,500
三井物産	591,000	1,788.00	1,056,708,000
日本紙パルプ商事	4,200	3,835.00	16,107,000
日立ハイテクノロジーズ	21,900	5,910.00	129,429,000
カメイ	9,900	1,075.00	10,642,500
スターゼン	3,000	4,090.00	12,270,000
山善	26,900	949.00	25,528,100
椿本興業	2,200	3,390.00	7,458,000

住友商事	424,100	1,711.00	725,635,100
内田洋行	3,900	3,685.00	14,371,500
三菱商事	502,900	2,757.00	1,386,495,300
第一実業	3,500	2,876.00	10,066,000
キヤノンマーケティングジャパン	21,200	2,174.00	46,088,800
西華産業	4,800	1,291.00	6,196,800
佐藤商事	8,000	819.00	6,552,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,808.00	14,102,400
東京産業	10,100	478.00	4,827,800
ユアサ商事	7,200	3,120.00	22,464,000
神鋼商事	2,000	2,280.00	4,560,000
阪和興業	12,400	3,020.00	37,448,000
正栄食品工業	5,000	3,145.00	15,725,000
カナデン	7,900	1,279.00	10,104,100
菱電商事	6,900	1,613.00	11,129,700
フルサト工業	5,200	1,416.00	7,363,200
岩谷産業	16,400	3,570.00	58,548,000
極東貿易	3,400	1,743.00	5,926,200
イワキ	11,600	487.00	5,649,200
三愛石油	19,200	1,026.00	19,699,200
稲畑産業	16,100	1,317.00	21,203,700
ワキタ	16,400	1,068.00	17,515,200
東邦ホールディングス	21,400	2,493.00	53,350,200
サンゲツ	21,700	2,029.00	44,029,300
ミツウロコグループホールディングス	11,100	937.00	10,400,700
シナネンホールディングス	3,600	1,708.00	6,148,800
伊藤忠エネクス	15,100	845.00	12,759,500
サンリオ	22,100	2,047.00	45,238,700
サンワテクノス	5,700	794.00	4,525,800
リョーサン	7,900	2,702.00	21,345,800
新光商事	7,400	1,864.00	13,793,600
トーヨー	4,100	1,688.00	6,920,800
三信電気	5,700	1,494.00	8,515,800
東陽テクニカ	11,000	1,067.00	11,737,000
モスフードサービス	9,500	2,423.00	23,018,500
加賀電子	7,400	1,754.00	12,979,600
ソーダニッカ	11,200	525.00	5,880,000
立花エレテック	6,100	1,570.00	9,577,000
PALTAC	12,600	5,060.00	63,756,000
太平洋興発	6,600	759.00	5,009,400
西本Wismettacホールディングス	1,800	3,250.00	5,850,000
国際紙パルプ商事	18,100	306.00	5,538,600

ヤマタネ	4,800	1,322.00	6,345,600
日鉄物産	4,400	4,260.00	18,744,000
泉州電業	3,000	2,572.00	7,716,000
トラスコ中山	14,900	2,453.00	36,549,700
オートバックスセブン	29,200	1,798.00	52,501,600
モリト	7,700	761.00	5,859,700
加藤産業	10,800	3,185.00	34,398,000
イノテック	5,800	880.00	5,104,000
イエローハット	13,600	1,544.00	20,998,400
J Kホールディングス	10,000	524.00	5,240,000
日伝	6,500	1,957.00	12,720,500
杉本商事	4,800	2,056.00	9,868,800
因幡電機産業	9,900	4,700.00	46,530,000
東テク	3,000	2,004.00	6,012,000
ミスミグループ本社	89,700	2,490.00	223,353,000
タキヒヨー	2,000	1,741.00	3,482,000
スズケン	32,600	5,700.00	185,820,000
ジェコス	6,500	859.00	5,583,500
ローソン	18,500	5,560.00	102,860,000
サンエー	5,200	4,610.00	23,972,000
カワチ薬品	6,200	2,012.00	12,474,400
エービーシー・マート	11,200	6,890.00	77,168,000
アスクル	7,500	2,932.00	21,990,000
ゲオホールディングス	11,100	1,345.00	14,929,500
アダストリア	10,200	2,311.00	23,572,200
くら寿司	3,800	4,455.00	16,929,000
キャンドウ	5,100	1,625.00	8,287,500
パルグループホールディングス	4,100	3,295.00	13,509,500
エディオン	30,000	1,050.00	31,500,000
サーラコーポレーション	16,600	604.00	10,026,400
ハローズ	3,100	2,100.00	6,510,000
フジオフードシステム	3,300	2,712.00	8,949,600
あみやき亭	2,000	3,390.00	6,780,000
ひらまつ	20,500	338.00	6,929,000
大黒天物産	2,000	3,250.00	6,500,000
ハニーズホールディングス	7,800	1,468.00	11,450,400
アルペン	6,100	1,645.00	10,034,500
クオールホールディングス	10,900	1,442.00	15,717,800
ジズホールディングス	3,800	6,340.00	24,092,000
ビックカメラ	42,000	1,072.00	45,024,000
D C Mホールディングス	37,900	1,040.00	39,416,000
ペッパーフードサービス	6,200	1,584.00	9,820,800

MonotaRO	51,400	2,584.00	132,817,600
DDホールディングス	4,000	1,449.00	5,796,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	1,930.00	10,615,000
J.フロント リテイリング	92,100	1,288.00	118,624,800
ドトール・日レスホールディングス	12,300	2,046.00	25,165,800
マツモトキヨシホールディングス	29,500	3,935.00	116,082,500
ブロンコビリー	4,100	2,304.00	9,446,400
ZOZO	77,800	2,112.00	164,313,600
物語コーポレーション	1,900	9,650.00	18,335,000
ココカラファイン	7,900	5,920.00	46,768,000
三越伊勢丹ホールディングス	133,800	851.00	113,863,800
ウエルシアホールディングス	18,900	5,460.00	103,194,000
クリエイティブSDホールディングス	9,800	2,408.00	23,598,400
チムニー	2,800	2,440.00	6,832,000
シュッピン	5,900	885.00	5,221,500
ネクステージ	10,700	1,104.00	11,812,800
ジョイフル本田	20,500	1,327.00	27,203,500
鳥貴族	3,000	2,120.00	6,360,000
麒麟堂ホールディングス	3,600	1,944.00	6,998,400
ホットランド	5,100	1,152.00	5,875,200
すかいらーくホールディングス	81,100	1,876.00	152,143,600
綿半ホールディングス	3,100	2,150.00	6,665,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19,100	960.00	18,336,000
B E E N O S	2,800	1,249.00	3,497,200
あさひ	6,700	1,231.00	8,247,700
日本調剤	2,700	3,720.00	10,044,000
コスモス薬品	3,200	21,510.00	68,832,000
セブン&アイ・ホールディングス	300,200	3,986.00	1,196,597,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	18,500	1,620.00	29,970,000
ツルハホールディングス	15,600	11,360.00	177,216,000
サンマルクホールディングス	5,500	2,446.00	13,453,000
トリドールホールディングス	9,100	2,508.00	22,822,800
T O K Y O B A S E	7,300	875.00	6,387,500
ジャパンミート	4,400	2,102.00	9,248,800
アレンザホールディングス	5,000	792.00	3,960,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	989.00	6,824,100
クスリのアオキホールディングス	7,100	8,200.00	58,220,000
スシローグローバルホールディングス	8,000	6,810.00	54,480,000
L I X I L ビバ	6,800	1,519.00	10,329,200
メディカルシステムネットワーク	10,700	510.00	5,457,000
ノジマ	11,900	1,787.00	21,265,300

カップ・クリエイト	11,200	1,408.00	15,769,600
ライトオン	8,000	659.00	5,272,000
良品計画	102,000	1,989.00	202,878,000
三城ホールディングス	15,500	308.00	4,774,000
アドヴァン	12,600	1,145.00	14,427,000
アルビス	3,200	2,405.00	7,696,000
コナカ	17,200	435.00	7,482,000
G - 7ホールディングス	2,600	3,190.00	8,294,000
イオン北海道	10,100	731.00	7,383,100
コジマ	15,000	461.00	6,915,000
コーナン商事	9,300	2,403.00	22,347,900
エコス	3,100	1,588.00	4,922,800
ワタミ	10,300	1,454.00	14,976,200
パン・パシフィック・インターナショナルホ	171,600	1,689.00	289,832,400
西松屋チェーン	16,400	915.00	15,006,000
ゼンショーホールディングス	34,600	2,396.00	82,901,600
幸楽苑ホールディングス	4,700	2,432.00	11,430,400
サイゼリヤ	11,500	2,627.00	30,210,500
V Tホールディングス	32,000	455.00	14,560,000
ユナイテッドアローズ	8,400	3,200.00	26,880,000
ハイデイ日高	10,000	2,078.00	20,780,000
コロワイド	24,500	2,123.00	52,013,500
ピーシーデポコーポレーション	11,800	507.00	5,982,600
壱番屋	5,000	5,040.00	25,200,000
スギホールディングス	15,900	5,620.00	89,358,000
薬王堂ホールディングス	3,000	2,500.00	7,500,000
ヴィア・ホールディングス	13,300	669.00	8,897,700
スクロール	14,200	332.00	4,714,400
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,641.00	21,920,300
ファミリーマート	80,300	2,637.00	211,751,100
木曽路	8,900	2,637.00	23,469,300
S R Sホールディングス	11,200	1,038.00	11,625,600
ケーヨー	17,000	476.00	8,092,000
上新電機	8,600	1,985.00	17,071,000
日本瓦斯	11,700	3,045.00	35,626,500
ロイヤルホールディングス	12,300	2,585.00	31,795,500
いなげや	8,000	1,572.00	12,576,000
島忠	15,500	2,583.00	40,036,500
チヨダ	7,400	1,574.00	11,647,600
ライフコーポレーション	5,600	2,126.00	11,905,600
リンガーハット	9,100	2,499.00	22,740,900
MrMaxHD	11,800	441.00	5,203,800

AOKIホールディングス	14,100	1,081.00	15,242,100
オークワ	11,000	1,147.00	12,617,000
コメリ	11,100	2,222.00	24,664,200
青山商事	13,100	1,931.00	25,296,100
しまむら	8,300	8,250.00	68,475,000
高島屋	57,800	1,239.00	71,614,200
松屋	15,300	800.00	12,240,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,200	1,187.00	44,156,400
近鉄百貨店	3,000	3,010.00	9,030,000
パルコ	7,700	1,269.00	9,771,300
丸井グループ	60,900	2,193.00	133,553,700
アクシアル リテイリング	5,600	3,910.00	21,896,000
イオン	275,400	1,953.00	537,856,200
イズミ	14,800	4,135.00	61,198,000
平和堂	14,000	2,031.00	28,434,000
フジ	9,000	1,842.00	16,578,000
ヤオコー	7,900	4,755.00	37,564,500
ゼビオホールディングス	8,700	1,160.00	10,092,000
ケーズホールディングス	75,700	1,156.00	87,509,200
Olympicグループ	5,800	610.00	3,538,000
日産東京販売ホールディングス	17,800	282.00	5,019,600
Genky DrugStores	4,000	2,154.00	8,616,000
総合メディカルホールディングス	6,400	1,542.00	9,868,800
アインホールディングス	9,800	5,940.00	58,212,000
元気寿司	2,300	2,825.00	6,497,500
ヤマダ電機	218,100	498.00	108,613,800
アークランドサカモト	12,400	1,277.00	15,834,800
ニトリホールディングス	31,100	15,145.00	471,009,500
グルメ杵屋	8,200	1,180.00	9,676,000
吉野家ホールディングス	26,400	2,255.00	59,532,000
松屋フーズホールディングス	3,400	3,870.00	13,158,000
サガミホールディングス	10,800	1,357.00	14,655,600
関西スーパーマーケット	6,900	1,101.00	7,596,900
王将フードサービス	5,200	7,040.00	36,608,000
プレナス	8,000	1,744.00	13,952,000
ミニストップ	5,900	1,413.00	8,336,700
アークス	12,400	2,215.00	27,466,000
バローホールディングス	15,800	1,812.00	28,629,600
ベルク	3,400	5,050.00	17,170,000
大庄	5,500	1,562.00	8,591,000
ファーストリテイリング	9,600	65,570.00	629,472,000
サンドラッグ	26,900	3,290.00	88,501,000

サクスパー ホールディングス	7,300	907.00	6,621,100
ペルーナ	17,800	721.00	12,833,800
じもとホールディングス	59,100	98.00	5,791,800
めぶきフィナンシャルグループ	375,600	254.00	95,402,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,300	1,370.00	14,111,000
九州フィナンシャルグループ	120,000	422.00	50,640,000
ゆうちょ銀行	203,300	1,036.00	210,618,800
富山第一銀行	19,600	288.00	5,644,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	450,700	395.00	178,026,500
西日本フィナンシャルホールディングス	45,600	696.00	31,737,600
関西みらいフィナンシャルグループ	34,500	722.00	24,909,000
三十三フィナンシャルグループ	6,000	1,654.00	9,924,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	2,562.00	32,793,600
新生銀行	53,200	1,526.00	81,183,200
あおぞら銀行	40,200	2,580.00	103,716,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,938,000	545.80	2,695,160,400
りそなホールディングス	786,700	447.90	352,362,930
三井住友トラスト・ホールディングス	140,600	3,758.00	528,374,800
三井住友フィナンシャルグループ	505,700	3,657.00	1,849,344,900
千葉銀行	248,100	561.00	139,184,100
群馬銀行	144,600	353.00	51,043,800
武蔵野銀行	11,100	1,824.00	20,246,400
千葉興業銀行	20,600	304.00	6,262,400
筑波銀行	32,800	177.00	5,805,600
七十七銀行	23,200	1,456.00	33,779,200
青森銀行	5,400	2,530.00	13,662,000
秋田銀行	5,100	1,935.00	9,868,500
山形銀行	8,600	1,464.00	12,590,400
岩手銀行	5,300	2,372.00	12,571,600
東邦銀行	67,200	248.00	16,665,600
東北銀行	4,000	986.00	3,944,000
みちのく銀行	5,000	1,593.00	7,965,000
ふくおかフィナンシャルグループ	63,500	1,964.00	124,714,000
静岡銀行	175,500	772.00	135,486,000
十六銀行	9,900	2,249.00	22,265,100
スルガ銀行	56,000	438.00	24,528,000
八十二銀行	173,100	416.00	72,009,600
山梨中央銀行	9,600	1,019.00	9,782,400
大垣共立銀行	15,200	2,297.00	34,914,400
福井銀行	6,900	1,327.00	9,156,300
北國銀行	7,500	2,401.00	18,007,500
清水銀行	3,500	1,873.00	6,555,500



富山銀行	1,700	2,350.00	3,995,000
滋賀銀行	14,700	2,374.00	34,897,800
南都銀行	11,100	2,351.00	26,096,100
百五銀行	65,400	337.00	22,039,800
京都銀行	25,500	4,075.00	103,912,500
紀陽銀行	25,800	1,535.00	39,603,000
ほくほくフィナンシャルグループ	48,500	1,000.00	48,500,000
広島銀行	106,600	510.00	54,366,000
山陰合同銀行	43,700	614.00	26,831,800
中国銀行	62,200	929.00	57,783,800
伊予銀行	96,100	526.00	50,548,600
百十四銀行	8,100	2,047.00	16,580,700
四国銀行	11,100	938.00	10,411,800
阿波銀行	11,200	2,279.00	25,524,800
大分銀行	4,700	2,862.00	13,451,400
宮崎銀行	5,200	2,354.00	12,240,800
佐賀銀行	4,700	1,444.00	6,786,800
沖縄銀行	6,900	3,190.00	22,011,000
琉球銀行	17,000	1,083.00	18,411,000
セブン銀行	242,900	286.00	69,469,400
みずほフィナンシャルグループ	9,747,600	164.20	1,600,555,920
山口フィナンシャルグループ	89,200	708.00	63,153,600
名古屋銀行	6,000	3,010.00	18,060,000
北洋銀行	112,300	222.00	24,930,600
愛知銀行	2,600	3,450.00	8,970,000
中京銀行	3,000	2,139.00	6,417,000
大光銀行	2,500	1,622.00	4,055,000
愛媛銀行	10,200	1,118.00	11,403,600
京葉銀行	32,300	606.00	19,573,800
栃木銀行	42,500	179.00	7,607,500
東和銀行	13,800	724.00	9,991,200
トモニホールディングス	58,400	326.00	19,038,400
フィデアホールディングス	73,000	118.00	8,614,000
池田泉州ホールディングス	81,200	188.00	15,265,600
F P G	23,500	1,102.00	25,897,000
S B I ホールディングス	86,500	2,373.00	205,264,500
ジャフコ	12,100	4,020.00	48,642,000
大和証券グループ本社	579,400	496.00	287,382,400
野村ホールディングス	1,268,900	456.30	578,999,070
岡三証券グループ	63,600	363.00	23,086,800
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	87,100	304.00	26,478,400

水戸証券	26,500	195.00	5,167,500
いちよし証券	16,600	654.00	10,856,400
松井証券	35,900	904.00	32,453,600
マネックスグループ	69,900	327.00	22,857,300
極東証券	11,100	830.00	9,213,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,102.00	8,816,000
藍澤証券	15,600	710.00	11,076,000
スパークス・グループ	30,000	248.00	7,440,000
かんぽ生命保険	27,000	1,638.00	44,226,000
S O M P Oホールディングス	126,200	4,534.00	572,190,800
アニコム ホールディングス	6,200	3,850.00	23,870,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	187,500	3,464.00	649,500,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	59,300	2,378.00	141,015,400
第一生命ホールディングス	404,800	1,554.50	629,261,600
東京海上ホールディングス	256,800	5,735.00	1,472,748,000
T & Dホールディングス	221,600	1,121.00	248,413,600
アドバンスクリエイト	2,000	1,830.00	3,660,000
全国保証	20,500	4,025.00	82,512,500
C a s a	4,000	1,221.00	4,884,000
アルヒ	7,200	2,174.00	15,652,800
プレミアグループ	4,400	1,866.00	8,210,400
クレディセゾン	50,400	1,274.00	64,209,600
芙蓉総合リース	8,400	6,330.00	53,172,000
興銀リース	14,300	2,838.00	40,583,400
東京センチュリー	14,400	5,200.00	74,880,000
日本証券金融	32,200	505.00	16,261,000
アイフル	98,800	245.00	24,206,000
リコーリース	6,100	3,435.00	20,953,500
イオンフィナンシャルサービス	45,500	1,660.00	75,530,000
アコム	146,800	401.00	58,866,800
ジャックス	8,400	2,295.00	19,278,000
オリエントコーポレーション	203,000	140.00	28,420,000
日立キャピタル	17,200	2,214.00	38,080,800
オリックス	477,200	1,665.50	794,776,600
三菱U F Jリース	162,400	620.00	100,688,000
日本取引所グループ	194,700	1,796.00	349,681,200
イー・ギャランティ	7,100	1,288.00	9,144,800
N E Cキャピタルソリューション	3,300	2,094.00	6,910,200
いちご	94,200	446.00	42,013,200
日本駐車場開発	90,400	174.00	15,729,600
スター・マイカ・ホールディングス	4,000	1,836.00	7,344,000
ヒューリック	152,800	1,040.00	158,912,000

三栄建築設計	3,600	1,457.00	5,245,200
野村不動産ホールディングス	48,200	2,303.00	111,004,600
三重交通グループホールディングス	16,400	540.00	8,856,000
サムティ	10,600	1,866.00	19,779,600
ディア・ライフ	11,100	520.00	5,772,000
日本商業開発	5,500	1,482.00	8,151,000
プレサンスコーポレーション	12,100	1,604.00	19,408,400
ユニゾホールディングス	11,300	4,285.00	48,420,500
日本管理センター	5,800	1,350.00	7,830,000
フージャースホールディングス	17,800	624.00	11,107,200
オープンハウス	10,600	5,230.00	55,438,000
東急不動産ホールディングス	192,400	653.00	125,637,200
飯田グループホールディングス	59,700	1,718.00	102,564,600
ムゲンエステート	8,200	609.00	4,993,800
ビーロッド	2,000	1,629.00	3,258,000
ハウズドゥ	4,800	1,585.00	7,608,000
パーク24	39,100	2,319.00	90,672,900
パラカ	2,800	2,102.00	5,885,600
三井不動産	380,800	2,511.50	956,379,200
三菱地所	503,400	2,033.50	1,023,663,900
平和不動産	14,100	2,495.00	35,179,500
東京建物	80,000	1,380.00	110,400,000
ダイビル	22,200	1,054.00	23,398,800
京阪神ビルディング	14,500	1,202.00	17,429,000
住友不動産	161,800	3,901.00	631,181,800
テーオーシー	17,500	798.00	13,965,000
東京楽天地	1,800	5,500.00	9,900,000
スターツコーポレーション	9,600	2,435.00	23,376,000
フジ住宅	11,800	683.00	8,059,400
空港施設	13,300	527.00	7,009,100
ゴールドクレスト	6,700	2,074.00	13,895,800
日本エスリード	4,200	1,603.00	6,732,600
日神不動産	13,500	442.00	5,967,000
日本エスコン	14,100	760.00	10,716,000
タカラレーベン	36,800	404.00	14,867,200
サンヨーハウジング名古屋	7,000	880.00	6,160,000
イオンモール	37,100	1,711.00	63,478,100
カチタス	8,300	4,265.00	35,399,500
トーセイ	10,800	1,255.00	13,554,000
サンフロンティア不動産	10,500	1,239.00	13,009,500
エフ・ジェー・ネクスト	7,800	1,031.00	8,041,800
ランドビジネス	6,500	761.00	4,946,500

日本空港ビルデング	23,000	4,275.00	98,325,000
日本工営	5,100	2,824.00	14,402,400
L I F U L L	26,800	635.00	17,018,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,100	1,928.00	9,832,800
日本M & Aセンター	52,200	3,065.00	159,993,000
メンバーズ	2,600	1,842.00	4,789,200
タケエイ	10,300	932.00	9,599,600
トラスト・テック	7,400	1,198.00	8,865,200
コシダカホールディングス	16,200	1,610.00	26,082,000
パソナグループ	8,200	1,507.00	12,357,400
リンクアンドモチベーション	13,400	595.00	7,973,000
G C A	8,500	721.00	6,128,500
エス・エム・エス	25,200	2,600.00	65,520,000
パーソルホールディングス	69,600	2,116.00	147,273,600
リニカル	4,400	1,009.00	4,439,600
クックパッド	24,700	291.00	7,187,700
学情	3,800	1,222.00	4,643,600
スタジオアリス	4,100	1,925.00	7,892,500
シミックホールディングス	4,500	1,669.00	7,510,500
総合警備保障	27,700	5,350.00	148,195,000
カカクコム	52,900	2,524.00	133,519,600
アイロムグループ	3,200	1,650.00	5,280,000
ルネサンス	4,500	1,579.00	7,105,500
ディップ	11,400	2,535.00	28,899,000
オプトホールディング	4,800	1,435.00	6,888,000
新日本科学	11,600	684.00	7,934,400
ツクイ	20,000	438.00	8,760,000
ベネフィット・ワン	19,200	1,847.00	35,462,400
エムスリー	146,800	2,390.00	350,852,000
アウトソーシング	37,100	992.00	36,803,200
ウェルネット	8,600	709.00	6,097,400
ワールドホールディングス	2,200	1,582.00	3,480,400
ディー・エヌ・エー	38,300	1,948.00	74,608,400
博報堂D Yホールディングス	96,500	1,584.00	152,856,000
ぐるなび	11,500	694.00	7,981,000
タカミヤ	9,400	639.00	6,006,600
ジャパンベストレスキューシステム	5,900	1,135.00	6,696,500
ファンコミュニケーションズ	21,000	547.00	11,487,000
ライク	3,500	1,707.00	5,974,500
W D Bホールディングス	3,600	2,566.00	9,237,600
バリューコマース	4,200	1,657.00	6,959,400
インフォマート	39,000	1,574.00	61,386,000

J Pホールディングス	25,400	275.00	6,985,000
E P Sホールディングス	10,700	1,312.00	14,038,400
プレステージ・インターナショナル	13,600	1,799.00	24,466,400
アミューズ	4,600	2,597.00	11,946,200
ドリームインキュベータ	3,200	1,290.00	4,128,000
クイック	5,000	1,307.00	6,535,000
ケネディクス	63,400	544.00	34,489,600
電通	71,800	3,740.00	268,532,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,153.00	3,920,200
ぴあ	2,100	4,115.00	8,641,500
イオンファンタジー	2,400	2,807.00	6,736,800
シーティーエス	9,200	700.00	6,440,000
ネクシィーズグループ	2,600	1,858.00	4,830,800
みらかホールディングス	20,100	2,440.00	49,044,000
アルプス技研	7,000	1,473.00	10,311,000
日本空調サービス	9,600	702.00	6,739,200
オリエンタルランド	82,100	15,355.00	1,260,645,500
ダスキン	18,100	2,776.00	50,245,600
明光ネットワークジャパン	10,600	896.00	9,497,600
ファルコホールディングス	5,200	1,632.00	8,486,400
ラウンドワン	21,200	1,573.00	33,347,600
リゾートトラスト	30,800	1,658.00	51,066,400
ビー・エム・エル	9,100	2,972.00	27,045,200
りらいあコミュニケーションズ	12,800	1,332.00	17,049,600
リソー教育	36,700	454.00	16,661,800
ユー・エス・エス	85,100	2,020.00	171,902,000
サイバーエージェント	40,300	4,165.00	167,849,500
楽天	325,200	1,026.00	333,655,200
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,154.00	5,654,600
テー・オー・ダブリュー	8,300	703.00	5,834,900
山田コンサルティンググループ	4,000	1,652.00	6,608,000
セントラルスポーツ	2,900	3,095.00	8,975,500
フルキャストホールディングス	6,700	1,964.00	13,158,800
エン・ジャパン	10,200	3,780.00	38,556,000
テクノプロ・ホールディングス	14,200	6,030.00	85,626,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,200	3,465.00	11,088,000
G u n o s y	5,400	1,446.00	7,808,400
イー・ガーディアン	4,200	1,732.00	7,274,400
ジャパンマテリアル	19,300	1,171.00	22,600,300
ベクトル	8,900	953.00	8,481,700
チャーム・ケア・コーポレーション	2,500	1,892.00	4,730,000
I B J	5,600	1,090.00	6,104,000

アサンテ	3,500	1,970.00	6,895,000
N・フィールド	5,900	619.00	3,652,100
バリューHR	2,100	2,815.00	5,911,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,400	6,190.00	14,856,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,476.00	6,199,200
アビスト	1,500	2,656.00	3,984,000
シグマクシス	4,400	1,295.00	5,698,000
ウィルグループ	5,400	842.00	4,546,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,100	226.00	2,734,600
リクルートホールディングス	497,700	3,175.00	1,580,197,500
エラン	4,800	1,823.00	8,750,400
日本郵政	568,600	999.00	568,031,400
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,576.00	18,912,000
鎌倉新書	5,400	1,613.00	8,710,200
LITALICO	2,300	1,882.00	4,328,600
エポラブルアジア	3,500	1,993.00	6,975,500
アトラエ	2,300	2,476.00	5,694,800
ストライク	3,100	2,552.00	7,911,200
ソラスト	17,300	1,238.00	21,417,400
インソース	3,750	2,330.00	8,737,500
ベikalレント・コンサルティング	5,000	4,610.00	23,050,000
MS - Japan	3,200	1,376.00	4,403,200
グレイステクノロジー	2,900	2,888.00	8,375,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,500	2,554.00	14,047,000
日総工産	4,900	1,044.00	5,115,600
キュービーネットホールディングス	4,600	2,147.00	9,876,200
RPAホールディングス	3,000	1,612.00	4,836,000
スプリックス	2,800	1,479.00	4,141,200
リログループ	38,100	2,547.00	97,040,700
東祥	4,500	2,251.00	10,129,500
エイチ・アイ・エス	11,200	2,689.00	30,116,800
共立メンテナンス	10,600	4,205.00	44,573,000
イチネンホールディングス	8,500	1,076.00	9,146,000
建設技術研究所	5,700	1,561.00	8,897,700
スペース	4,300	1,235.00	5,310,500
燦ホールディングス	2,500	2,103.00	5,257,500
東京テアトル	4,900	1,369.00	6,708,100
ナガワ	2,100	5,060.00	10,626,000
よみうりランド	2,300	4,525.00	10,407,500
東京都競馬	4,700	3,215.00	15,110,500
常磐興産	4,300	1,694.00	7,284,200
カナモト	10,700	2,611.00	27,937,700

東京ドーム	27,000	977.00	26,379,000
西尾レントオール	7,200	2,802.00	20,174,400
トランス・コスモス	7,800	2,508.00	19,562,400
乃村工藝社	32,800	1,331.00	43,656,800
藤田観光	3,300	2,688.00	8,870,400
KNT - CTホールディングス	4,300	1,442.00	6,200,600
日本管財	7,000	1,880.00	13,160,000
トーカイ	6,800	2,306.00	15,680,800
セコム	73,800	9,149.00	675,196,200
セントラル警備保障	3,500	5,300.00	18,550,000
丹青社	13,300	1,255.00	16,691,500
メイテック	8,700	5,260.00	45,762,000
応用地質	8,800	1,070.00	9,416,000
船井総研ホールディングス	14,300	2,319.00	33,161,700
オオバ	8,200	601.00	4,928,200
学究社	4,200	1,220.00	5,124,000
ベネッセホールディングス	26,200	2,731.00	71,552,200
イオンディライト	8,400	3,275.00	27,510,000
ナック	6,000	922.00	5,532,000
ニチイ学館	10,800	1,613.00	17,420,400
ダイセキ	11,900	2,665.00	31,713,500
合計	84,786,250		162,317,778,960

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	3,070,325,656	3,506,546,886
コール・ローン	327,460,691	123,456,493
株式	177,661,382,097	168,596,815,846
投資証券	4,048,459,917	4,540,908,500
派生商品評価勘定	41,107,530	112,492,819
未収入金	6,283,102	5,180,797
未収配当金	396,539,159	411,546,646

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
前払金	32,617,350	-
差入委託証拠金	1,872,688,657	1,121,198,738
流動資産合計	187,456,864,159	178,418,146,725
資産合計	187,456,864,159	178,418,146,725
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	74,205,793	9,819,569
前受金	-	103,060,160
未払金	2,538,554	-
未払解約金	384,091,891	92,048,569
未払利息	888	255
その他未払費用	19,182	14,311
流動負債合計	460,856,308	204,942,864
負債合計	460,856,308	204,942,864
純資産の部		
元本等		
元本	52,668,903,258	49,466,918,390
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	134,327,104,593	128,746,285,471
元本等合計	186,996,007,851	178,213,203,861
純資産合計	186,996,007,851	178,213,203,861
負債純資産合計	187,456,864,159	178,418,146,725

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>



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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	52,668,903,258口	49,466,918,390口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.5504円 (10,000口当たりの純資産額 35,504円)	1口当たり純資産額 3.6027円 (10,000口当たりの純資産額 36,027円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和1年9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年9月10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	5,297,354,099	-	5,264,736,749	32,617,350
	SPMINI 1809	3,753,041,998	-	3,778,852,081	25,810,083
	DJ EUR 1809	953,248,767	-	911,537,928	41,710,839
	FTSE 1809	356,756,089	-	344,601,310	12,154,779
	SPI200 1809	234,307,245	-	229,745,430	4,561,815
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	149,267,687	-	149,748,600	480,913
	米ドル	101,622,740	-	102,046,400	423,660
	カナダドル	5,036,994	-	5,051,400	14,406
	ユーロ	17,965,682	-	17,956,400	9,282
	英ポンド	9,992,248	-	10,042,200	49,952
	スイスフラン	4,576,972	-	4,579,600	2,628
	スウェーデンクローナ	1,455,034	-	1,471,200	16,166
	ノルウェークローネ	393,476	-	394,200	724
	デンマーククローネ	1,032,621	-	1,032,000	621
	オーストラリアドル	3,968,555	-	3,944,000	24,555
	香港ドル	2,111,035	-	2,118,000	6,965
	シンガポールドル	803,400	-	804,400	1,000
	イスラエルシェケル	308,930	-	308,800	130
合計		5,446,621,786	-	5,414,485,349	33,098,263

（令和 1年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,814,636,086	-	4,917,696,246	103,060,160

市場取引以外の取引	SPMINI 1909	3,494,877,063	-	3,568,084,628	73,207,565
	DJ EUR 1909	815,865,744	-	841,464,049	25,598,305
	FTSE 1909	288,046,648	-	287,839,035	207,613
	SPI200 1909	215,846,631	-	220,308,534	4,461,903
	為替予約取引				
	売建	217,291,590	-	217,678,500	386,910
	米ドル	151,217,200	-	151,481,300	264,100
	カナダドル	5,700,700	-	5,707,800	7,100
	ユーロ	22,493,100	-	22,547,300	54,200
	英ポンド	18,552,500	-	18,571,000	18,500
	スイスフラン	1,082,400	-	1,082,600	200
	ノルウェークローネ	120,330	-	120,300	30
	デンマーククローネ	636,240	-	636,400	160
	オーストラリアドル	16,910,700	-	16,953,300	42,600
	香港ドル	274,100	-	274,000	100
	イスラエルシケル	304,320	-	304,500	180
合計	5,031,927,676	-	5,135,374,746	102,673,250	

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 平成30年 9月10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	59,585,870,607円
同期中における追加設定元本額	9,453,012,350円
同期中における一部解約元本額	16,369,979,699円
平成30年 9月10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	13,307,134,895円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	263,703,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,098,206,792円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	754,151,214円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	87,908,419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)	2,617,655円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	7,827,465円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	21,829,082円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	39,124,958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)	25,608,273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)	65,520,302円
外国株式指数ファンド	489,239,011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	2,217,029,226円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	325,010,452円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	378,729,267円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	332,384,878円
イオン・バランス戦略ファンド	65,907,230円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,657,218円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,400,096円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,189,293円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	15,360,258円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,775,140円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	39,916,716円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,412,790円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,240,340,444円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	9,867,822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>	277,470,008円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,801,742,634円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,639,347,501円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,919,628,475円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	21,665,789円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	112,494,500円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	448,417円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	866,405,229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>	63,322,997円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	188,955,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	839,861,789円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	714,752,368円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,784,766,652円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,146,412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）	723,839,042円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,004,698,938円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,067,778円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	81,789,837円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,267,904,169円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	26,825,416円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	14,190,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	7,065,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	51,561,872円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	123,124,057円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	123,108,430円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,304,117,644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>	183,651,181円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,759,467,341円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	391,291,499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>	3,103,743,780円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	9,018,420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>	111,024,727円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	53,183,061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>	129,354,128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>	14,580円
合計	52,668,903,258円

(令和1年9月10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	52,668,903,258円
同期中における追加設定元本額	13,741,540,617円
同期中における一部解約元本額	16,943,525,485円
令和1年9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	15,911,239,515円

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	324,923,476円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,289,610,420円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	844,073,259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)	81,776,697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)	2,262,931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)	9,053,468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)	23,995,600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)	50,062,229円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	35,803,979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)	83,929,695円
外国株式指数ファンド	524,029,710円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	4,083,860,343円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	425,075,130円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	422,770,839円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	393,371,996円
イオン・バランス戦略ファンド	23,408,517円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,155,384円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,786,847円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,067,042円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	81,659,431円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	46,255,302円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,886,041円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	16,546,398円
三井住友D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	56,291円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,585,100,603円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,590,525円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	76,749,837円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,538,560,440円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,460,709,925円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,139,461,309円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	20,735,530円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	103,934,006円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	416,205円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	739,732,943円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	60,844,158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 >	171,173,908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 >	770,537,138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 >	637,137,232円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,547,704,635円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	807,485円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	303,220,325円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	220,743,582円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	135,085,674円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	85,886,577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 >	23,771,920円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	13,453,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,751,404円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	45,905,122円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	110,966,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	61,127,502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>	934,227,203円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	148,739,209円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,079,631,479円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	291,044,596円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,116,346,988円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	8,696,255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>	45,189,709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>	62,375,876円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	99,546,999円
合計	49,466,918,390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	16,399	23.65	387,836.35	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,431	24.18	566,561.58	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	18.40	361,228.80	
	CHENIERE ENERGY INC	10,007	62.45	624,937.15	
	CHEVRON CORPORATION	81,139	119.39	9,687,185.21	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	44.82	182,865.60	
	CONCHO RESOURCES INC	8,637	74.24	641,210.88	
	CONOCOPHILLIPS	47,385	54.97	2,604,753.45	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	32.02	145,210.70	
	DEVON ENERGY CORPORATION	17,911	24.63	441,147.93	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,082	96.54	683,696.28	
	EOG RESOURCES INC	25,219	80.00	2,017,520.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	179,561	71.49	12,836,815.89	
	HALLIBURTON CO	37,453	19.95	747,187.35	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	41.72	170,217.60	
	HESS CORPORATION	10,809	64.06	692,424.54	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,365	50.43	371,416.95	
	KINDER MORGAN INC	84,312	20.41	1,720,807.92	
MARATHON OIL CORP	36,817	12.90	474,939.30		



MARATHON PETROLEUM CORPORATION	27,688	53.58	1,483,523.04
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	23.96	403,678.08
NOBLE ENERGY INC	20,924	23.76	497,154.24
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,105	44.97	1,713,581.85
ONEOK INC	17,884	73.67	1,317,514.28
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	17.70	162,981.60
PHILLIPS 66	18,922	102.17	1,933,260.74
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,229	132.00	954,228.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	22.10	172,512.60
SCHLUMBERGER LTD	60,249	36.23	2,182,821.27
TARGA RESOURCES CORP	9,334	39.31	366,919.54
TECHNIPFMC PLC	18,187	25.80	469,224.60
VALERO ENERGY CORP	18,039	79.38	1,431,935.82
WILLIAMS COS INC	52,630	24.68	1,298,908.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,506	216.36	2,056,718.16
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	65.36	300,852.08
AMCOR PLC	69,886	9.81	685,581.66
AVERY DENNISON CORP	3,941	113.42	446,988.22
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,327	30.67	224,719.09
BALL CORPORATION	13,670	75.07	1,026,206.90
CELANESE CORPORATION	5,647	120.91	682,778.77
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	48.85	495,290.15
CORTEVA INC	33,348	28.75	958,755.00
CROWN HOLDINGS INC	5,272	63.15	332,926.80
DOW INC	32,241	44.45	1,433,112.45
DUPONT DE NEMOURS INC	31,294	70.51	2,206,539.94
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	70.46	419,659.76
ECOLAB INC	10,853	200.78	2,179,065.34
FMC CORPORATION	5,698	87.02	495,839.96
FREEMONT-MCMORAN INC	56,918	9.70	552,104.60
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	40.16	687,980.96
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,918	119.93	469,885.74
LINDE PLC	23,191	185.21	4,295,205.11
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,907	81.46	969,944.22
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	253.10	652,238.70
MOSAIC CO/THE	15,550	20.18	313,799.00
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	35,566	38.06	1,353,641.96
NUCOR CORP	13,218	51.23	677,158.14
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	100.52	406,703.92
PPG INDUSTRIES INC	10,300	116.51	1,200,053.00
SEALED AIR CORP	5,566	40.24	223,975.84
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,458	523.03	1,808,637.74

STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	28.97	295,233.27
VULCAN MATERIALS CO	5,265	142.06	747,945.90
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	63.66	93,898.50
WESTROCK CO	11,330	35.95	407,313.50
3M COMPANY	24,492	165.94	4,064,202.48
ACUITY BRANDS INC	1,884	129.16	243,337.44
AERCAP HOLDINGS NV	5,590	55.49	310,189.10
ALLEGION PLC	3,946	97.94	386,471.24
AMETEK INC	9,623	89.77	863,856.71
ARCONIC INC	19,024	26.30	500,331.20
BOEING CO	22,688	358.78	8,140,000.64
CATERPILLAR INC	24,481	127.25	3,115,207.25
CUMMINS INC	6,358	160.82	1,022,493.56
DEERE & CO	12,618	158.36	1,998,186.48
DOVER CORP	6,165	95.53	588,942.45
EATON CORP PLC	17,419	84.85	1,478,002.15
EMERSON ELECTRIC CO	26,867	63.78	1,713,577.26
FASTENAL COMPANY	23,906	32.07	766,665.42
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	45.79	222,035.71
FLUOR CORP	5,677	20.44	116,037.88
FORTIVE CORP	13,068	68.01	888,754.68
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	52.14	336,303.00
GENERAL DYNAMICS CORP	10,421	188.07	1,959,877.47
GENERAL ELECTRIC CO	370,269	8.96	3,317,610.24
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	40.82	317,865.34
HEICO CORP	1,888	133.57	252,180.16
HEICO CORP-CLASS A	2,789	102.23	285,119.47
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,012	169.66	5,261,495.92
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	215.45	394,704.40
IDEX CORP	3,078	167.93	516,888.54
ILLINOIS TOOL WORKS	13,956	153.71	2,145,176.76
INGERSOLL-RAND PLC	10,301	121.28	1,249,305.28
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,934	92.12	546,640.08
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	8,700	53.74	467,538.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	31.38	285,558.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	32,733	42.89	1,403,918.37
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,528	208.82	1,989,636.96
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	241.23	371,976.66
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	10,817	380.21	4,112,731.57
MASCO CORP	13,282	42.06	558,640.92
MIDDLEBY CORP	2,315	116.66	270,067.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,859	355.83	2,440,637.97

OWENS CORNING	4,859	57.75	280,607.25
PACCAR INC	14,030	70.47	988,694.10
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,503	177.46	976,562.38
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	36.86	258,241.16
RAYTHEON COMPANY	11,751	189.41	2,225,756.91
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,199	161.99	842,186.01
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,497	356.96	1,605,249.12
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	48.86	347,199.16
SMITH(A.O.) CORP	5,944	49.10	291,850.40
SNAP-ON INC	2,448	152.40	373,075.20
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	83.31	427,963.47
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,095	143.14	872,438.30
TEXTRON INC	10,639	47.95	510,140.05
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	513.58	1,037,431.60
UNITED RENTALS INC	3,677	120.72	443,887.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	34,822	134.11	4,669,978.42
WABCO HOLDINGS INC	2,109	133.63	281,825.67
WABTEC CORP	7,279	70.38	512,296.02
WW GRAINGER INC	1,980	285.90	566,082.00
XYLEM INC	7,965	77.50	617,287.50
CINTAS CORP	3,754	255.66	959,747.64
COPART INC	8,553	82.29	703,826.37
COSTAR GROUP INC	1,549	578.70	896,406.30
EQUIFAX INC	5,242	144.50	757,469.00
IHS MARKIT LTD	16,812	67.29	1,131,279.48
MANPOWERGROUP	2,036	85.20	173,467.20
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	21.67	327,997.12
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	87.62	851,754.02
ROBERT HALF INTL INC	4,666	55.22	257,656.52
ROLLINS INC	6,451	34.32	221,398.32
TRANSUNION	7,559	83.43	630,647.37
VERISK ANALYTICS INC	6,607	160.20	1,058,441.40
WASTE CONNECTIONS INC	11,199	89.82	1,005,894.18
WASTE MANAGEMENT INC	18,342	117.62	2,157,386.04
AMERCO	390	359.71	140,286.90
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	28.44	161,425.44
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	83.29	504,987.27
CSX CORPORATION	32,958	69.05	2,275,749.90
DELTA AIR LINES INC	7,251	58.11	421,355.61
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,504	73.96	554,995.84
FEDEX CORP	10,884	167.42	1,822,199.28
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	113.87	401,164.01

KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	131.86	613,017.14
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,115	37.21	190,329.15
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,376	177.32	2,017,192.32
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	167.01	440,739.39
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	53.08	335,253.28
UBER TECHNOLOGIES INC	6,744	32.24	217,426.56
UNION PACIFIC CORP	30,125	166.12	5,004,365.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	87.33	251,510.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,604	121.66	3,601,622.64
XPO LOGISTICS INC	3,222	74.75	240,844.50
APTIV PLC	11,455	90.31	1,034,501.05
AUTOLIV INC	4,001	78.10	312,478.10
BORGWARNER INC	8,566	36.66	314,029.56
FORD MOTOR COMPANY	166,213	9.54	1,585,672.02
GENERAL MOTORS CO	53,806	39.58	2,129,641.48
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	34.40	252,736.80
LEAR CORP	2,531	123.92	313,641.52
TESLA INC	5,310	231.79	1,230,804.90
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	29.75	185,312.75
D.R.HORTON INC	15,658	49.77	779,298.66
GARMIN LTD	5,034	85.14	428,594.76
HANESBRANDS INC	13,181	15.06	198,505.86
HASBRO INC	5,156	113.94	587,474.64
LEGGETT & PLATT INC	5,036	40.42	203,555.12
LENNAR CORP-CL A	11,246	52.44	589,740.24
LULULEMON ATHLETICA INC	4,531	194.39	880,781.09
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	121.29	347,253.27
NEWELL BRANDS INC	18,477	17.82	329,260.14
NIKE INC -CL B	53,542	88.67	4,747,569.14
NVR INC	143	3,766.27	538,576.61
POLARIS INC	2,467	86.02	212,211.34
PULTE GROUP INC	9,730	34.76	338,214.80
PVH CORP	3,303	89.19	294,594.57
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	96.85	201,157.45
ROKU INC	3,156	161.03	508,210.68
TAPESTRY INC	11,987	24.29	291,164.23
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	20.22	174,579.48
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	18.32	151,891.12
VF CORP	14,995	89.63	1,344,001.85
WHIRLPOOL CORP	2,604	147.87	385,053.48
ARAMARK	10,783	42.00	452,886.00
CARNIVAL CORP	16,900	47.61	804,609.00

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,118	839.65	938,728.70
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	127.57	685,306.04
DOMINO'S PIZZA INC	1,661	239.20	397,311.20
H&R BLOCK INC	7,820	24.20	189,244.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,833	92.53	1,094,907.49
LAS VEGAS SANDS CORP	13,972	58.08	811,493.76
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,056	129.91	1,566,194.96
MCDONALD'S CORPORATION	32,334	217.26	7,024,884.84
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	8,597	21.50	184,835.50
MGM MIRAGE	22,498	28.40	638,943.20
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	52.94	483,606.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,767	110.61	859,107.87
STARBUCKS CORP	51,591	94.16	4,857,808.56
VAIL RESORTS INC	1,680	233.28	391,910.40
WYNN RESORTS LTD	4,252	114.65	487,491.80
YUM! BRANDS INC	13,431	117.81	1,582,306.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,490	55.19	1,793,123.10
ALPHABET INC-CL A	12,733	1,205.27	15,346,702.91
ALPHABET INC-CL C	13,371	1,204.41	16,104,166.11
ALTICE USA INC-A	6,300	28.43	179,109.00
CBS CORP-CL B	14,639	44.11	645,726.29
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	6,710	419.78	2,816,723.80
COMCAST CORP-CLASS A	192,927	46.42	8,955,671.34
DISCOVERY INC-A	7,075	27.30	193,147.50
DISCOVERY INC-C	15,919	25.76	410,073.44
DISH NETWORK CORP.	9,780	36.30	355,014.00
ELECTRONIC ARTS INC	12,994	98.68	1,282,247.92
FACEBOOK INC-A	102,320	188.76	19,313,923.20
FOX CORPORATION-CLASS A	15,479	34.30	530,929.70
FOX CORPORATION-CLASS B	6,260	33.99	212,777.40
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	237.00	765,747.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	21.07	327,512.08
LIBERTY BROADBAND-C	4,599	107.48	494,300.52
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	27.44	231,374.08
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	26.75	563,863.25
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	42.97	368,166.96
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	41.87	320,221.76
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	41.49	171,810.09
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	69.33	420,486.45
NETFLIX INC	18,571	294.34	5,466,188.14
NEWS CORP-CLASS A	16,662	14.37	239,432.94
OMNICOM GROUP	9,445	78.47	741,149.15

SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.29	429,305.08
SNAP INC-A	29,243	15.31	447,710.33
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	132.17	635,473.36
THE WALT DISNEY CO.	76,658	138.83	10,642,430.14
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	39.61	160,460.11
TWITTER INC	32,213	44.26	1,425,747.38
VIACOM INC-CLASS B	14,668	26.27	385,328.36
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	30.85	164,122.00
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	147.43	487,108.72
AMAZON.COM INC	17,799	1,831.35	32,596,198.65
AUTOZONE INC	1,086	1,127.19	1,224,128.34
BEST BUY COMPANY INC	10,543	69.22	729,786.46
BOOKING HOLDINGS INC	1,820	1,992.25	3,625,895.00
BURLINGTON STORES INC	3,144	202.00	635,088.00
CARMAX INC	7,453	86.59	645,355.27
DOLLAR GENERAL CORP	10,834	160.76	1,741,673.84
DOLLAR TREE INC	10,263	108.90	1,117,640.70
EBAY INC	35,266	41.40	1,460,012.40
EXPEDIA GROUP INC	5,595	131.21	734,119.95
GAP INC/THE	9,218	17.96	165,555.28
GENUINE PARTS CO	6,098	95.34	581,383.32
GRUBHUB INC	4,403	62.75	276,288.25
HOME DEPOT INC	46,821	232.87	10,903,206.27
KOHL'S CORP	6,991	51.73	361,644.43
L BRANDS INC	10,675	17.87	190,762.25
LKQ CORPORATION	13,945	27.40	382,093.00
LOWE'S COMPANIES INC	34,070	114.79	3,910,895.30
MACY'S INC	13,521	16.18	218,769.78
MERCADOLIBRE INC	1,842	571.13	1,052,021.46
NORDSTROM INC	4,756	32.77	155,854.12
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,483	402.62	1,402,325.46
QURATE RETAIL INC	18,982	11.84	224,746.88
ROSS STORES INC	16,129	108.49	1,749,835.21
TARGET CORP	22,041	107.95	2,379,325.95
TIFFANY & CO	4,643	91.28	423,813.04
TJX COMPANIES INC	51,560	56.79	2,928,092.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	102.58	541,417.24
ULTA BEAUTY INC	2,389	226.16	540,296.24
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	124.00	357,988.00
COSTCO WHOLESALE CORP	18,736	299.00	5,602,064.00
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	7.00	94,500.00
KROGER CO	31,887	25.19	803,233.53

SYSCO CORP	21,225	76.71	1,628,169.75
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	33,103	55.59	1,840,195.77
WALMART INC	61,062	116.33	7,103,342.46
ALTRIA GROUP INC	79,729	44.04	3,511,265.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,953	39.67	989,885.51
BROWN-FORMAN CORPORATION	13,617	63.56	865,496.52
BUNGE LIMITED	5,968	57.10	340,772.80
CAMPBELL SOUP CO	7,879	44.59	351,324.61
COCA-COLA CO/THE	171,869	54.52	9,370,297.88
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,692	55.03	533,350.76
CONAGRA BRANDS INC	20,188	29.11	587,672.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,837	206.75	1,413,549.75
GENERAL MILLS INC	24,499	55.59	1,361,899.41
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	42.91	533,929.13
INGREDION INC	3,320	80.38	266,861.60
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	105.12	516,559.68
KELLOGG CO	11,216	64.17	719,730.72
KRAFT HEINZ COMPANY	29,657	28.08	832,768.56
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	71.06	432,755.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,921	161.20	793,265.20
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	55.87	439,361.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	61,335	56.48	3,464,200.80
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,558	57.23	1,004,844.34
PEPSICO INC	59,748	136.40	8,149,627.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	66,124	73.30	4,846,889.20
THE HERSHEY COMPANY	6,652	156.15	1,038,709.80
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	83.56	1,054,527.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,841	73.64	724,691.24
CLOROX COMPANY	5,583	158.33	883,956.39
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	34,153	73.19	2,499,658.07
COTY INC-CL A	16,985	10.27	174,435.95
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,584	205.40	1,968,553.60
KIMBERLY-CLARK CORP	14,306	133.27	1,906,560.62
PROCTER & GAMBLE CO	107,000	122.17	13,072,190.00
ABBOTT LABORATORIES	74,711	84.22	6,292,160.42
ABIOMED INC	1,839	186.81	343,543.59
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,272	173.16	566,579.52
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	87.13	614,963.54
ANTHEM INC	10,932	250.45	2,737,919.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,154	87.20	1,757,428.80
BECTON DICKINSON & CO	11,489	257.80	2,961,864.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	58,952	41.74	2,460,656.48

CARDINAL HEALTH INC	12,873	46.82	602,713.86
CENTENE CORP	18,086	46.23	836,115.78
CERNER CORP	13,967	66.50	928,805.50
CIGNA CORPORATION	15,879	162.16	2,574,938.64
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	297.68	611,732.40
CVS HEALTH CORPORATION	55,171	63.68	3,513,289.28
DANAHER CORP	27,446	139.36	3,824,874.56
DAVITA INC	5,115	61.17	312,884.55
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	50.84	505,552.96
DEXCOM INC	3,778	145.37	549,207.86
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,953	217.21	1,944,681.13
HCA HEALTHCARE INC	11,901	127.51	1,517,496.51
HENRY SCHEIN INC	6,050	62.61	378,790.50
HOLOGIC INC	12,110	48.98	593,147.80
HUMANA INC.	5,930	275.69	1,634,841.70
IDEXX LABORATORIES INC	3,485	267.20	931,192.00
INTUITIVE SURGICAL INC	4,870	496.69	2,418,880.30
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	172.48	759,774.40
MCKESSON CORP	8,396	143.79	1,207,260.84
MEDTRONIC PLC	57,022	107.93	6,154,384.46
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	105.01	620,609.10
RESMED INC	5,931	135.11	801,337.41
STERIS PLC	3,642	145.28	529,109.76
STRYKER CORP	14,093	217.18	3,060,717.74
TELEFLEX INC	1,951	341.33	665,934.83
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,621	230.68	9,370,452.28
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	149.52	562,195.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	109.62	451,634.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,388	144.51	778,619.88
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,153	269.88	581,051.64
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,965	137.08	1,228,922.20
ABBVIE INC	62,742	66.70	4,184,891.40
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,676	74.18	1,014,485.68
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,529	106.40	1,013,885.60
ALKERMES PLC	6,413	20.70	132,749.10
ALLERGAN PLC	13,849	162.37	2,248,662.13
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,715	82.69	389,883.35
AMGEN INC	25,980	202.34	5,256,793.20
BEIGENE LTD-ADR	1,527	125.45	191,562.15
BIOGEN INC	8,367	230.00	1,924,410.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	71.93	540,625.88
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	69,446	48.09	3,339,658.14



CELGENE CORP	29,866	97.07	2,899,092.62
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,090	26.99	407,279.10
ELI LILLY & CO	37,640	111.07	4,180,674.80
EXACT SCIENCES CORP	5,415	108.74	588,827.10
GILEAD SCIENCES INC	54,254	66.33	3,598,667.82
ILLUMINA INC	6,253	266.84	1,668,550.52
INCYTE CORP	7,576	78.97	598,276.72
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,661	60.12	340,339.32
IQVIA HOLDINGS INC	7,239	151.87	1,099,386.93
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	125.29	326,255.16
JOHNSON & JOHNSON	112,914	126.95	14,334,432.30
MERCK & CO. INC.	109,228	83.47	9,117,261.16
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	679.56	755,670.72
MYLAN NV	22,501	21.19	476,796.19
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	17.86	125,627.24
PERKINELMER INC	4,774	83.78	399,965.72
PERRIGO CO PLC	5,561	50.89	282,999.29
PFIZER INC	234,850	36.83	8,649,525.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,271	279.00	912,609.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,159	86.64	273,695.76
SEATTLE GENETICS INC	4,290	67.79	290,819.10
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	46,346	7.44	344,814.24
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,972	292.02	4,956,163.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,111	174.81	1,942,313.91
WATERS CORP	3,079	217.07	668,358.53
ZOETIS INC	20,364	126.66	2,579,304.24
BANK OF AMERICA CORP	384,750	28.63	11,015,392.50
BB & T CORPORATION	31,477	50.36	1,585,181.72
CIT GROUP INC	4,770	45.18	215,508.60
CITIGROUP INC	99,306	68.79	6,831,259.74
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	35.72	719,472.24
COMERICA INC	7,145	63.21	451,635.45
EAST WEST BANCORP INC	6,233	44.18	275,373.94
FIFTH THIRD BANCORP	32,637	27.53	898,496.61
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,601	91.10	601,351.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	14.17	649,368.59
JPMORGAN CHASE & CO	137,739	115.40	15,895,080.60
KEYCORP	45,615	17.67	806,017.05
M & T BANK CORP	5,767	154.15	888,983.05
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	15.40	216,139.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,076	136.29	2,599,868.04
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	39,798	15.45	614,879.10

SIGNATURE BANK	2,508	119.94	300,809.52
SUNTRUST BANKS INC	19,640	64.97	1,276,010.80
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	211.73	493,966.09
US BANCORP	64,678	54.91	3,551,468.98
WELLS FARGO & COMPANY	182,804	48.41	8,849,541.64
ZIONS BANCORPORATION	8,874	42.37	375,991.38
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	83.05	187,028.60
ALLY FINANCIAL INC	17,783	34.20	608,178.60
AMERICAN EXPRESS COMPANY	30,492	119.92	3,656,600.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,331	137.87	734,984.97
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,742	21.47	252,100.74
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	35,605	45.48	1,619,315.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,232	206.62	11,412,035.84
BLACKROCK INC	4,948	430.85	2,131,845.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,562	90.96	1,870,319.52
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	118.70	584,360.10
CME GROUP INC.	14,993	215.58	3,232,190.94
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	13,186	84.47	1,113,821.42
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	43.72	479,477.24
EATON VANCE CORP	5,530	44.52	246,195.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,596	268.78	428,972.88
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	27.78	374,168.82
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,867	211.98	2,939,526.66
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	23,523	92.18	2,168,350.14
INVESCO LIMITED	18,328	16.41	300,762.48
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	19.55	251,901.75
KKR & CO INC -A	22,146	26.94	596,613.24
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,467	369.69	542,335.23
MOODY'S CORP	7,497	217.37	1,629,622.89
MORGAN STANLEY	53,355	43.11	2,300,134.05
MSCI INC-A	3,805	237.51	903,725.55
NASDAQ INC	5,459	102.84	561,403.56
NORTHERN TRUST CORP	9,144	93.15	851,763.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	82.27	451,662.30
S&P GLOBAL INC	10,389	260.76	2,709,035.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	49,750	41.10	2,044,725.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	59.81	350,606.22
STATE STREET CORP	16,881	54.00	911,574.00
SYNCHRONY FINANCIAL	27,831	33.71	938,183.01
T ROWE PRICE GROUP INC	10,303	117.72	1,212,869.16
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	47.88	564,505.20
VOYA FINANCIAL INC	5,382	51.91	279,379.62

AFLAC INC	30,795	51.08	1,573,008.60
ALLEGHANY CORPORATION	635	772.24	490,372.40
ALLSTATE CORP	13,667	105.79	1,445,831.93
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	104.84	371,028.76
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	36,143	55.41	2,002,683.63
AON PLC	10,438	193.43	2,019,022.34
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	41.34	736,802.82
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	89.87	681,843.69
ASSURANT INC	2,198	124.64	273,958.72
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	40.63	247,152.29
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	37.83	161,080.14
CHUBB LTD	19,195	160.26	3,076,190.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,149	113.40	697,296.60
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	866	215.08	186,259.28
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	251.77	415,420.50
FNF GROUP	10,851	44.96	487,860.96
GLOBE LIFE INC	4,615	93.10	429,656.50
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	60.30	917,464.50
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	57.50	528,597.50
LOEWS CORPORATION	12,615	49.61	625,830.15
MARKEL CORP	577	1,168.61	674,287.97
MARSH & MCLENNAN COS	21,398	99.87	2,137,018.26
METLIFE INC	33,598	46.40	1,558,947.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	56.01	666,519.00
PROGRESSIVE CORP	24,238	76.74	1,860,024.12
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,842	84.20	1,418,096.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	158.22	478,140.84
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,757	189.64	333,197.48
TRAVELERS COS INC(THE)	11,489	149.23	1,714,503.47
UNUM GROUP	9,769	27.67	270,308.23
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,809	71.42	414,878.78
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	195.53	1,067,593.80
CBRE GROUP INC-A	12,875	55.35	712,631.25
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,337	143.48	2,487,512.76
EQUINIX INC	3,520	538.21	1,894,499.20
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.69	297,587.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	141.97	284,933.79
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	252.00	1,206,072.00
ACCENTURE PLC-CL A	27,114	194.83	5,282,620.62
ADOBE INC	20,585	279.30	5,749,390.50
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	89.59	662,428.46
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	129.03	286,704.66

ANSYS INC	3,662	214.58	785,791.96
AUTODESK INC	9,505	151.02	1,435,445.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,529	168.05	3,113,798.45
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	129.17	632,933.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	68.41	801,354.74
CDK GLOBAL INC	5,003	45.95	229,887.85
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,314	109.89	583,955.46
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	94.97	536,675.47
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	23,715	64.18	1,522,028.70
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,747	107.40	187,627.80
DOCUSIGN INC	5,401	58.57	316,336.57
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	19.48	205,806.20
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	34.96	413,716.64
EPAM SYSTEMS INC	2,053	193.48	397,214.44
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	26,426	133.84	3,536,855.84
FISERV INC	23,973	106.68	2,557,439.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	290.55	1,111,063.20
FORTINET INC	5,937	79.01	469,082.37
GARTNER INC	4,011	136.92	549,186.12
GLOBAL PAYMENTS INC	6,406	170.80	1,094,144.80
GODADDY INC - CLASS A	7,108	65.68	466,853.44
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,850	142.60	5,397,410.00
INTUIT INC	10,890	275.90	3,004,551.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	147.51	473,802.12
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	84.92	515,804.08
MASTERCARD INC-CL A	38,655	283.36	10,953,280.80
MICROSOFT CORP	309,676	137.52	42,586,643.52
MONGODB INC	1,890	131.37	248,289.30
OKTA INC	4,307	109.26	470,582.82
ORACLE CORPORATION	101,902	54.54	5,557,735.08
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	211.18	827,192.06
PAYCHEX INC	14,050	81.81	1,149,430.50
PAYCOM SOFTWARE INC	2,114	228.72	483,514.08
PAYPAL HOLDINGS INC	47,407	105.43	4,998,120.01
PTC INC	5,462	68.15	372,235.30
SABRE CORP	9,850	23.68	233,248.00
SALESFORCE.COM, INC.	35,417	149.54	5,296,258.18
SERVICENOW INC	7,838	254.68	1,996,181.84
SPLUNK INC	6,247	109.48	683,921.56
SQUARE INC-A	13,915	61.47	855,355.05
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	49.66	449,025.72
SYMANTEC CORPORATION	27,227	24.41	664,611.07

SYNOPSYS INC	6,366	141.26	899,261.16
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	137.96	990,414.84
TWILIO INC-A	4,977	111.88	556,826.76
VERISIGN INC	4,603	201.88	929,253.64
VISA INC	74,178	181.55	13,467,015.90
VMWARE INC	3,612	147.44	532,553.28
WESTERN UNION COMPANY	19,054	23.30	443,958.20
WIX.COM LTD	1,874	134.71	252,446.54
WORKDAY INC-CLASS A	6,686	171.04	1,143,573.44
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,101	88.97	1,165,595.97
APPLE INC	195,982	214.17	41,973,464.94
ARISTA NETWORKS INC	2,260	231.13	522,353.80
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	74.22	306,528.60
CDW CORP/DE	6,306	117.51	741,018.06
CISCO SYSTEMS INC	182,337	48.58	8,857,931.46
COGNEX CORP	7,187	47.71	342,891.77
CORNING INC	34,504	28.69	989,919.76
DELL TECHNOLOGIES INC-C	6,212	54.29	337,249.48
F5 NETWORKS INC	2,620	134.73	352,992.60
FLEX LTD	23,204	10.55	244,802.20
FLIR SYSTEMS INC	5,286	51.47	272,070.42
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	57,041	14.95	852,762.95
HP INC	65,227	19.01	1,239,965.27
IPG PHOTONICS CORP	1,776	138.43	245,851.68
JUNIPER NETWORKS INC	15,026	24.02	360,924.52
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,986	98.63	787,659.18
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,704	171.67	1,150,875.68
NETAPP INC	11,136	54.78	610,030.08
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	54.78	620,766.96
TE CONNECTIVITY LTD	14,855	95.09	1,412,561.95
TRIMBLE INC	10,356	38.24	396,013.44
WESTERN DIGITAL CORP	12,583	62.75	789,583.25
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	31.30	303,516.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,069	196.81	407,199.89
AT&T INC	309,424	36.79	11,383,708.96
CENTURYLINK INC	40,608	11.96	485,671.68
SPRINT CORP	36,740	6.91	253,873.40
T-MOBILE US INC	15,128	79.13	1,197,078.64
VERIZON COMMUNICATIONS INC	176,160	58.66	10,333,545.60
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	33.80	312,345.80
AES CORPORATION	27,194	15.03	408,725.82
ALLIANT ENERGY CORP	11,027	51.29	565,574.83

AMEREN CORPORATION	10,336	75.18	777,060.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,449	91.38	1,868,629.62
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,288	122.36	891,759.68
ATMOS ENERGY CORP	4,697	107.74	506,054.78
CENTERPOINT ENERGY INC	22,526	28.78	648,298.28
CMS ENERGY CORPORATION	11,260	61.45	691,927.00
CONSOLIDATED EDISON INC	14,198	90.39	1,283,357.22
DOMINION ENERGY INC	33,448	76.67	2,564,458.16
DTE ENERGY COMPANY	8,162	127.97	1,044,491.14
DUKE ENERGY CORP	30,923	93.72	2,898,103.56
EDISON INTERNATIONAL	14,414	71.12	1,025,123.68
ENERGY CORP	8,240	112.59	927,741.60
EVERGY INC	10,060	63.97	643,538.20
EVERSOURCE ENERGY	13,730	81.80	1,123,114.00
EXELON CORP	42,258	48.03	2,029,651.74
FIRSTENERGY CORP	21,471	46.92	1,007,419.32
NEXTERA ENERGY INC	20,339	219.89	4,472,342.71
NISOURCE INC	15,794	28.91	456,604.54
NRG ENERGY INC	11,952	37.84	452,263.68
OGE ENERGY CORP	9,056	43.00	389,408.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	92.45	473,344.00
PPL CORPORATION	32,318	29.35	948,533.30
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,499	60.38	1,298,109.62
SEMPRA ENERGY	11,656	141.01	1,643,612.56
SOUTHERN CO	44,311	59.02	2,615,235.22
UGI CORPORATION	8,894	48.35	430,024.90
VISTRA ENERGY CORP	13,852	25.55	353,918.60
WEC ENERGY GROUP INC	13,718	90.47	1,241,067.46
XCEL ENERGY INC	22,653	63.39	1,435,973.67
ADVANCED MICRO DEVICES	43,767	30.50	1,334,893.50
ANALOG DEVICES INC	15,993	112.87	1,805,129.91
APPLIED MATERIALS INC	39,385	50.66	1,995,244.10
BROADCOM INC	16,848	292.61	4,929,893.28
INTEL CORP	190,267	51.59	9,815,874.53
KLA CORPORATION	6,614	150.51	995,473.14
LAM RESEARCH CORP	6,386	230.34	1,470,951.24
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	25.00	671,925.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	57.58	669,194.76
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	91.87	929,448.79
MICRON TECHNOLOGY INC	46,564	49.13	2,287,689.32
NVIDIA CORP	24,487	180.50	4,419,903.50
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,622	107.39	1,355,476.58

	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	18.72	326,383.20
	QORVO INC	4,855	76.00	368,980.00
	QUALCOMM INC	51,480	78.21	4,026,250.80
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	79.72	632,817.36
	TEXAS INSTRUMENTS INC	39,918	127.10	5,073,577.80
	XILINX INC	11,291	105.51	1,191,313.41
	米ドル 小計	12,881,427		1,082,217,624.19 (116,284,283,719)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	11.98	196,280.32
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,064	32.57	1,630,584.48
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	12.19	505,068.27
	ENBRIDGE INC	86,034	45.30	3,897,340.20
	ENCANA CORP	66,377	6.20	411,537.40
	HUSKY ENERGY INC	14,553	9.06	131,850.18
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	34.15	443,915.85
	INTER PIPELINE LTD	18,081	25.02	452,386.62
	KEYERA CORP	8,467	33.36	282,459.12
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	48.90	1,061,178.90
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	18.01	162,774.38
	SUNCOR ENERGY INC	65,524	39.35	2,578,369.40
	TC ENERGY CORP	39,217	67.36	2,641,657.12
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	13.63	175,649.81
	VERMILION ENERGY INC	5,586	20.69	115,574.34
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	75.94	736,390.18
	BARRICK GOLD CORP	74,484	22.90	1,705,683.60
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,326	56.47	357,229.22
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	9.24	292,649.28
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	123.56	997,376.32
	KINROSS GOLD CORP	49,641	6.32	313,731.12
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,601	61.68	530,509.68
	LUNDIN MINING CORP	28,209	6.61	186,461.49
	METHANEX CORPORATION	2,452	46.02	112,841.04
	NUTRIEN LTD	25,633	67.25	1,723,819.25
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	20,301	23.51	477,276.51
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	46.37	133,221.01
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	36.99	724,190.22
	BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.82	138,050.64
	CAE INC	12,891	33.50	431,848.50
	SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	15.95	131,587.50
	WSP GLOBAL INC	4,524	73.22	331,247.28
	THOMSON REUTERS CORP	8,224	91.14	749,535.36
	AIR CANADA	5,737	44.00	252,428.00

CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,610	121.45	3,717,584.50
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,750	310.49	1,785,317.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,220	69.54	919,318.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	49.00	444,234.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,165	98.59	1,002,167.35
STARS GROUP INC/THE	9,061	21.66	196,261.26
QUEBECOR INC -CL B	9,953	30.17	300,282.01
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.15	506,760.85
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	138.72	335,286.24
DOLLARAMA INC	12,110	48.90	592,179.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,017	86.59	1,646,682.03
EMPIRE CO LTD A	7,235	36.97	267,477.95
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	74.50	636,155.50
METRO INC	11,418	57.90	661,102.20
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	111.30	346,365.60
SAPUTO INC	8,420	40.14	337,978.80
AURORA CANNABIS INC	28,563	7.91	225,933.33
BAUSCH HEALTH COS INC	14,796	29.09	430,415.64
CANOPY GROWTH CORP	8,388	35.70	299,451.60
CRONOS GROUP INC	8,026	14.89	119,507.14
BANK OF MONTREAL	26,902	93.21	2,507,535.42
BANK OF NOVA SCOTIA	51,217	72.57	3,716,817.69
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,250	104.44	1,906,030.00
NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	63.43	933,372.45
ROYAL BANK OF CANADA	61,063	101.24	6,182,018.12
TORONTO-DOMINION BANK	77,873	73.19	5,699,524.87
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	34,951	69.85	2,441,327.35
CI FINANCIAL CORP	11,041	19.06	210,441.46
IGM FINANCIAL INC	3,023	37.20	112,455.60
ONEX CORPORATION	4,217	79.79	336,474.43
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	592.53	683,187.09
GREAT-WEST LIFE CO INC	14,200	29.14	413,788.00
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	57.92	280,969.92
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	130.41	816,888.24
MANULIFE FINANCIAL CORP	84,843	23.15	1,964,115.45
POWER CORP OF CANADA	14,595	28.24	412,162.80
POWER FINANCIAL CORP	11,076	29.25	323,973.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	56.66	1,463,187.84
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	22.07	144,470.22
BLACKBERRY LIMITED	25,993	9.16	238,095.88
CGI INC-CL A	9,811	103.39	1,014,359.29
CONSTELLATION SOFTWARE	848	1,290.80	1,094,598.40



	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	54.47	636,699.83
	SHOPIFY INC-CLASS A	4,334	472.05	2,045,864.70
	BCE INC	6,928	63.66	441,036.48
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	14,539	66.28	963,644.92
	TELUS CORPORATION	7,611	48.25	367,230.75
	ALTAGAS LTD	9,753	18.76	182,966.28
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	47.15	142,864.50
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	38.46	282,450.24
	EMERA INC	10,551	56.16	592,544.16
	FORTIS INC	17,754	55.43	984,104.22
	HYDRO ONE LTD	15,052	24.43	367,720.36
	カナダドル 小計	1,728,448		79,686,083.85 (6,498,400,137)
ユーロ	ENI SPA	111,408	13.92	1,551,022.17
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	13.07	315,826.62
	NESTE OYJ	17,995	28.39	510,878.05
	OMV AG	6,314	46.61	294,295.54
	REPSOL SA	61,510	13.88	853,758.80
	TENARIS S.A.	17,320	10.28	178,136.20
	TOTAL SA	100,939	46.32	4,675,999.17
	VOPAK	3,130	43.79	137,062.70
	AIR LIQUIDE SA	18,664	123.55	2,305,937.20
	AKZO NOBEL	9,650	81.30	784,545.00
	ARCELORMITTAL	24,972	14.27	356,450.32
	ARKEMA	3,250	83.18	270,335.00
	BASF SE	38,339	62.28	2,387,752.92
	COVESTRO AG	8,053	42.39	341,366.67
	CRH PLC	35,595	30.52	1,086,359.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,267	23.71	148,590.57
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	33.90	114,243.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	66.82	439,274.68
	IMERYS SA	1,384	36.86	51,014.24
	KONINKLIJKE DSM NV	7,717	114.60	884,368.20
	LANXESS	3,160	57.68	182,268.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,732	28.84	280,670.88
	SOLVAY SA	3,263	94.38	307,961.94
	STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	10.95	270,563.55
	SYMRISE AG	5,581	85.10	474,943.10
	THYSSENKRUPP AG	19,367	12.35	239,182.45
	UMICORE	8,730	32.16	280,756.80
	UPM-KYMMENE OYJ	20,909	25.40	531,088.60
	VOESTALPINE AG	5,079	21.94	111,433.26

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	35.31	397,131.57
AIRBUS SE	24,753	126.84	3,139,670.52
ALSTOM RGPT	6,452	39.19	252,853.88
ANDRITZ AG	2,443	34.90	85,260.70
BOUYGUES SA	11,049	33.73	372,682.77
BRENTAG AG	6,629	45.77	303,409.33
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.52	411,228.48
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	33.95	721,980.70
DASSAULT AVIATION SA	89	1,374.00	122,286.00
EIFFAGE SA	3,580	92.58	331,436.40
FERROVIAL SA	18,999	26.04	494,733.96
GEA GROUP AG	8,178	25.29	206,821.62
HOCHTIEF AG	825	101.80	83,985.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,558	42.72	237,437.76
KION GROUP AG	3,179	47.50	151,002.50
KNORR-BREMSE AG	2,138	86.47	184,872.86
KONE OYJ-B	15,270	54.68	834,963.60
LEGRAND SA	11,488	66.00	758,208.00
LEONARDO SPA	18,310	11.41	208,917.10
METSO OYJ	3,963	36.44	144,411.72
MTU AERO ENGINES AG	2,065	248.20	512,533.00
PRYSMIAN SPA	11,926	20.17	240,547.42
SAFRAN SA	13,587	142.45	1,935,468.15
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,395	78.02	1,825,277.90
SIEMENS AG-REG	32,539	94.19	3,064,848.41
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	12.58	144,500.97
THALES SA	4,530	109.45	495,808.50
VINCI S.A.	22,212	97.88	2,174,110.56
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	11.23	212,280.69
BIC	1,337	58.10	77,679.70
BUREAU VERITAS SA	12,626	22.08	278,782.08
EDENRED	9,724	44.14	429,217.36
RANDSTAD NV	4,694	44.49	208,836.06
TELEPERFORMANCE	2,489	192.00	477,888.00
WOLTERS KLUWER-CVA	11,898	65.60	780,508.80
AENA SME SA	2,881	164.55	474,068.55
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	160.40	215,898.40
ATLANTIA SPA	20,671	24.15	499,204.65
BOLLORE	39,433	3.90	153,788.70
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	14.09	130,473.40
DEUTSCHE POST AG-REG	43,007	30.46	1,310,208.25
FRAPORT AG	1,856	77.22	143,320.32

GETLINK	16,953	13.18	223,440.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,395	63.22	910,051.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	51.15	128,284.20
CONTINENTAL AG	4,655	121.64	566,234.20
DAIMLER AG	37,706	46.45	1,751,443.70
FAURECIA	3,127	46.10	144,154.70
FERRARI NV	4,915	146.30	719,064.50
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,256	12.72	639,256.32
MICHELIN (CGDE)-B	7,374	102.75	757,678.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	25.78	141,970.46
PIRELLI & C SPA	17,484	5.35	93,574.36
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	60.66	401,811.84
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	22.87	597,387.27
RENAULT SA	8,830	56.45	498,453.50
VALEO SA	9,959	29.88	297,574.92
VOLKSWAGEN AG	1,256	156.50	196,564.00
VOLKSWAGEN AG PFD	8,203	154.08	1,263,918.24
ADIDAS AG	7,513	277.05	2,081,476.65
ESSILORLUXOTTICA	12,097	132.45	1,602,247.65
HERMES INTERNATIONAL	1,279	645.00	824,955.00
HUGO BOSS AG	2,376	51.68	122,791.68
KERING	3,129	449.20	1,405,546.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,815	378.95	4,477,294.25
MONCLER SPA	7,711	35.49	273,663.39
PUMA SE	3,830	67.35	257,950.50
SEB SA	1,032	144.50	149,124.00
ACCOR SA	7,551	40.00	302,040.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,636	78.40	285,062.40
SODEXO	3,900	100.55	392,145.00
AXEL SPRINGER SE-TEND	2,343	63.00	147,609.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	16.84	146,989.47
JC DECAUX SA	2,828	24.30	68,720.40
PUBLICIS GROUPE	9,116	44.42	404,932.72
RTL GROUP	1,615	43.88	70,866.20
SES	17,687	13.98	247,352.69
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	43.28	94,393.68
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	70.50	248,371.50
VIVENDI SA	37,213	25.08	933,302.04
DELIVERY HERO SE	5,334	45.36	241,950.24
INDITEX	47,526	28.79	1,368,273.54
ZALANDO SE	5,372	46.86	251,731.92
CARREFOUR SA	26,320	16.48	433,753.60

CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	42.02	77,022.66
COLRUYT NV	2,472	47.18	116,628.96
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	10,211	15.61	159,393.71
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	50,349	21.70	1,092,573.30
METRO AG	8,344	14.29	119,235.76
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,410	86.06	2,789,204.60
DANONE	26,225	80.00	2,098,000.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	8.47	194,569.05
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	89.45	473,369.40
HEINEKEN NV	11,026	95.80	1,056,290.80
KERRY GROUP PLC-A	6,680	108.00	721,440.00
PERNOD-RICARD SA	8,760	168.65	1,477,374.00
REMY COINTREAU	1,273	133.70	170,200.10
BEIERSDORF AG	3,896	111.40	434,014.40
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	85.50	400,225.50
HENKEL AG & CO KGAA	7,849	93.98	737,649.02
L'OREAL	10,737	249.30	2,676,734.10
UNILEVER NV	61,995	55.48	3,439,482.60
BIOMERIEUX	1,779	69.05	122,839.95
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	105.70	239,833.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	62.50	573,812.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,963	44.20	793,964.60
KONINKLIJKE PHILIPS NV	39,396	42.14	1,660,147.44
SARTORIUS AG-VORZUG	1,333	174.00	231,942.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	35.84	236,003.48
BAYER AG	38,983	67.26	2,621,996.58
EUROFINS SCIENTIFIC	484	408.40	197,665.60
GRIFOLS S.A.	11,605	27.40	317,977.00
IPSEN	1,498	88.20	132,123.60
MERCK KGAA	5,705	95.84	546,767.20
ORION OYJ	4,259	33.46	142,506.14
QIAGEN N.V.	10,011	30.43	304,634.73
RECORDATI SPA	4,578	38.22	174,971.16
SANOFI	47,223	79.26	3,742,894.98
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	133.00	206,815.00
UCB SA	5,244	66.92	350,928.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	17.34	328,098.02
AIB GROUP PLC	36,918	2.40	88,603.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,783	4.60	1,347,387.36
BANCO DE SABADELL SA	235,029	0.83	195,967.18
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	679,092	3.61	2,455,936.21

BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	3.80	143,146.00
BANKIA SA	48,396	1.72	83,700.88
BANKINTER,S.A.	36,405	5.63	205,032.96
BNP PARIBAS	48,776	43.71	2,131,998.96
CAIXABANK	149,132	2.20	329,134.32
COMMERZBANK AG	46,644	5.67	264,891.27
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	11.01	545,853.78
ERSTE GROUP BANK AG	13,217	30.22	399,417.74
FINECOBANK SPA	24,027	9.87	237,242.59
ING GROEP NV-CVA	160,736	9.33	1,500,309.82
INTESA SANPAOLO	625,949	2.10	1,315,431.82
KBC GROUPE SA	10,878	57.44	624,832.32
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.51	254,803.94
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	20.97	115,439.85
SOCIETE GENERALE	33,369	25.14	838,896.66
UNICREDIT SPA	88,548	10.93	968,538.02
AMUNDI SA	2,379	60.05	142,858.95
DEUTSCHE BANK AG -REG	85,363	7.32	625,540.06
DEUTSCHE BOERSE AG	8,181	136.10	1,113,434.10
EURAZEO	984	62.90	61,893.60
EXOR NV	4,683	64.76	303,271.08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	86.56	292,140.00
NATIXIS	45,362	3.64	165,117.68
WENDEL	1,082	124.40	134,600.80
AEGON NV	74,580	3.65	272,664.48
AGEAS	7,245	50.04	362,539.80
ALLIANZ SE-REG	17,843	206.65	3,687,255.95
ASSICURAZIONI GENERALI	45,785	17.20	787,502.00
AXA SA	81,141	21.96	1,782,262.06
CNP ASSURANCES	8,978	17.38	156,037.64
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,264	150.90	341,637.60
MAPFRE SA	46,367	2.49	115,592.93
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,340	226.80	1,437,912.00
NN GROUP NV	12,995	31.64	411,161.80
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.08	267,744.96
SAMPO OYJ-A SHS	19,253	37.76	726,993.28
SCOR SE	7,100	37.31	264,901.00
AROUNDTOWN SA	34,226	7.05	241,293.30
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,188	31.15	504,256.20
VONOVIA SE	21,475	42.20	906,245.00
ADYEN NV	435	650.40	282,924.00
AMADEUS IT GROUP SA	18,879	67.46	1,273,577.34

ATOS SE	4,547	68.58	311,833.26
CAPGEMINI SA	7,100	111.85	794,135.00
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	126.20	697,759.80
SAP SE	41,411	110.20	4,563,492.20
WIRECARD AG	5,104	156.90	800,817.60
WORLDLINE SA	2,851	60.75	173,198.25
INGENICO S.A.	2,691	89.48	240,790.68
NOKIA OYJ	237,565	4.53	1,077,119.71
1&1 DRILLISCH AG	2,188	30.12	65,902.56
CELLNEX TELECOM SA	8,175	36.48	298,224.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	139,885	15.03	2,103,031.09
ELISA OYJ	5,909	45.97	271,636.73
ILIAD SA	1,016	78.34	79,593.44
KONINKLIJKE KPN NV	151,952	2.83	430,024.16
ORANGE S.A.	86,822	13.45	1,168,190.01
PROXIMUS SA	6,313	25.61	161,675.93
TELECOM ITALIA SPA	305,588	0.49	152,732.88
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.47	120,309.51
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.39	96,622.44
TELEFONICA S.A.	200,863	6.66	1,337,747.58
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,439	33.93	184,545.27
E.ON SE	94,119	8.48	798,129.12
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,876	3.47	347,168.97
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	10.85	310,722.30
ENAGAS	10,471	19.45	203,660.95
ENDESA S.A.	12,944	23.37	302,501.28
ENEL SPA	345,951	6.54	2,264,249.29
ENGIE	78,100	13.38	1,045,368.50
FORTUM OYJ	20,170	20.30	409,451.00
IBERDROLA SA	251,097	9.23	2,317,625.31
INNOGY SE	5,851	44.90	262,709.90
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,414	22.83	283,411.62
RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	17.98	372,311.86
RWE AG	23,265	26.24	610,473.60
SNAM SPA	89,624	4.50	404,024.99
SUEZ	14,536	13.89	201,905.04
TERNA SPA	53,035	5.64	299,223.47
UNIPER SE	8,953	28.50	255,160.50
VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,481	21.99	472,367.19
VERBUND AG	3,268	51.45	168,138.60
ASML HOLDING NV	18,060	219.15	3,957,849.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	55,385	17.36	961,483.60

	STMICROELECTRONICS NV	28,042	17.64	494,801.09
	ユーロ 小計	8,339,768		165,499,288.19 (19,639,800,529)
英ポンド	BP PLC	861,735	5.04	4,350,038.28
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	186,957	22.76	4,256,076.10
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	159,314	22.67	3,612,444.95
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	3.94	128,778.38
	ANGLO AMERICAN PLC	44,819	18.55	831,571.72
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.96	174,251.19
	BHP GROUP PLC	87,919	17.58	1,545,967.69
	CRODA INTERNATIONAL PLC	4,978	47.82	238,047.96
	EVRAZ PLC	28,275	4.92	139,282.65
	FRESNILLO PLC	8,512	6.96	59,277.56
	GLENCORE PLC	477,908	2.42	1,160,121.67
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,093	31.14	252,016.02
	MONDI PLC	17,733	16.16	286,565.28
	RIO TINTO PLC	48,486	42.18	2,045,381.91
	ASHTREAD GROUP PLC	19,216	22.87	439,469.92
	BAE SYSTEMS PLC	133,650	5.61	750,043.80
	BUNZL PLC	13,431	20.76	278,827.56
	DCC PLC	4,734	71.22	337,155.48
	FERGUSON PLC	9,945	63.50	631,507.50
	MEGGITT PLC	36,960	6.36	235,361.28
	MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	2.00	425,585.16
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	67,497	7.86	530,796.40
	SMITHS GROUP PLC	18,742	16.75	313,928.50
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	81.10	298,853.50
	WEIR GROUP PLC/THE	9,222	15.25	140,635.50
	EXPERIAN PLC	39,187	25.75	1,009,065.25
	G4S PLC	74,291	1.86	138,292.69
	INTERTEK GROUP PLC	6,794	55.34	375,979.96
	RELX PLC	81,456	19.15	1,560,289.68
	RENTOKIL INITIAL PLC	69,919	4.48	313,656.63
	EASYJET PLC	7,630	9.40	71,752.52
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.94	236,190.78
	BURBERRY GROUP PLC	17,470	22.32	389,930.40
	PERSIMMON PLC	13,916	18.98	264,195.26
	TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.49	220,956.20
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	39.45	210,505.20
	CARNIVAL PLC	8,091	36.03	291,518.73
	COMPASS GROUP PLC	69,382	20.35	1,411,923.70
	GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.92	165,082.00

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,220	50.71	366,126.20
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	4.52	147,157.64
TUI AG-DI	17,636	8.48	149,694.36
WHITBREAD PLC	4,771	44.32	211,450.72
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.17	217,414.01
INFORMA PLC	54,642	8.44	461,615.61
ITV PLC	151,064	1.22	184,826.80
PEARSON PLC	30,241	8.59	259,891.15
WPP PLC	57,596	9.98	574,923.27
KINGFISHER PLC	109,678	2.02	221,549.56
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	1.96	139,881.67
NEXT PLC	5,182	60.40	312,992.80
OCADO GROUP PLC	16,083	13.42	215,914.27
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.00	128,785.08
TESCO PLC	426,993	2.30	984,645.85
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	1.87	188,865.66
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	23.05	386,571.55
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	97,565	28.95	2,824,994.57
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	27.15	236,313.60
DIAGEO PLC	102,619	33.77	3,465,956.72
IMPERIAL BRANDS PLC	39,951	21.36	853,353.36
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,442	63.16	1,859,556.72
UNILEVER PLC	47,506	50.63	2,405,228.78
NMC HEALTH PLC	3,733	28.26	105,494.58
SMITH & NEPHEW PLC	37,643	19.34	728,015.62
ASTRAZENECA PLC	56,392	70.04	3,949,695.68
GLAXOSMITHKLINE PLC	211,182	16.79	3,546,168.14
BARCLAYS PLC	752,904	1.40	1,059,938.25
HSBC HOLDINGS PLC	866,915	6.07	5,262,174.05
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,958,834	0.50	1,484,742.90
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	1.92	403,250.84
STANDARD CHARTERED PLC	125,623	6.59	828,106.81
3I GROUP PLC	37,819	11.42	431,892.98
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	19.72	217,669.36
INVESTEC PLC	33,008	4.54	149,988.35
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,752	70.80	902,841.60
SCHRODERS PLC	6,213	28.81	178,996.53
ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	9.68	211,358.06
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.55	261,923.54
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	20.64	161,858.88
AVIVA PLC	155,925	3.74	583,783.20
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.84	180,183.78



	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.36	589,198.63	
	PRUDENTIAL PLC	110,954	14.39	1,597,182.83	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.21	211,046.68	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	10.81	163,410.35	
	SAGE GROUP PLC/THE	40,695	6.92	281,934.96	
	HALMA PLC	16,787	19.76	331,711.12	
	BT GROUP PLC	365,274	1.69	617,605.27	
	VODAFONE GROUP PLC	1,122,507	1.55	1,745,722.88	
	CENTRICA PLC	254,915	0.67	172,832.37	
	NATIONAL GRID PLC	144,240	8.20	1,182,768.00	
	SEVERN TRENT PLC	9,868	19.86	196,027.82	
	SSE PLC	44,560	11.39	507,761.20	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	7.68	255,096.17	
	英ポンド 小計	12,778,242		75,419,416.34 (10,005,139,771)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	19.64	198,434.14	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	593.50	190,513.50	
	GIVAUDAN-REG	398	2,733.00	1,087,734.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,084	47.90	962,023.60	
	SIKA AG	5,689	147.20	837,420.80	
	ABB LTD	81,000	19.46	1,576,665.00	
	GEBERIT AG-REG	1,593	464.20	739,470.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	674	234.00	157,716.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	234.70	399,224.70	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	55.00	386,045.00	
	SGS SA	208	2,507.00	521,456.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	150.25	354,890.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	21,635	80.06	1,732,098.10	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	280.00	372,400.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	52.90	133,096.40	
	DUFREY AG-REG	1,465	83.80	122,767.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	2,046.00	223,014.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	7,330.00	329,850.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	81,500.00	326,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	130,284	110.80	14,435,467.20	
	ALCON INC	17,384	58.31	1,013,661.04	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	225.10	594,939.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	834.20	362,877.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	361.00	1,140,760.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	92,006	88.54	8,146,211.24	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	29,883	271.75	8,120,705.25	
	VIFOR PHARMA AG	1,781	157.35	280,240.35	

	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	113,020	12.49	1,411,619.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	42.60	407,170.80	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	74.65	139,371.55	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	736	809.80	596,012.80	
	UBS GROUP AG	166,641	10.98	1,829,718.18	
	BALOISE HOLDING AG	1,987	171.30	340,373.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	489.00	719,808.00	
	SWISS RE AG	12,559	101.75	1,277,878.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,470	371.20	2,401,664.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,252	97.30	316,419.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,827	171.25	484,123.75	
	SWISSCOM AG-REG	1,115	485.50	541,332.50	
	スイスフラン 小計	757,334		55,211,173.05 (5,977,161,594)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	306.20	2,092,570.80	
	BOLIDEN AB	11,543	237.40	2,740,308.20	
	ALFA LAVAL AB	13,939	186.50	2,599,623.50	
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	211.30	9,176,759.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,698	300.00	8,909,400.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,898	267.80	3,989,684.40	
	EPIROC AB-A	30,249	100.50	3,040,024.50	
	EPIROC AB-B	16,107	96.22	1,549,815.54	
	SANDVIK AB	51,127	146.45	7,487,549.15	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	189.45	2,976,448.95	
	SKF AB-B SHARES	16,642	164.35	2,735,112.70	
	VOLVO AB-B SHS	59,765	140.00	8,367,100.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	148.70	1,819,195.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,165	223.70	2,050,210.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	76.60	1,424,223.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	189.00	6,850,872.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	457.00	1,622,350.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	407.30	3,077,151.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	24,554	285.10	7,000,345.40	
	NORDEA BANK ABP	131,230	67.36	8,839,652.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	70,758	88.20	6,240,855.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,140	90.16	6,233,662.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	136.05	5,310,031.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	212.60	1,332,151.60	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	461.00	9,171,595.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	276.00	3,106,932.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	374.20	1,172,742.80	
	ERICSSON LM-B SHS	125,254	76.50	9,581,931.00	

	HEXAGON AB-B SHS	11,065	446.10	4,936,096.50
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	488.20	1,315,210.80
	TELE2 AB-B SHS	19,570	138.70	2,714,359.00
	TELIA CO AB	126,963	42.67	5,417,511.21
	スウェーデンクローナ 小計	1,058,098		144,881,477.95 (1,611,082,034)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	4,085	250.60	1,023,701.00
	EQUINOR ASA	44,124	165.35	7,295,903.40
	NORSK HYDRO ASA	60,434	31.87	1,926,031.58
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	401.20	3,005,790.40
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,930	253.20	995,076.00
	MOWI ASA	19,167	208.60	3,998,236.20
	ORKLA ASA	33,915	80.62	2,734,227.30
	DNB ASA	41,449	153.15	6,347,914.35
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,987	178.15	1,066,584.05
	TELENOR ASA	31,294	176.25	5,515,567.50
	ノルウェークローネ 小計	251,877		33,909,031.78 (408,264,742)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,920	580.80	2,276,736.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	291.40	2,974,319.80
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,635	524.00	4,000,740.00
	ISS A/S	8,523	171.45	1,461,268.35
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	7,365.00	1,237,320.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	7,832.00	2,310,440.00
	DSV A/S	8,815	685.60	6,043,564.00
	PANDORA A/S	4,763	306.20	1,458,430.60
	CARLSBERG AS-B	4,678	1,015.50	4,750,509.00
	COLOPLAST-B	4,991	797.00	3,977,827.00
	DEMANT A/S	4,455	195.75	872,066.25
	GENMAB A/S	2,773	1,391.50	3,858,629.50
	H LUNDBECK A/S	2,896	232.60	673,609.60
	NOVO NORDISK A/S-B	75,369	342.15	25,787,503.35
	DANSKE BANK A/S	29,784	99.48	2,962,912.32
	TRYG A/S	5,005	205.60	1,029,028.00
ORSTED A/S	7,682	651.00	5,000,982.00	
	デンマーククローネ 小計	181,959		70,675,885.77 (1,124,453,342)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,006	24.55	196,547.30
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.13	433,988.84
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	7.63	569,098.81
	SANTOS LTD	79,098	7.38	583,743.24
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	21.14	94,686.06

WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,965	31.73	1,299,819.45
WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	12.96	173,456.64
ALUMINA LTD	106,977	2.24	239,628.48
BHP GROUP LTD	123,408	36.13	4,458,731.04
BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	12.84	296,462.76
BORAL LIMITED	42,214	4.44	187,430.16
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	8.46	593,054.46
INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.27	200,630.85
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	23.43	437,930.13
NEWCREST MINING LIMITED	32,675	35.57	1,162,249.75
ORICA LIMITED	17,981	21.74	390,906.94
RIO TINTO LIMITED	15,921	90.31	1,437,825.51
SOUTH32 LTD	223,474	2.74	612,318.76
CIMIC GROUP LTD	4,062	32.36	131,446.32
BRAMBLES LIMITED	67,439	11.30	762,060.70
SEEK LIMITED	12,586	21.29	267,955.94
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	5.86	509,140.24
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,311	29.85	695,833.35
CROWN RESORTS LTD	16,521	12.20	201,556.20
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	48.41	128,286.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.79	356,251.46
REA GROUP LTD	1,734	107.70	186,751.80
HARVEY NORMAN HOLDING-RIGHTS-NEW	1,208	1.72	2,077.76
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.44	91,210.92
WESFARMERS LIMITED	49,461	39.67	1,962,117.87
COLES GROUP LIMITED	46,407	14.71	682,646.97
WOOLWORTHS GROUP LTD	53,538	37.95	2,031,767.10
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	11.01	258,096.42
TREASURY WINE ESTATES LTD	30,285	18.79	569,055.15
COCHLEAR LIMITED	2,350	213.94	502,759.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	63.85	394,273.75
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	29.33	618,305.73
CSL LIMITED	19,188	239.55	4,596,485.40
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	121,522	27.20	3,305,398.40
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	9.21	164,407.71
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	11.02	218,647.82
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	75,297	79.81	6,009,453.57
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	119,751	28.03	3,356,620.53
WESTPAC BANKING CORPORATION	144,135	28.85	4,158,294.75
AMP LIMITED	129,763	1.79	232,924.58
ASX LTD	9,287	85.57	794,688.59
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	7.01	161,384.22

	MACQUARIE GROUP LTD	14,246	127.72	1,819,499.12
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,442	53.45	237,424.90
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	8.19	827,206.38
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.50	450,534.00
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	12.57	731,913.39
	SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.77	721,176.21
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,825	15.80	360,635.00
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.60	611,031.60
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.77	120,221.66
	AGL ENERGY LIMITED	28,043	18.96	531,695.28
	AUSNET SERVICES	85,220	1.76	150,413.30
	オーストラリアドル 小計	2,923,572		53,280,158.77 (3,927,813,304)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	23,704	4.82	114,253.28
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	9.51	404,241.57
	A2 MILK CO LTD	32,033	14.89	476,971.37
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,343	17.51	426,245.93
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,236	13.30	202,638.80
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.70	413,555.38
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,184	5.44	316,520.96
	ニュージーランドドル 小計	283,904		2,354,427.29 (162,690,925)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	114,924	71.20	8,182,588.80
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	13.74	954,930.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	56.35	3,155,600.00
	MTR CORPORATION	67,000	46.35	3,105,450.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	21.95	592,650.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	93,000	52.75	4,905,750.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	12.52	550,880.00
	SANDS CHINA LTD	96,800	37.55	3,634,840.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	8.00	512,000.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.77	621,600.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	16.58	1,173,864.00
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	38.00	1,596,000.00
	WH GROUP LIMITED	397,500	6.87	2,730,825.00
	BANK OF EAST ASIA	52,820	19.90	1,051,118.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	27.20	4,270,400.00
	HANG SENG BANK LTD	33,100	170.00	5,627,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,800	249.40	12,918,920.00
	AIA GROUP LTD	513,000	79.70	40,886,100.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	103,424	55.90	5,781,401.60
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.10	1,773,800.00

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,384	37.55	2,380,069.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	31.15	903,350.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	25.45	699,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	10.12	2,644,689.96	
	SINO LAND CO	124,200	11.60	1,440,720.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	114.20	7,994,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	16,500	76.50	1,262,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	26.25	1,391,250.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	17.04	1,005,360.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	44.15	2,119,200.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	33,000	46.80	1,544,400.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.36	845,840.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	52.50	1,575,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	68,100	81.15	5,526,315.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.57	840,270.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	437,014	15.58	6,808,678.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	52.65	3,159,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	97.25	1,196,175.00	
	香港ドル 小計	3,928,999		147,362,159.68 (2,020,335,209)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.04	353,944.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.15	93,998.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.98	271,834.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.98	88,200.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.50	291,750.00	
	SATS LTD	26,800	4.88	130,784.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.04	226,596.64	
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	0.90	252,630.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	1.99	137,409.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	30.52	143,444.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.26	93,704.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.81	266,319.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	24.77	1,904,813.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	133,800	10.82	1,447,716.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	51,100	25.54	1,305,094.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	8.54	304,024.00	
	CAPITALAND LTD	104,500	3.54	369,930.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	9.71	156,331.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.47	162,099.00	
	VENTURE CORP LTD	11,900	15.40	183,260.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	350,615	3.22	1,128,980.30	
		2,009,351		9,312,860.44	

シンガポールドル 小計				(724,726,799)
イスラエルシケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	16.56	475,454.16
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	555.00	446,775.00
	BANK HAPOALIM BM	44,062	26.96	1,187,911.52
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	24.08	1,579,021.92
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	14.48	791,679.52
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	82.77	450,434.34
	AZRIELI GROUP	2,140	256.20	548,268.00
	NICE LTD	2,768	542.70	1,502,193.60
イスラエルシケル 小計		204,176		6,981,738.06 (212,663,741)
合 計		47,327,155		168,596,815,846 (168,596,815,846)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 613銘柄	65.3%	69.0%
カナダドル	株式 87銘柄	3.6%	3.9%
ユーロ	株式 240銘柄	11.0%	11.6%
英ポンド	株式 94銘柄	5.6%	5.9%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.4%	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	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシケル	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	390,126.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,988	760,919.40	
		AMERICAN TOWER CORP	18,764	4,203,136.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	65,636	550,029.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,317,500.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,984	910,434.24	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	468,062.28	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,949	1,146,277.41	
	DUKE REALTY CORP	13,847	459,166.52	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,267	433,204.20	
	EQUITY RESIDENTIAL	16,404	1,396,144.44	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,824	919,692.08	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	639,303.40	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	435,014.32	
	HCP, INC.	20,162	709,904.02	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	549,645.52	
	INVITATION HOMES INC	19,405	550,325.80	
	IRON MOUNTAIN INC	12,165	406,675.95	
	KIMCO REALTY CORPORATION	15,421	304,718.96	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	352,807.56	
	MACERICH COMPANY/THE	3,806	120,840.50	
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	611,436.32	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	356,537.12	
	PROLOGIS INC	26,231	2,219,929.53	
	PUBLIC STORAGE	6,909	1,760,482.29	
	REALTY INCOME CORPORATION	13,440	1,011,360.00	
	REGENCY CENTERS CORP	7,994	546,709.66	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,474	2,131,721.54	
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	326,330.40	
	SUN COMMUNITIES INC	3,889	559,393.76	
	UDR INC	12,978	628,524.54	
	VENTAS INC	14,809	1,094,829.37	
	VEREIT INC	44,740	431,741.00	
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	477,620.46	
	WELLTOWER INC	17,248	1,555,942.08	
	WEYERHAEUSER CO	29,854	802,475.52	
	WP CAREY INC	7,258	648,647.46	
	米ドル 小計	517,576	32,187,611.01	(3,458,558,803)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	86,445.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	193,466.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	114,361.50	
	カナダドル 小計	14,851	394,272.50	(32,152,922)
ユーロ	COVIVIO	2,388	226,143.60	
	GECINA SA	1,738	241,929.60	
	ICADE	1,265	99,871.75	



	KLEPIERRE	9,305	259,423.40
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,539	662,464.40
	ユーロ 小計	20,235	1,489,832.75 (176,798,452)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	232,633.38
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	253,709.87
	SEGRO PLC	40,873	318,809.40
	英ポンド 小計	118,538	805,152.65 (106,811,550)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,738	542,453.94
	DEXUS	44,028	559,595.88
	GOODMAN GROUP	75,399	1,044,276.15
	GPT GROUP	68,818	435,617.94
	LENLEASE GROUP	25,262	428,696.14
	MIRVAC GROUP	144,537	446,619.33
	SCENTRE GROUP	234,290	932,474.20
	STOCKLAND	103,417	462,273.99
	SYDNEY AIRPORT	49,760	411,017.60
	TRANSURBAN GROUP	115,217	1,709,820.28
	VICINITY CENTRES	146,656	379,839.04
	オーストラリアドル 小計	1,056,122	7,352,684.49 (542,039,900)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	170,000	2,172,600.00
	LINK REIT	92,500	8,204,750.00
	香港ドル 小計	262,500	10,377,350.00 (142,273,468)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	375,011.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	280,360.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	276,532.00
	SUNTEC REIT	64,600	125,324.00
	シンガポールドル 小計	416,100	1,057,227.00 (82,273,405)
	合計		4,540,908,500 (4,540,908,500)

(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 37銘柄	1.9%	76.2%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.7%
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%	2.4%
オーストラリアドル	投資証券	11銘柄	0.3%	11.9%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	3.1%
シンガポールドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.8%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### エマージング株式インデックス・マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	15,938,627	140,143,911
コール・ローン	1,529,056,213	2,749,843,134
株式	1,924,420,088	3,398,000,779
投資信託受益証券	116,426,620	318,320,512
投資証券	10,336,664	116,455,570
派生商品評価勘定	2,773	50,715,518
未収入金	33,568,320	44,714
未収配当金	3,520,021	4,472,117
前払金	184,261,386	-
差入委託証拠金	381,098,089	582,977,998
<b>流動資産合計</b>	<b>4,198,628,801</b>	<b>7,360,974,253</b>
<b>資産合計</b>	<b>4,198,628,801</b>	<b>7,360,974,253</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	185,766,484	47,989,704
前受金	-	33,904,773
未払金	7,609,262	39,177
未払解約金	81,005	3,384,498
未払利息	4,147	5,701
その他未払費用	74,990	40,250
<b>流動負債合計</b>	<b>193,535,888</b>	<b>85,364,103</b>
<b>負債合計</b>	<b>193,535,888</b>	<b>85,364,103</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,097,381,640	5,738,111,812
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	907,711,273	1,537,498,338
<b>元本等合計</b>	<b>4,005,092,913</b>	<b>7,275,610,150</b>
<b>純資産合計</b>	<b>4,005,092,913</b>	<b>7,275,610,150</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>4,198,628,801</b>	<b>7,360,974,253</b>

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,097,381,640口	5,738,111,812口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2931円 (10,000口当たりの純資産額 12,931円)	1口当たり純資産額 1.2679円 (10,000口当たりの純資産額 12,679円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
----	--------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,137,766,418	-	1,953,505,032	184,261,386
	MSCIE 1809	2,137,766,418	-	1,953,505,032	184,261,386
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,555,701,416	-	1,554,199,119	1,502,297
	米ドル	1,555,701,416	-	1,554,199,119	1,502,297
	売建	1,416	-	1,444	28
	ブラジルリアル	1,416	-	1,444	28
	合計	3,693,469,250	-	3,507,705,595	185,763,711

(令和 1年 9月10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				

市場取引以外の取引	買建	3,410,757,950	-	3,444,662,723	33,904,773
	MSCIE 1909	3,410,757,950	-	3,444,662,723	33,904,773
	為替予約取引				
	買建	4,838,700,000	-	4,827,029,149	11,670,851
	米ドル	4,838,700,000	-	4,827,029,149	11,670,851
	売建	2,106,000,000	-	2,125,508,108	19,508,108
	米ドル	2,106,000,000	-	2,125,508,108	19,508,108
	合計	10,355,457,950	-	10,397,199,980	2,725,814

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成30年 9月10日現在)
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	2,821,376,527円
同期中における追加設定元本額	3,679,942,724円
同期中における一部解約元本額	3,403,937,611円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	761,334,203円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,173,072,587円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	90,133,963円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,834,614円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	450,727,576円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,287,680円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,182,801円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,853,495円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	12,007,107円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	13,293,134円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	59,593,985円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,621,325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>	19,439,170円
合計	3,097,381,640円

(令和 1年 9月10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	3,097,381,640円
同期中における追加設定元本額	4,419,235,844円
同期中における一部解約元本額	1,778,505,672円
令和 1年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,604,964,932円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,589,415,686円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	758,605,964円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	762,934,126円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	713,992,914円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,921,629円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	22,116,255円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,881,004円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	64,006,148円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,165,084円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	102,147,560円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,577,205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>	22,383,305円
合計	5,738,111,812円

附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	6,800	0.93	6,358.00	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	406	8.07	3,276.42	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,176	8.91	10,478.16	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	1,413	14.16	20,008.08	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	557	33.60	18,715.20	
	51JOB INC-ADR	189	72.07	13,621.23	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,178	20.83	45,367.74	
	NIO INC-ADR	4,302	3.14	13,508.28	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	868	36.62	31,786.16	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	933	112.00	104,496.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	2,526	35.56	89,824.56	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,355	45.67	107,552.85	
	58.COM INC-ADR	619	55.00	34,045.00	
	AUTOHOME INC-ADR	388	93.78	36,386.64	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,822	105.06	191,419.32	
	IQIYI INC-ADR	796	18.33	14,590.68	
	MOMO INC-SPON ADR	934	36.29	33,894.86	
	NETEASE.COM INC -ADR	459	280.34	128,676.06	
	SINA CORP	401	45.47	18,233.47	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	483	12.96	6,259.68	
	WEIBO CORP-SPON ADR	349	49.61	17,313.89	
	YY INC-ADR	369	57.74	21,306.06	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	9,320	177.78	1,656,909.60	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	263	48.10	12,650.30	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	2,721	35.11	95,534.31	
	JD.COM INC-ADR	4,836	31.48	152,237.28	
	PINDUODUO INC-ADR	1,266	34.98	44,284.68	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	2,866	8.95	25,650.70	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	475	21.64	10,279.00	
	BANCO MACRO SA-ADR	320	24.63	7,881.60	
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	373	4.40	1,641.20	
	CREDICORP LTD	444	211.72	94,003.68	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	709	11.80	8,366.20	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	231	31.03	7,167.93		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	1.15	8,177.40		
GDS HOLDINGS LTD-ADR	387	40.99	15,863.13		
GLOBANT SA	226	90.04	20,349.04		



	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	544	9.64	5,244.16
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	433	14.89	6,447.37
	米ドル 小計	62,817		3,139,805.92 (337,372,146)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	99,200	7.70	763,840.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	23,000	44.30	1,018,900.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	740	245.15	181,411.00
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	5,600	38.92	217,952.00
	ALFA S.A.B. -A	22,000	17.12	376,640.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	57.41	206,676.00
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,485	291.96	433,560.60
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	2,500	185.96	464,900.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,750	173.73	304,027.50
	ALSEA SAB DE CV	3,800	42.80	162,640.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	15,800	35.85	566,430.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	1,584	76.64	121,397.76
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	1,600	105.76	169,216.00
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	34,300	58.02	1,990,086.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,900	106.45	308,705.00
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	3,400	120.11	408,374.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	12,700	182.88	2,322,576.00
	GRUMA S.A.B. -B	1,130	187.77	212,180.10
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	10,700	36.91	394,937.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	39.91	399,100.00
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	17,000	109.07	1,854,190.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	15,000	25.26	378,900.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	220,600	14.15	3,121,490.00	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	2,900	83.91	243,339.00	
	メキシコペソ 小計	513,289		16,621,467.96 (91,251,859)
ブラジルリアル	COSAN SA	900	52.48	47,232.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	19,500	29.77	580,515.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	27,500	26.93	740,575.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	4,700	18.32	86,104.00
	BRASKEM SA-PREF A	900	29.74	26,766.00
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	3,300	14.52	47,916.00
	GERDAU S.A.-PREF	7,100	13.11	93,081.00
	SUZANO SA	3,615	31.62	114,306.30
	VALE SA	20,800	47.89	996,112.00
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	5,000	18.31	91,550.00
	WEG SA	5,830	22.58	131,641.40
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	8,400	16.41	137,844.00

LOCALIZA RENT A CAR SA	4,000	45.52	182,080.00	
RUMO SA	7,500	23.16	173,700.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	10,400	10.35	107,640.00	
B2W CIA DIGITAL	1,561	43.50	67,903.50	
LOJAS AMERICANAS SA	5,300	18.45	97,785.00	
LOJAS RENNER S.A.	5,380	49.49	266,256.20	
MAGAZINE LUIZA SA	4,100	34.20	140,220.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	4,800	27.68	132,864.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	2,100	20.74	43,554.00	
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	1,000	83.23	83,230.00	
RAIA DROGASIL SA	1,500	90.82	136,230.00	
AMBEV SA	30,900	18.87	583,083.00	
BRF-BRASIL FOODS SA	3,700	36.95	136,715.00	
JBS SA	7,200	29.00	208,800.00	
M DIAS BRANCO SA	400	36.32	14,528.00	
NATURA COSMETICOS SA	1,300	64.78	84,214.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	2,400	52.49	125,976.00	
HYPERMARCAS SA	2,700	32.54	87,858.00	
BANCO BRADESCO S.A.-PREF	26,384	35.04	924,495.36	
BANCO BRADESCO SA	7,908	31.72	250,841.76	
BANCO DO BRASIL S.A.	5,600	50.00	280,000.00	
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	31,800	36.03	1,145,754.00	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	28,980	13.11	379,927.80	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,400	50.56	70,784.00	
BM&F BOVESPA SA	13,500	43.82	591,570.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	4,600	32.43	149,178.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,500	103.56	155,340.00	
PORTO SEGURO SA	600	56.09	33,654.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	4,400	13.23	58,212.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	1,500	25.54	38,310.00	
CIELO SA	6,500	7.49	48,685.00	
TELEFONICA BRASIL SA	2,900	52.99	153,671.00	
TIM PARTICIPACOES SA	5,600	11.50	64,400.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	1,200	44.98	53,976.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	1,600	46.33	74,128.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	6,000	14.47	86,820.00	
COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	2,200	49.56	109,032.00	
ENERGISA SA-UNITS	1,100	45.85	50,435.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,350	43.75	59,062.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,100	94.55	104,005.00	
ブラジルリアル 小計	361,508		10,648,560.82 (279,205,264)	

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,630	6,724.90	17,686,487.00
	EMPRESAS CMPC SA	5,931	1,665.00	9,875,115.00
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	661	17,920.00	11,845,120.00
	LATAM AIRLINES GROUP	1,729	6,315.00	10,918,635.00
	S.A.C.I. FALABELLA	5,234	4,090.10	21,407,583.40
	CENCOSUD SA	8,340	1,135.00	9,465,900.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	883	8,238.40	7,274,507.20
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,886	2,239.00	4,222,754.00
	BANCO DE CHILE	297,936	103.25	30,761,892.00
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	353	45,498.00	16,060,794.00
	BANCO SANTANDER CHILE	432,287	50.87	21,990,439.69
	ITAU CORPBANCA	1,230,978	5.48	6,756,838.24
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,200	6,060.00	7,272,000.00
	AGUAS ANDINAS SA-A	20,335	392.00	7,971,320.00
	COLBUN SA	61,705	134.26	8,284,513.30
ENEL AMERICAS SA	260,174	120.01	31,223,481.74	
ENEL CHILE SA	161,886	62.00	10,036,932.00	
チリペソ 小計		2,494,148		233,054,312.57 (35,028,063)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	34,192	2,865.00	97,960,080.00
	CEMENTOS ARGOS SA	3,792	7,710.00	29,236,320.00
	GRUPO ARGOS SA	2,250	18,460.00	41,535,000.00
	BANCOLOMBIA SA	1,342	38,680.00	51,908,560.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,101	41,700.00	129,311,700.00
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	20,785	1,270.00	26,396,950.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,345	33,960.00	45,676,200.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	414	31,400.00	12,999,600.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,245	19,380.00	62,888,100.00
コロンビアペソ 小計		70,466		497,912,510.00 (15,883,409)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	344	21.06	7,244.64
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	334	18.44	6,158.96
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40
	OPAP SA	1,325	9.87	13,084.37
	JUMBO S.A.	663	16.86	11,178.18
	ALPHA BANK AE	9,474	1.60	15,224.71
	EUROBANK ERGASIAS SA	19,175	0.80	15,455.05
	NATIONAL BANK OF GREECE	4,254	2.54	10,805.16
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,414	12.27	17,349.78
ユーロ 小計		37,106		97,091.25 (11,521,818)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	717	131.50	94,285.50

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,241	6.84	56,368.44
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,111	19.32	40,784.52
	KOC HOLDING AS	4,446	18.12	80,561.52
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	2,885	4.56	13,155.60
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	599	24.12	14,447.88
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	11.84	52,960.32
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	59.05	15,175.85
	ARCELIK AS	866	18.10	15,674.60
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,989	48.54	145,086.06
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	23.90	18,140.10
	AKBANK T.A.S.	20,175	7.33	147,882.75
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,240	9.46	153,630.40
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	5.95	57,601.95
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,157	8.92	63,840.44
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	6,378	13.13	83,743.14
	トルコリラ 小計	87,974		1,053,339.07 (19,707,973)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	547	811.00	443,617.00
	MONETA MONEY BANK AS	2,580	75.40	194,532.00
	CEZ AS	1,135	516.00	585,660.00
	チェココルナ 小計	4,262		1,223,809.00 (5,617,283)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	2,859	2,964.00	8,474,076.00
	RICHTER GEDEON NYRT	743	4,940.00	3,670,420.00
	OTP BANK PLC	1,495	12,600.00	18,837,000.00
	ハンガリーフォリント 小計	5,097		30,981,496.00 (11,119,258)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	546	85.06	46,442.76
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,037	91.20	185,774.40
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	9,982	4.80	47,973.49
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	194	28.20	5,470.80
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	797	80.42	64,094.74
	CCC SA	106	144.00	15,264.00
	LPP SA	9	7,305.00	65,745.00
	CD PROJEKT SA	469	260.00	121,940.00
	CYFROWY POLSAT SA	1,573	28.54	44,893.42
	DINO POLSKA SA	366	147.40	53,948.40
	ALIOR BANK SA	331	40.46	13,392.26
	BANK MILLENNIUM SA	4,887	6.59	32,229.76
	BANK PEKAO SA	1,187	105.55	125,287.85
	MBANK SA	79	326.00	25,754.00
	PKO BANK POLSKI SA	5,905	41.17	243,108.85

	SANTANDER BANK POLSKA SA	253	305.00	77,165.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,138	37.80	156,416.40
	ORANGE POLSKA SA	4,301	5.98	25,719.98
	PGE SA	4,933	8.11	40,016.49
	ポーランドズロチ 小計	42,093		1,390,637.60 (38,075,657)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	11,000	3.19	35,090.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	10,000	9.72	97,200.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	170,000	4.68	795,600.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	23,000	16.44	378,120.00
	CNOOC LTD	117,000	12.02	1,406,340.00
	PETROCHINA CO LTD	138,000	4.12	568,560.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	10,000	8.21	82,100.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	20,000	2.49	49,800.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	5,200	2.91	15,132.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	8,500	47.60	404,600.00
	BBMG CORPORATION - H	9,000	2.33	20,970.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	5.32	61,180.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	21,000	2.50	52,500.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	28,000	7.25	203,000.00
	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	4,000	3.05	12,200.00
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	18,000	7.70	138,600.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	8,800	3.23	28,424.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	7,000	9.20	64,400.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	4.30	25,800.00
	MAANSHAN IRON&STEEL-H	6,000	2.96	17,760.00
	MMG LIMITED	12,000	1.86	22,320.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	9,000	6.72	60,480.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	2.34	42,120.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	5,500	9.42	51,810.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	42,000	2.80	117,600.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	13,000	4.29	55,770.00
	BOC AVIATION LTD	1,300	72.20	93,860.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	31,000	6.23	193,130.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	4.80	57,600.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	11,000	28.55	314,050.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	28,000	5.21	145,880.00
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	14,500	9.33	135,285.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	12,000	7.35	88,200.00
	CITIC LIMITED	40,000	9.70	388,000.00
	CRRC CORP LTD-H	31,000	5.57	172,670.00
	FOSUN INTERNATIONAL	18,000	10.54	189,720.00

HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	17.20	68,800.00
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	1.81	19,910.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	10,000	2.57	25,700.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	15.48	30,960.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	7,500	4.88	36,600.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	3,500	12.10	42,350.00
WEICHAO POWER CO	14,000	12.80	179,200.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	9.99	66,113.82
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC CO LTD	4,000	33.00	132,000.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	26,000	6.19	160,940.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	8,000	23.30	186,400.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	10,000	7.63	76,300.00
AIR CHINA/HONG KONG	10,000	7.15	71,500.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	10,000	6.80	68,000.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	22,000	2.91	64,020.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	6,000	4.05	24,300.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	10,140	12.28	124,519.20
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	4.33	34,640.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	4.80	38,400.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	10,000	6.72	67,200.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	10.30	103,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	5,500	15.10	83,050.00
SINOTRANS LIMITED	8,000	2.57	20,560.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	6.58	78,960.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	6,500	4.80	31,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	22,000	8.83	194,260.00
BYD CO LTD-H	4,500	41.95	188,775.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	18,000	2.71	48,780.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	20,000	7.44	148,800.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,800	22.70	63,560.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	34,000	13.42	456,280.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	16,500	5.38	88,770.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	21,200	8.05	170,660.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	5,000	6.54	32,700.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	7,000	63.05	441,350.00
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	26,000	3.15	81,900.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	9,000	21.05	189,450.00
LI NING COMPANY LIMITED	13,500	23.10	311,850.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	5,000	110.70	553,500.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	3,000	11.10	33,300.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	34.85	104,550.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	1.29	141,900.00

CHINA LITERATURE LTD	1,400	25.05	35,070.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	37,500	342.40	12,840,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.72	28,080.00
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	120,000	0.13	15,960.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	6,800	72.45	492,660.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	3,000	24.85	74,550.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	17,500	7.68	134,400.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	11,000	2.24	24,640.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	18,000	30.55	549,900.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	10,000	42.45	424,500.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	11,000	5.12	56,320.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	11.22	157,080.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	49.80	99,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	8,000	8.95	71,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	33,000	6.47	213,510.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	47.25	141,750.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	4,500	53.00	238,500.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	24,000	7.27	174,480.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	12,000	8.68	104,160.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	4,600	14.72	67,712.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	8,400	26.60	223,440.00
3SBIO INC	7,000	12.18	85,260.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	10,000	9.32	93,200.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	32,000	15.54	497,280.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	7.78	93,360.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	12,000	4.03	48,360.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	17.76	106,560.00
LUYE PHARMA GROUP	9,500	6.11	58,045.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	3,000	23.40	70,200.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	14,000	1.38	19,320.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	47,000	10.94	514,180.00
SSY GROUP LIMITED	10,000	6.83	68,300.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	3,000	8.28	24,840.00
WUXI APPTec CO LTD	840	82.50	69,300.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,000	82.60	330,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	191,000	3.08	588,280.00
BANK OF CHINA LTD	521,000	3.09	1,609,890.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	57,000	5.33	303,810.00
CHINA CITIC BANK	59,000	4.20	247,800.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	632,000	6.03	3,810,960.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	21,000	3.45	72,450.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	25,500	37.80	963,900.00

CHINA MINSHENG BANKING-H	46,600	5.34	248,844.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	13,000	4.15	53,950.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	427,000	5.19	2,216,130.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	52,000	4.80	249,600.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	47,000	1.64	77,080.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	8,000	23.08	184,640.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	4,000	9.36	37,440.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	18,500	4.39	81,215.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	53,000	1.23	65,190.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	8,000	14.94	119,520.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	13,500	15.80	213,300.00
FAR EAST HORIZON LTD	12,000	7.31	87,720.00
GF SECURITIES CO LTD-H	7,600	8.87	67,412.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	5,000	12.42	62,100.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	18,800	8.66	162,808.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	10,800	12.78	138,024.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	49,000	18.96	929,040.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	17,200	32.50	559,000.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	1.28	38,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	10,600	18.64	197,584.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	5,400	33.15	179,010.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	54,000	3.22	173,880.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	46,000	9.28	426,880.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	36,500	93.50	3,412,750.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,200	19.08	22,896.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	8,000	9.50	76,000.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	9.17	82,530.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	13,000	17.04	221,520.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	36,000	4.58	164,880.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	26,000	25.35	659,100.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	18,000	32.70	588,600.00
CHINA VANKE CO LTD -H	10,300	28.05	288,915.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	14,000	4.45	62,300.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	51,000	10.26	523,260.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	10,000	6.16	61,600.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	6,000	12.76	76,560.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	3.04	63,840.00
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	8,000	7.10	56,800.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	10,000	11.12	111,200.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	12,000	28.40	340,800.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	16,000	2.94	47,040.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	8,000	22.10	176,800.00



SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.64	22,140.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	2.77	52,630.00
SOHO CHINA LTD	7,500	2.37	17,775.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	16,000	32.85	525,600.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	44,000	1.73	76,120.00
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	6,000	3.42	20,520.00
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	17,000	8.30	141,100.00
KINGSOFT CORPORATION LTD.	4,000	17.32	69,280.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	5,000	16.50	82,500.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	5,000	40.35	201,750.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,500	11.12	61,160.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	4.90	49,000.00
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	3,500	20.50	71,750.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	6.98	48,860.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	2,000	17.48	34,960.00
LENOVO GROUP LTD	50,000	5.53	276,500.00
MEITU INC	11,500	1.87	21,505.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	4,700	117.50	552,250.00
XIAOMI CORP-CLASS B	52,800	9.13	482,064.00
ZTE CORPORATION	4,000	23.50	94,000.00
CHINA MOBILE LTD	40,500	66.00	2,673,000.00
CHINA TELECOM CORP LTD	90,000	3.59	323,100.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	276,000	1.90	524,400.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	40,000	8.04	321,600.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	3,500	37.55	131,425.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	36,000	4.26	153,360.00
CGN POWER CO LTD-H	70,000	2.05	143,500.00
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	12,400	30.15	373,860.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	17,000	4.47	75,990.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.71	63,270.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	6,000	38.15	228,900.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	12,000	10.34	124,080.00
DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	1.68	20,160.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,300	79.40	420,820.00
GUANGDONG INVESTMENT	20,000	16.42	328,400.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	12,000	3.16	37,920.00
HUANENG POWER INTL INC-H	22,000	4.29	94,380.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	30,000	2.66	79,800.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	24,000	6.86	164,640.00
TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	6.06	24,240.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	2,000	15.66	31,320.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	20,000	9.89	197,800.00

	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	24,000	5.00	120,000.00
	香港ドル 小計	5,923,798		60,678,073.02 (831,896,381)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	21,300	3.52	74,976.00
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,900	22.58	42,902.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	16,800	7.00	117,600.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	8,700	4.89	42,543.00
	GAMUDA BHD	13,300	3.50	46,550.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	3,900	9.75	38,025.00
	IJM CORP BHD	18,500	2.22	41,070.00
	SIME DARBY BERHAD	13,100	2.30	30,130.00
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	1.82	10,010.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	5,600	8.50	47,600.00
	MISC BHD	8,300	7.75	64,325.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	4.10	15,170.00
	GENTING BHD	15,200	5.87	89,224.00
	GENTING MALAYSIA BHD	17,500	3.17	55,475.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	19.10	9,550.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	35.38	42,456.00
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	9.75	8,775.00
	IOI CORPORATION BERHAD	14,000	4.40	61,600.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	2,500	23.58	58,950.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	400	146.70	58,680.00
	PPB GROUP BERHAD	4,140	18.50	76,590.00
	QL RESOURCES BHD	5,300	6.90	36,570.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	15,000	4.87	73,050.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	8,000	5.16	41,280.00
	IHH HEALTHCARE BHD	15,600	5.80	90,480.00
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	8,700	4.71	40,977.00
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	3,700	3.00	11,100.00
	AMMB HOLDINGS BERHAD	10,100	4.16	42,016.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	33,300	5.03	167,499.00
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,700	16.32	76,704.00
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.30	30,970.00
MALAYAN BANKING BERHAD	26,200	8.75	229,250.00	
PUBLIC BANK BERHAD	20,700	20.20	418,140.00	
RHB BANK BHD	11,800	5.66	66,788.00	
SIME DARBY PROPERTY BHD	8,700	0.85	7,395.00	
SP SETIA BHD	5,500	1.43	7,865.00	
AXIATA GROUP BERHAD	15,900	4.88	77,592.00	
DIGI.COM BHD	21,800	4.89	106,602.00	
MAXIS BERHAD	13,500	5.55	74,925.00	

	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,200	3.47	28,454.00	
	PETRONAS GAS BHD	4,300	16.06	69,058.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	21,000	13.82	290,220.00	
	YTL CORP BHD	16,000	0.97	15,520.00	
	マレーシアリングット 小計	456,840		3,034,656.00	(78,172,738)
タイパーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	22,900	12.70	290,830.00	
	IRPC PCL-NVDR	53,200	3.84	204,288.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	9,100	124.00	1,128,400.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	74,900	45.00	3,370,500.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	6,600	68.75	453,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	9,000	35.25	317,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	14,800	52.50	777,000.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	5,100	424.00	2,162,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	28,800	74.25	2,138,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	54,700	11.30	618,110.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	46,800	13.90	650,520.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	19,400	38.50	746,900.00	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	41,800	18.60	777,480.00	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	4,100	64.25	263,425.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	7,300	54.50	397,850.00	
	CP ALL PCL-NVDR	38,300	84.25	3,226,775.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	25,400	29.00	736,600.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	21,900	17.30	378,870.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	63,700	24.50	1,560,650.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	3,200	140.00	448,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	3,100	168.50	522,350.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	7,700	160.50	1,235,850.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	5,500	160.50	882,750.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	18,600	17.30	321,780.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	5,600	115.50	646,800.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	40,100	1.55	62,155.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,200	57.25	240,450.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	14,700	67.75	995,925.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	54,800	10.60	580,880.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	7,800	235.00	1,833,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,700	68.00	999,600.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	60.00	276,000.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	76,500	5.80	443,700.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	1,900	355.00	674,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	11,000	50.00	550,000.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	3,500	159.00	556,500.00	

	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	4,800	75.25	361,200.00	
	タイパーツ 小計	830,100		31,831,438.00 (111,410,033)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	11,650	52.70	613,955.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	15,000	12.20	183,000.00	
	AYALA CORPORATION	1,940	907.00	1,759,580.00	
	DMCI HOLDINGS INC	14,600	8.85	129,210.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	600	921.00	552,600.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	20,070	72.00	1,445,040.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,665	1,030.00	1,714,950.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	131.60	956,732.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	2,550	225.80	575,790.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	5,190	169.50	879,705.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	4,787	92.70	443,754.90	
	BDO UNIBANK INC	13,500	142.50	1,923,750.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	8,460	70.15	593,469.00	
	SECURITY BANK CORP	830	205.00	170,150.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	5.16	572,244.00	
	ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW	146	5.19	757.74	
	AYALA LAND INC	49,900	49.60	2,475,040.00	
	MEGAWORLD CORP	92,000	5.18	476,560.00	
	ROBINSONS LAND CO	17,200	25.40	436,880.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	68,800	35.00	2,408,000.00	
GLOBE TELECOM INC	220	1,980.00	435,600.00		
PLDT INC	530	1,154.00	611,620.00		
ABOITIZ POWER CORP	12,000	36.60	439,200.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	1,350	361.00	487,350.00		
	フィリピンペソ 小計	461,158		20,284,937.64 (41,989,820)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	1,415.00	163,998,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	10,400	2,700.00	28,080,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	12,200	23,300.00	284,260,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	208,200	1,050.00	218,610,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	16,100	7,225.00	116,322,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	21,700.00	286,440,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	5,100	10,500.00	53,550,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	21,300	13,425.00	285,952,500.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	5,400.00	43,200,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	136,300	6,650.00	906,395,000.00	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	21,400	1,240.00	26,536,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	53,600	5,075.00	272,020,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	14,300	11,850.00	169,455,000.00	

	PT GUDANG GARAM TBK	2,600	68,650.00	178,490,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	54,700	2,730.00	149,331,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	26,000	8,000.00	208,000,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	10,500	47,700.00	500,850,000.00	
	KALBE FARMA PT	153,100	1,675.00	256,442,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	52,100	7,550.00	393,355,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	2,080.00	32,240,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	64,600	30,175.00	1,949,305,000.00	
	PT BANK MANDIRI	125,800	6,975.00	877,455,000.00	
	PT BANK RAKYAT	369,700	4,170.00	1,541,649,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,320.00	37,224,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	635.00	50,419,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	328,700	4,270.00	1,403,549,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	65,600	1,965.00	128,904,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,012,500		10,562,033,000.00 (81,327,654)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	272	48,550.00	13,205,600.00	
	S-OIL CORPORATION	310	97,500.00	30,225,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	377	165,500.00	62,393,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	630	18,150.00	11,434,500.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	457	38,300.00	17,503,100.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	49	439,000.00	21,511,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	113	70,800.00	8,000,400.00	
	LG CHEM LTD	307	325,000.00	99,775,000.00	
	LG CHEM LTD	63	172,500.00	10,867,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	122	234,500.00	28,609,000.00	
	OCI COMPANY LTD	110	66,400.00	7,304,000.00	
	POSCO	524	217,000.00	113,708,000.00	
	POSCO CHEMUCAL CO LTD	201	50,800.00	10,210,800.00	
	CJ CORP	90	80,800.00	7,272,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	165	97,300.00	16,054,500.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	4,175.00	2,542,575.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	137	30,050.00	4,116,850.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	289	35,900.00	10,375,100.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	316	32,750.00	10,349,000.00	
	HANWHA CORPORATION	165	24,850.00	4,100,250.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	128	32,000.00	4,096,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	562	42,050.00	23,632,100.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	70	338,000.00	23,660,000.00	
	KCC CORP	36	222,000.00	7,992,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	431	41,700.00	17,972,700.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	274	120,000.00	32,880,000.00	

LG CORP	652	71,900.00	46,878,800.00
LOTTE CORPORATION	108	34,700.00	3,747,600.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	441	18,250.00	8,048,250.00
SAMSUNG C&T CORPORATION	582	87,300.00	50,808,600.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	932	15,650.00	14,585,800.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	3,170	8,070.00	25,581,900.00
SK HOLDINGS CO LTD	241	203,000.00	48,923,000.00
S1 CORPORATION	106	97,500.00	10,335,000.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	135,500.00	10,027,000.00
GLOVIS CO LTD	111	152,000.00	16,872,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	295	22,550.00	6,652,250.00
PAN OCEAN CO LTD	2,212	4,820.00	10,661,840.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	395	28,450.00	11,237,750.00
HANON SYSTEMS	993	11,450.00	11,369,850.00
HYUNDAI MOBIS	446	251,000.00	111,946,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	997	127,000.00	126,619,000.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	265	83,700.00	22,180,500.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	180	75,500.00	13,590,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	1,776	43,100.00	76,545,600.00
FILA KOREA LTD	358	55,600.00	19,904,800.00
HLB INC	177	47,550.00	8,416,350.00
LG ELECTRONICS INC	732	61,300.00	44,871,600.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	364	83,200.00	30,284,800.00
KANGWON LAND INC	845	29,150.00	24,631,750.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	24,150.00	12,871,950.00
KAKAO CORP	343	133,000.00	45,619,000.00
NAVER CORPORATION	933	153,000.00	142,749,000.00
NCSOFT CORP	108	552,000.00	59,616,000.00
NETMARBLE CORPORATION	149	96,400.00	14,363,600.00
PEARLABYSS CORP	54	200,400.00	10,821,600.00
CJ ENM CO LTD	57	165,100.00	9,410,700.00
HOTEL SHILLA CO LTD	167	85,200.00	14,228,400.00
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	51	77,100.00	3,932,100.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	137,000.00	8,220,000.00
SHINSEGAE CO LTD	39	252,500.00	9,847,500.00
BGF RETAIL CO LTD	61	198,500.00	12,108,500.00
E-MART INC	111	115,500.00	12,820,500.00
GS RETAIL CO LTD	99	40,950.00	4,054,050.00
CJ CHEILJEDANG CORP	44	227,000.00	9,988,000.00
KT&G CORPORATION	785	102,500.00	80,462,500.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	179	97,000.00	17,363,000.00
OTTOGI CORPORATION	4	566,000.00	2,264,000.00

AMOREPACIFIC CORP	228	139,500.00	31,806,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	75,200.00	2,481,600.00
AMOREPACIFIC GROUP	153	63,400.00	9,700,200.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	63	1,242,000.00	78,246,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	753,000.00	12,801,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	267	46,050.00	12,295,350.00
CELLTRION INC	603	166,000.00	100,098,000.00
CELLTRION PHARM INC	57	33,350.00	1,900,950.00
HANMI PHARM CO LTD	34	275,000.00	9,350,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	47	40,100.00	1,884,700.00
HELIXMITH CO LTD	137	180,500.00	24,728,500.00
MEDY-TOC INC	23	356,600.00	8,201,800.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	116	280,000.00	32,480,000.00
SILLAJEN INC	315	11,350.00	3,575,250.00
YUHAN CORPORATION	48	225,500.00	10,824,000.00
BS FINANCIAL GROUP INC	1,386	6,790.00	9,410,940.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	1,968	34,150.00	67,207,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,867	12,700.00	23,710,900.00
KB FINANCIAL GROUP INC	2,603	41,150.00	107,113,450.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	3,004	41,500.00	124,666,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,300	12,100.00	39,930,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	303	71,100.00	21,543,300.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	4,880.00	7,710,400.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,873	7,330.00	21,059,090.00
SAMSUNG CARD CO LTD	106	33,400.00	3,540,400.00
SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	332	35,200.00	11,686,400.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	12,350.00	9,237,800.00
DB INSURANCE CO LTD	263	49,700.00	13,071,100.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	2,450.00	2,337,300.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	333	23,950.00	7,975,350.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	120	26,050.00	3,126,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	202	227,000.00	45,854,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	490	69,500.00	34,055,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	239	192,500.00	46,007,500.00
LG DISPLAY CO LTD	1,311	14,250.00	18,681,750.00
LG INNOTEK CO LTD	115	99,000.00	11,385,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	391	97,000.00	37,927,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	31,349	46,900.00	1,470,268,100.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,450	39,100.00	213,095,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	369	241,000.00	88,929,000.00
LG UPLUS CORP	649	13,150.00	8,534,350.00
SK TELECOM CO LTD	141	237,000.00	33,417,000.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	1,765	24,950.00	44,036,750.00	
	KOREA GAS CORPORATION	101	39,050.00	3,944,050.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	3,607	84,300.00	304,070,100.00	
	韓国ウォン 小計	97,096		4,999,154,495.00 (451,923,566)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	8,000	97.60	780,800.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	16,000	44.50	712,000.00	
	CHINA STEEL CORP	80,000	23.20	1,856,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	24,000	88.40	2,121,600.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	30,000	95.20	2,856,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	35,000	69.10	2,418,500.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	32,300	40.00	1,292,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION-NEW	1,773	40.00	70,920.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	325.50	325,500.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	18,000	29.40	529,200.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,030	262.00	531,860.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP-NEW	30	262.00	7,860.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	9.23	92,300.00	
	EVA AIRWAYS CORP	18,350	13.60	249,560.00	
	EVA AIRWAYS CORP-NEW	547	13.60	7,439.20	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	7,350	13.20	97,020.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	12,000	37.90	454,800.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	14,000	43.80	613,200.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	1,000	399.00	399,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,200	207.50	456,500.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,000	34.80	104,400.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	2,000	226.50	453,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	272.00	272,000.00	
	POU CHEN	12,000	39.45	473,400.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	1,200	70.00	84,000.00	
	TATUNG CO LTD	10,000	17.20	172,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	439.00	878,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	295.50	1,182,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	63.60	127,200.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	32,000	77.80	2,489,600.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	150.00	150,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	36,253	20.45	741,373.85	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	83,000	9.32	773,560.00	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	121,000	20.65	2,498,650.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	68,785	25.95	1,784,970.75	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	64,340	21.65	1,392,961.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO-NEW	523	21.65	11,322.95	



HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	49,170	20.50	1,007,985.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS NEW	2,189	20.50	44,874.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	71,000	29.20	2,073,200.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	69,760	12.50	872,000.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	62,643	13.80	864,473.40
TAIWAN BUSINESS BANK	25,560	12.25	313,110.00
TAIWAN BUSINESS BANK NEW	728	12.25	8,918.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	57,870	20.50	1,186,335.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING-NEW	1,406	20.50	28,823.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	20,000	54.90	1,098,000.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	8,262	131.00	1,082,322.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	65,000	19.00	1,235,000.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	49,000	40.95	2,006,550.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,540	25.10	339,854.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	44,000	44.55	1,960,200.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	68,432	9.78	669,264.96
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	49.70	298,200.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	42.95	77,310.00
ACER INC	18,000	17.60	316,800.00
ADVANTECH CO LTD	2,000	271.50	543,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	207.50	1,037,500.00
AU OPTRONICS CORP	46,000	8.10	372,600.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	227.00	908,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	4,010	90.40	362,504.00
COMPAL ELECTRONICS	22,000	18.25	401,500.00
DELTA ELECTRONICS INC	13,000	147.50	1,917,500.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	5,000	63.40	317,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	82,800	74.70	6,185,160.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	48,000	7.20	345,600.00
INVENTEC CORPORATION	13,000	21.80	283,400.00
LARGAN PRECISION CO LTD	380	3,990.00	1,516,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	15,000	49.40	741,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	4,000	88.50	354,000.00
PEGATRON CORP	14,000	52.90	740,600.00
QUANTA COMPUTER INC	18,000	56.10	1,009,800.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	36.60	366,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	2,000	156.00	312,000.00
WISTRON CORPORATION	15,293	25.00	382,325.00
WPG HOLDINGS CO LTD	9,520	39.60	376,992.00
YAGEO CORPORATION	2,198	233.00	512,134.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	4,000	113.00	452,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	25,000	110.50	2,762,500.00

	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	11,000	73.30	806,300.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	11,000	112.50	1,237,500.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	23,000	71.60	1,646,800.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	304.00	608,000.00
	MEDIATEK INCORPORATION	10,000	382.50	3,825,000.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	76.50	612,000.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	4,000	187.00	748,000.00
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	299.50	299,500.00
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	83.20	499,200.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	215.00	645,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	161,000	265.00	42,665,000.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	80,000	13.60	1,088,000.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	5,000	65.80	329,000.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	264.50	529,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	20,000	18.20	364,000.00
	新台湾ドル 小計	2,103,242		123,045,332.61 (423,275,944)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,661	382.00	1,398,502.00
	COAL INDIA LTD	8,717	199.35	1,737,733.95
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,473	261.95	1,171,702.35
	INDIAN OIL CORP LTD	13,301	126.65	1,684,571.65
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	17,465	129.40	2,259,971.00
	PETRONET LNG LTD	4,423	265.30	1,173,421.90
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	18,773	1,222.20	22,944,360.60
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	195.50	879,554.50
	ASIAN PAINTS LTD	1,962	1,540.60	3,022,657.20
	GRASIM INDUSTRIES LTD	2,103	705.75	1,484,192.25
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	6,713	189.25	1,270,435.25
	JSW STEEL LTD	4,845	219.50	1,063,477.50
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	886	1,374.70	1,217,984.20
	SHREE CEMENT LTD	61	18,068.40	1,102,172.40
	TATA STEEL LTD	2,053	353.80	726,351.40
	ULTRATECH CEMENT LTD	660	3,905.60	2,577,696.00
	UPL LTD	3,725	587.45	2,188,251.25
	VEDANTA LTD	13,075	141.25	1,846,843.75
	ASHOK LEYLAND LIMITED	4,350	62.90	273,615.00
	HAVELLS INDIA LTD	1,471	660.80	972,036.80
	LARSEN & TOUBRO LTD	3,216	1,357.00	4,364,112.00
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,400	369.55	1,626,020.00
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	1,604	514.20	824,776.80
	INTERGLOBE AVIATION LTD	676	1,675.65	1,132,739.40
	BAJAJ AUTO LTD	480	2,817.80	1,352,544.00

BHARAT FORGE LTD	778	400.30	311,433.40
BOSCH LIMITED	55	14,120.95	776,652.25
EICHER MOTORS LTD	76	16,206.75	1,231,713.00
HERO MOTOCORP LTD	688	2,691.60	1,851,820.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,110	532.55	2,721,330.50
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	712	6,335.50	4,510,876.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,442	99.25	738,618.50
TATA MOTORS LTD	8,995	121.90	1,096,490.50
PAGE INDUSTRIES LTD	24	18,155.60	435,734.40
TITAN CO LTD	2,146	1,088.35	2,335,599.10
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	2,766	362.95	1,003,919.70
AVENUE SUPERMARTS LTD	731	1,568.80	1,146,792.80
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	426	2,682.70	1,142,830.20
ITC LIMITED	22,994	245.50	5,645,027.00
NESTLE INDIA LTD	132	12,836.35	1,694,398.20
UNITED SPIRITS LTD	2,109	617.25	1,301,780.25
DABUR INDIA LIMITED	3,045	444.25	1,352,741.25
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,052	607.65	1,246,897.80
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	4,321	1,834.05	7,924,930.05
MARICO LTD	3,281	387.05	1,269,911.05
AUROBINDO PHARMA LIMITED	1,539	625.75	963,029.25
CIPLA LTD	2,022	475.00	960,450.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	596	1,627.15	969,781.40
DR.REDDY'S LABORATORIES	798	2,749.20	2,193,861.60
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	514	384.60	197,684.40
LUPIN LTD	1,307	766.70	1,002,076.90
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	481	1,892.05	910,076.05
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	5,791	428.80	2,483,180.80
AXIS BANK LIMITED	12,656	671.55	8,499,136.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	10,722	2,064.25	22,132,888.50
ICICI BANK LIMITED	15,933	395.45	6,300,704.85
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,624	424.60	689,550.40
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,397	399.15	557,612.55
STATE BANK OF INDIA	12,129	278.00	3,371,862.00
YES BANK LTD	9,092	63.10	573,705.20
BAJAJ FINANCE LIMITED	1,173	3,437.35	4,032,011.55
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,348	323.60	759,812.80
REC LTD	5,374	150.75	810,130.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	871	1,009.20	879,013.20
BAJAJ FINSERV LTD	219	7,323.95	1,603,945.05
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,535	530.90	1,876,731.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	993	1,178.40	1,170,151.20

	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,666	1,084.40	3,975,410.40
	INFOSYS LIMITED	22,750	829.10	18,862,025.00
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	5,955	2,182.85	12,998,871.75
	TECH MAHINDRA LTD	3,203	712.90	2,283,418.70
	WIPRO LTD	8,396	255.60	2,146,017.60
	BHARTI AIRTEL LIMITED	13,452	356.45	4,794,965.40
	BHARTI INFRATEL LTD	1,237	252.95	312,899.15
	VODAFONE IDEA LTD	32,755	5.30	173,601.50
	GAIL INDIA LIMITED	8,986	132.15	1,187,499.90
	NTPC LTD	13,459	126.35	1,700,544.65
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	12,595	202.90	2,555,525.50
	TATA POWER CO LTD	4,120	60.40	248,848.00
	インドルピー 小計	417,163		214,212,243.95 (323,460,488)
エジプトbond	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	14.62	79,752.10
	EASTERN TOBACCO	5,913	15.50	91,651.50
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	9,082	81.36	738,911.52
	エジプトbond 小計	20,450		910,315.12 (5,926,151)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	1,848	134.80	249,110.40
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	313	871.72	272,848.36
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	2,790	303.45	846,625.50
	GOLD FIELDS LIMITED	5,712	75.84	433,198.08
	KUMBA IRON ORE LTD	490	412.63	202,188.70
	SAPPI LIMITED	2,041	43.56	88,905.96
	SASOL LTD.	3,783	270.00	1,021,410.00
	BIDVEST GROUP LTD	1,887	194.25	366,549.75
	MULTICHOICE GROUP LTD	3,068	121.77	373,590.36
	MR PRICE GROUP LTD	1,454	174.15	253,214.10
	NASPERS LIMITED-N SHS	2,883	3,528.34	10,172,204.22
	THE FOSCHINI GROUP	1,308	164.60	215,296.80
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	3,407	55.78	190,042.46
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	5,717	55.23	315,749.91
	BID CORP LTD	2,285	322.50	736,912.50
	CLICKS GROUP LTD	1,455	202.00	293,910.00
	PICK N PAY STORES LTD	1,342	59.54	79,902.68
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	3,329	117.96	392,688.84
	SPAR GROUP LIMITED	1,121	184.63	206,970.23
	TIGER BRANDS LTD	929	216.03	200,691.87
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	10,359	22.73	235,460.07
	NETCARE LTD	7,009	16.59	116,279.31
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	2,200	83.97	184,734.00

ABSA GROUP LTD	4,896	160.66	786,591.36
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	327	1,200.00	392,400.00
NEDBANK GROUP LTD	2,194	231.02	506,857.88
STANDARD BANK GROUP LIMITED	8,590	183.34	1,574,890.60
FIRSTRAND LIMITED	22,508	62.03	1,396,171.24
INVESTEC LTD	2,223	83.24	185,042.52
PSG GROUP LTD	877	205.36	180,100.72
REINET INVESTMENTS SCA	1,066	250.18	266,691.88
REMGRO LTD	3,624	178.45	646,702.80
RMB HOLDINGS LTD	5,468	75.42	412,396.56
DISCOVERY LTD	2,052	118.00	242,136.00
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	111.85	52,793.20
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	3,464	18.25	63,218.00
OLD MUTUAL LTD	33,107	18.57	614,796.99
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	5,957	30.47	181,509.79
SANLAM LTD	12,656	75.33	953,376.48
NEPI ROCKCASTLE PLC	2,150	133.01	285,971.50
MTN GROUP LIMITED	11,373	100.32	1,140,939.36
TELKOM SA SOC LTD	2,170	79.03	171,495.10
VODACOM GROUP LIMITED	4,446	120.40	535,298.40
南アフリカランド 小計	196,350		28,037,864.48 (203,835,274)
合 計	16,197,457		3,398,000,779 (3,398,000,779)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 39銘柄	4.6%	9.9%
メキシコペソ	株式 24銘柄	1.3%	2.7%
ブラジルリアル	株式 52銘柄	3.8%	8.2%
チリペソ	株式 17銘柄	0.5%	1.0%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	0.2%	0.5%
ユーロ	株式 9銘柄	0.2%	0.3%
トルコリラ	株式 16銘柄	0.3%	0.6%
チェココルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.2%	0.3%
ポーランドズロチ	株式 19銘柄	0.5%	1.1%
香港ドル	株式 205銘柄	11.4%	24.5%
マレーシアリングgit	株式 43銘柄	1.1%	2.3%
タイバーツ	株式 37銘柄	1.5%	3.3%
フィリピンペソ	株式 24銘柄	0.6%	1.2%
インドネシアルピア	株式 27銘柄	1.1%	2.4%

韓国ウォン	株式	113銘柄	6.2%	13.3%
新台湾ドル	株式	94銘柄	5.8%	12.5%
インドルピー	株式	79銘柄	4.4%	9.5%
エジプトポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
南アフリカランド	株式	43銘柄	2.8%	6.0%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,512	8,875.44		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	19,885	348,584.05		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	35,892	1,402,659.36		
		ISHARES MSCI UAE ETF	19,009	266,126.00		
	米ドル 小計			76,298	2,026,244.85 (217,720,009)	
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	163,600	6,666,700.00		
	中国元(オフショア) 小計			163,600	6,666,700.00 (100,600,503)	
投資信託受益証券合計				318,320,512 (318,320,512)		
投資証券	米ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	30,522	929,394.90		
		米ドル 小計		30,522	929,394.90 (99,863,482)	
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	20,400	573,240.00		
		メキシコペソ 小計		20,400	573,240.00 (3,147,087)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	2,700	120,663.00		
		KLABIN SA-UNIT	4,600	69,920.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	1,500	67,125.00		
	ブラジルリアル 小計			8,800	257,708.00 (6,757,103)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	9,022	189,642.44		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	20,610	484,335.00		
REDEFINE PROPERTIES LTD		31,094	245,953.54			
南アフリカランド 小計			60,726	919,930.98 (6,687,898)		
投資証券合計				116,455,570 (116,455,570)		
合計				434,776,082 (434,776,082)		

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資信託受益証券 4銘柄	3.0%	-	50.1%
	投資証券 1銘柄	-	1.4%	23.0%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.7%
ブラジルリアル	投資証券 3銘柄	-	0.1%	1.6%
南アフリカランド	投資証券 3銘柄	-	0.1%	1.5%
中国元（オフショア）	投資信託受益証券 1銘柄	1.4%	-	23.1%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### Jリート・インデックス・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	120,635,675	113,125,734
投資証券	9,982,698,260	7,780,854,340
未収配当金	125,288,572	110,417,015
流動資産合計	10,228,622,507	8,004,397,089
資産合計	10,228,622,507	8,004,397,089
負債の部		
流動負債		
未払金	1,968,594	-
未払解約金	65,349,595	93,530,000
未払利息	327	234
その他未払費用	6,339	5,264
流動負債合計	67,324,855	93,535,498
負債合計	67,324,855	93,535,498
純資産の部		
元本等		
元本	5,035,716,920	3,086,904,697
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,125,580,732	4,823,956,894
元本等合計	10,161,297,652	7,910,861,591
純資産合計	10,161,297,652	7,910,861,591
負債純資産合計	10,228,622,507	8,004,397,089

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 9月10日現在）	（令和 1年 9月10日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,035,716,920口	3,086,904,697口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0178円 (10,000口当たりの純資産額 20,178円)	1口当たり純資産額 2.5627円 (10,000口当たりの純資産額 25,627円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容



リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
----	-----------------

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成30年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,388,648,854円
同期中における追加設定元本額	2,391,853,342円
同期中における一部解約元本額	2,744,785,276円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	250,206,965円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	365,386,626円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	316,593,527円
イオン・バランス戦略ファンド	82,529,537円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	329,112,253円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,955,922円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,389,825円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,205,588円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	4,941,730円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	4,292,001円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	9,167,149円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,785,816円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,403円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,789,573,241円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,133,156,418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>	110,531,606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>	24,749,778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>	234,845,295円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	112,515,207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>	259,261,033円
合計	5,035,716,920円

(令和1年9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,035,716,920円
同期中における追加設定元本額	4,119,008,327円
同期中における一部解約元本額	6,067,820,550円
令和1年9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	351,305,308円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	480,918,885円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	446,263,380円
イオン・バランス戦略ファンド	57,836,864円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	909,213,703円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,042,377円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	10,585,962円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,675,091円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	20,215,989円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	11,885,680円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,475,916円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,609,434円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	412,141円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	306,297,110円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	58,642,282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>	17,158,414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>	25,811,183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>	151,500,822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>	211,054,156円
合計	3,086,904,697円

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	73	8,511,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	106	12,804,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	241	163,880,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	860	97,438,000	
	森ヒルズリート投資法人	835	140,280,000	
	産業ファンド投資法人	891	134,986,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	671	237,869,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	451	93,402,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	363	193,479,000	
	G L P 投資法人	1,806	247,060,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	302	105,096,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,041	299,183,400	
	星野リゾート・リート投資法人	110	62,810,000	
	O n e リート投資法人	113	34,352,000	
	イオンリート投資法人	782	107,290,400	
	ヒューリックリート投資法人	590	114,047,000	
	日本リート投資法人	236	103,958,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,641	95,790,240	
	日本ヘルスケア投資法人	36	6,685,200	
	積水ハウス・リート投資法人	2,116	195,730,000	
	トーセイ・リート投資法人	134	17,594,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	265	77,327,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	152	20,732,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	143	17,603,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,261	430,268,300	
	いちごホテルリート投資法人	122	15,799,000	
ラサールロジポート投資法人	602	92,647,800		
スターアジア不動産投資法人	238	27,298,600		
マリモ地方創生リート投資法人	64	7,763,200		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	178	76,362,000		
大江戸温泉リート投資法人	119	10,507,700		
さくら総合リート投資法人	155	14,756,000		

投資法人みらい	786	47,160,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	168	23,436,000	
三菱地所物流リート投資法人	116	37,120,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	101	13,140,100	
ザイマックス・リート投資法人	107	14,209,600	
タカラレーベン不動産投資法人	206	23,566,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	113	12,475,200	
日本ビルファンド投資法人	702	551,070,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	725	515,475,000	
日本リテールファンド投資法人	1,371	293,805,300	
オリックス不動産投資法人	1,443	333,765,900	
日本プライムリアルティ投資法人	459	227,664,000	
プレミア投資法人	653	100,431,400	
東急リアル・エステート投資法人	485	100,055,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	501	76,152,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,627	330,931,800	
森トラスト総合リート投資法人	516	103,200,000	
インヴィンシブル投資法人	3,178	210,065,800	
フロンティア不動産投資法人	257	116,549,500	
平和不動産リート投資法人	451	61,110,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	473	130,500,700	
福岡リート投資法人	376	67,943,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	224	183,680,000	
いちごオフィスリート投資法人	561	59,185,500	
大和証券オフィス投資法人	167	138,777,000	
阪急阪神リート投資法人	328	52,381,600	
スターツプロシード投資法人	114	22,583,400	
大和ハウスリート投資法人	976	285,772,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,338	191,248,400	
日本賃貸住宅投資法人	817	82,762,100	
ジャパンエクセレント投資法人	651	111,321,000	
合計	41,687	7,780,854,340	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 外国リート・インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	117,594,242	50,802,920
コール・ローン	20,896,929	2,395,949
投資証券	5,793,358,111	5,474,632,806
派生商品評価勘定	27,927	-
未収入金	234,544	173,249
未収配当金	4,653,698	4,597,224
<b>流動資産合計</b>	<b>5,936,765,451</b>	<b>5,532,602,148</b>
<b>資産合計</b>	<b>5,936,765,451</b>	<b>5,532,602,148</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	19,797	146,860
未払金	144,663,648	-
未払解約金	11,000,000	23,880,338
未払利息	56	4
その他未払費用	1,186	740
<b>流動負債合計</b>	<b>155,684,687</b>	<b>24,027,942</b>
<b>負債合計</b>	<b>155,684,687</b>	<b>24,027,942</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	2,813,938,418	2,482,007,106
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,967,142,346	3,026,567,100
<b>元本等合計</b>	<b>5,781,080,764</b>	<b>5,508,574,206</b>
<b>純資産合計</b>	<b>5,781,080,764</b>	<b>5,508,574,206</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>5,936,765,451</b>	<b>5,532,602,148</b>

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
	為替予約取引

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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	(平成30年 9月10日現在)	(令和 1年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,813,938,418口	2,482,007,106口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0544円 (10,000口当たりの純資産額 20,544円)	1口当たり純資産額 2.2194円 (10,000口当たりの純資産額 22,194円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 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

項目	自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
	<p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	67,700,000	-	67,708,130	8,130
	米ドル	52,500,000	-	52,506,621	6,621
	カナダドル	500,000	-	499,788	212
	ユーロ	5,700,000	-	5,698,979	1,021
	英ポンド	6,000,000	-	6,004,886	4,886
	オーストラリアドル	2,500,000	-	2,498,403	1,597
	香港ドル	500,000	-	499,453	547
合計		67,700,000	-	67,708,130	8,130

（令和 1年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	23,901,930	-	24,048,790	146,860
	米ドル	15,506,035	-	15,577,550	71,515
	カナダドル	405,780	-	407,700	1,920
	ユーロ	942,484	-	949,360	6,876
	英ポンド	656,583	-	663,250	6,667
	オーストラリアドル	5,326,351	-	5,380,830	54,479
	香港ドル	368,231	-	369,900	1,669
	シンガポールドル	696,466	-	700,200	3,734
合計		23,901,930	-	24,048,790	146,860

（注）1．時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 平成30年 9月11日 至 令和 1年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 平成30年 9月10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	1,949,431,494円
同期中における追加設定元本額	1,987,136,919円
同期中における一部解約元本額	1,122,629,995円
平成30年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	242,669,076円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	159,875,620円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	117,127,125円
イオン・バランス戦略ファンド	122,844,199円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	918,964,726円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,141,583円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,032,745円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,568,131円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,023,965円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	4,975,485円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,069,429円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,256,366円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,156円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,103,625,312円
SMA・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>	98,442,839円
SMA・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,804,661円
合計	2,813,938,418円

（令和 1年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,813,938,418円
同期中における追加設定元本額	1,932,193,735円
同期中における一部解約元本額	2,264,125,047円
令和 1年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	50,319,293円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	52,782,730円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	51,096,515円
イオン・バランス戦略ファンド	39,986,444円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,100,003,784円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,383,984円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	12,331,320円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	8,927,413円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	23,541,279円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	13,784,154円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	13,295,119円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	19,863,845円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	439,070円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	67,572,324円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	10,242,528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>	16,437,304円
合計	2,482,007,106円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,108	89,261.76	
		AGREE REALTY CORP	1,879	137,448.85	
		ALEXANDER'S INC	136	51,221.68	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,452	679,152.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,052	98,413.92	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,299	251,543.53	

AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,086	25,887.26
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,355	282,171.75
AMERICOLD REALTY TRUST	8,080	295,081.60
APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	5,984	308,176.00
APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,020	163,827.00
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	19,058.04
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,452	1,166,073.76
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	7,140.00
BOSTON PROPERTIES INC	6,329	825,048.44
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	5,640.74
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,718	83,883.06
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,502	224,404.02
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	2,361	46,936.68
BRT APARTMENTS CORP	500	7,160.00
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,082	450,407.88
CARETRUST REIT INC	4,198	101,171.80
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	7,417.03
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	5,474.10
CHATHAM LODGING TRUST	706	12,362.06
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	61,640.00
CITY OFFICE REIT INC	600	8,088.00
CLIPPER REALTY INC	800	8,544.00
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	118,241.60
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	98,325.00
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	12,717.00
CORECIVIC INC	5,301	93,297.60
CORESITE REALTY CORPORATION	1,265	145,209.35
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	128,214.32
COUSINS PROPERTIES INC	6,111	215,168.31
CUBESMART	8,197	293,288.66
CYRUSONE INC	4,761	351,837.90
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,330	103,816.50
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,560	1,096,450.40
DOUGLAS EMMETT INC	5,975	251,368.25
DUKE REALTY CORP	15,176	503,236.16
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	4,370	90,939.70
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,502	187,224.30
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	72,350.00
EPR PROPERTIES	2,875	223,330.00
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,608	155,013.12
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,616	479,481.60
EQUITY RESIDENTIAL	14,563	1,239,456.93

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	4,017	90,543.18	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,610	849,998.70	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,032	595,184.96	
FARMLAND PARTNERS INC	300	1,986.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,168	427,458.24	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,467	171,979.50	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	96,597.27	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	29,304.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	22,880.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,880	309,211.20	
GEO GROUP INC	5,536	100,755.20	
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	45,610.32	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	32,745.60	
GLADSTONE LAND CORP	600	7,206.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	10,970.00	
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	67,321.13	
HCP, INC.	18,590	654,553.90	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,720	190,704.80	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	8,986	256,370.58	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	14,740.64	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,629	201,963.27	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,445	190,219.75	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,423	504,310.22	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,905	200,238.55	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	64,045.80	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,254	49,114.66	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	200	17,208.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	323	23,288.30	
INVITATION HOMES INC	17,590	498,852.40	
IRON MOUNTAIN INC	11,379	380,399.97	
JBG SMITH PROPERTIES	4,364	170,894.24	
KILROY REALTY CORP	3,892	298,866.68	
KIMCO REALTY CORPORATION	16,855	333,054.80	
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	50,284.62	
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	70,913.65	
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,652	290,004.12	
LIFE STORAGE INC	2,099	219,954.21	
LTC PROPERTIES INC	1,576	79,351.60	
MACERICH COMPANY/THE	4,415	140,176.25	

MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,669	100,476.88
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	58,011.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,607	336,645.84
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,525	581,372.00
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	48,054.24
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	141,977.28
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,109	339,477.13
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,600	53,264.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	17,780.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	22,950.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	37,605.52
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,919	56,130.75
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	8,098	334,933.28
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	26,990.00
PARAMOUNT GROUP INC	8,400	112,644.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	7,345	185,020.55
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,931	169,033.50
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	12,610.71
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,507	149,467.99
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	108,810.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	41,470.00
PROLOGIS INC	25,293	2,140,546.59
PS BUSINESS PARKS INC/CA	938	169,384.04
PUBLIC STORAGE	6,117	1,558,672.77
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,692	82,315.80
REALTY INCOME CORPORATION	12,401	933,175.25
REGENCY CENTERS CORP	6,656	455,203.84
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	75,481.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,355	122,913.85
RETAIL VALUE INC	594	22,073.04
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,197	185,843.16
RLJ LODGING TRUST	7,377	125,113.92
RPT REALTY	2,740	35,537.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,074	166,832.56
SABRA HEALTH CARE REIT	7,500	164,400.00
SAFEHOLD INC	600	16,332.00
SAUL CENTERS INC	703	36,520.85
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,696	97,119.68
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	61,350.00

	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,294	1,945,033.74
	SITE CENTERS CORP	5,797	85,215.90
	SL GREEN REALTY CORP	3,697	305,815.84
	SPIRIT MTA REIT	1,580	13,177.20
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,332	156,170.84
	STAG INDUSTRIAL INC	4,981	143,901.09
	STORE CAPITAL CORP	8,774	325,339.92
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	49,794.00
	SUN COMMUNITIES INC	3,441	494,953.44
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	131,652.17
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	59,738.64
	TAUBMAN CENTERS INC	2,883	118,750.77
	TERRENO REALTY CORP	2,200	112,156.00
	UDR INC	10,951	530,356.93
	UMH PROPERTIES INC	800	10,640.00
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	234	22,576.32
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	74,801.34
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	10,046.66
	VENTAS INC	15,164	1,121,074.52
	VEREIT INC	41,304	398,583.60
	VICI PROPERTIES INC	15,411	338,271.45
	VORNADO REALTY TRUST	6,610	415,240.20
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	23,294.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,270	88,518.90
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,598	155,120.58
	WELLTOWER INC	16,527	1,490,900.67
	WHITESTONE REIT	200	2,600.00
	WP CAREY INC	6,706	599,315.22
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	84,640.00
	米ドル 小計	936,157	37,732,085.33 (4,054,312,568)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,306	119,450.80
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,068	62,893.88
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	32,435.55
	CAN APARTMENT PROP	2,821	151,149.18
	CHOICE PROPERTIES REIT	5,671	78,656.77
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	39,740.40
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	23,640.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	47,616.00

	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,714	53,073.06
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	46,879.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	40,619.52
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	63,800.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,256	118,785.60
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2,479	38,697.19
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	20,030.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	6,932.64
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,954.00
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	30,771.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	17,460.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,629	172,354.00
	SLATE OFFICE REIT	1,000	5,810.00
	SLATE RETAIL REIT	500	6,340.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,256	103,866.40
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	19,260.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	1,000	6,610.00
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>59,958</b>	<b>1,308,824.99</b> <b>(106,734,677)</b>
<b>ユーロ</b>	AEDIFICA	1,035	109,710.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,573	98,792.19
	ALTAREA	80	14,864.00
	BEFIMMO SCA	835	45,006.50
	COFINIMMO	838	106,593.60
	COVIVIO	2,501	236,844.70
	EUROCOMMERCIAL	2,600	62,036.00
	GECINA SA	2,344	326,284.80
	GREEN REIT PLC	27,000	51,300.00
	HAMBORNER REIT AG	2,840	26,531.28
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	37,247.98
	ICADE	1,612	127,267.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	19,084.80
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	8,358	89,179.86
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,302	33,982.20
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	17,069.00
	KLEPIERRE	8,892	247,908.96
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	19,650.00
	MERCIALYS	2,280	24,601.20



	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	14,605	176,136.30
	MONTEA	611	46,069.40
	NSI NV	727	28,607.45
	RETAIL ESTATES	587	49,601.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,477	655,049.20
	VASTNED RETAIL	925	25,437.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	714	120,666.00
	WERELDHAVE NV	631	11,831.25
	ユーロ 小計	134,765	2,807,353.07 (333,148,588)
英ポンド	ASSURA PLC	116,800	80,942.40
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	70,458.56
	BRITISH LAND CO PLC	37,600	194,542.40
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	3,240.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19,661	16,436.59
	DERWENT LONDON PLC	5,084	156,383.84
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	18,500.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13,270	91,456.84
	HAMMERSON PLC	27,400	67,623.20
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	11,185.20
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	11,491.20
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,869	208,449.70
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	29,495	61,408.59
	LXI REIT PLC	36,635	48,284.93
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	30,520.66
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	15,000	13,020.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	35,984	48,866.27
	RDI REIT PLC	8,020	8,469.12
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,180.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,700	50,050.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	8,310.00
	SEGRO PLC	44,637	348,168.60
	SHAFTESBURY PLC	7,700	64,564.50
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	8,660.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	64,900	91,054.70
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	28,035.00
	UNITE GROUP PLC	11,494	118,043.38
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	57,085.95
	英ポンド 小計	684,292	1,920,431.63 (254,764,460)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	8,942	35,231.48

	APN INDUSTRIA REIT	1,000	2,920.00
	ARENA REIT	3,100	8,897.00
	BWP TRUST	26,090	102,794.60
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	7,100	26,412.00
	CHARTER HALL GROUP	17,258	207,268.58
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	16,958	96,999.76
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	50,197.29
	CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	102,090.00
	DEXUS	42,764	543,530.44
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	28,170.00
	GOODMAN GROUP	63,649	881,538.65
	GPT GROUP	75,100	475,383.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	18,930	82,534.80
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	349.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	32,745.66
	MIRVAC GROUP	160,906	497,199.54
	NATIONAL STORAGE REIT	43,936	78,206.08
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	20,000.00
	SCENTRE GROUP	221,287	880,722.26
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	108,047.94
	STOCKLAND	95,730	427,913.10
	VICINITY CENTRES	124,829	323,307.11
	VIVA ENERGY REIT	18,000	51,840.00
	オーストラリアドル 小計	1,117,588	5,064,298.29 (373,340,069)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	45,450.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	36,319	81,354.56
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	75,443.76
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44,000	83,600.00
	STRIDE STAPLED GROUP	23,000	54,050.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	53,200.00
	ニュージーランドドル 小計	197,226	393,098.32 (27,163,093)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	374,400.00
	FORTUNE REIT	58,000	520,840.00
	LINK REIT	86,100	7,637,070.00
	PROSPERITY REIT	60,000	175,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	199,060.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,000	211,600.00
	香港ドル 小計	353,100	9,118,170.00 (125,010,110)

シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	34,545.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	27,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	103,100	326,827.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	52,400.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	19,845.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	106,700	229,405.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	99,400	267,386.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	31,200.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	55,990.50	
	ESR REIT	57,552	29,927.04	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	31,510.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	29,400.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	36,800	99,728.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	74,368.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	7,050.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	59,000	71,980.00	
	KEPPEL DC REIT	56,900	102,989.00	
	KEPPEL REIT	98,900	122,636.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	7,590.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	82,000	182,860.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	49,800	116,034.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	87,250	137,855.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	110,390.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	48,898	25,426.96	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	13,000	39,650.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	13,950.00	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	14,040.00		
SPH REIT	16,000	17,760.00		
STARHILL GLOBAL REIT	54,000	41,310.00		
SUNTEC REIT	96,000	186,240.00		
	シンガポールドル 小計	1,536,950	2,507,292.50 (195,117,502)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	165,520.00	
	イスラエルシュケル 小計	8,000	165,520.00 (5,041,739)	
	合計		5,474,632,806 (5,474,632,806)	

(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	155銘柄	73.6%	74.1%
カナダドル	投資証券	25銘柄	1.9%	1.9%
ユーロ	投資証券	27銘柄	6.0%	6.1%
英ポンド	投資証券	28銘柄	4.6%	4.7%
オーストラリアドル	投資証券	24銘柄	6.8%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券	6銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券	6銘柄	2.3%	2.3%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	3.5%	3.6%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	0.1%	0.1%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

**【中間財務諸表】**

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(令和1年9月11日から令和2年3月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第3期中間計算期間 (令和2年3月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,566,898
親投資信託受益証券		369,291,431
流動資産合計		373,858,329
資産合計		373,858,329
負債の部		
流動負債		
未払解約金		77,603
未払受託者報酬		39,207
未払委託者報酬		372,401
未払利息		13
その他未払費用		11,846
流動負債合計		501,070
負債合計		501,070
純資産の部		
元本等		
元本		378,531,471
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		5,174,212
元本等合計		373,357,259
純資産合計		373,357,259
負債純資産合計		373,858,329

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

第3期中間計算期間	
自 令和 1年 9月11日	
至 令和 2年 3月10日	
営業収益	
有価証券売買等損益	24,898,555
営業収益合計	24,898,555
営業費用	
支払利息	1,382
受託者報酬	39,207
委託者報酬	372,401
その他費用	12,151
営業費用合計	425,141
営業利益又は営業損失（ ）	25,323,696
経常利益又は経常損失（ ）	25,323,696
中間純利益又は中間純損失（ ）	25,323,696
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	946,277
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,511,897
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,972,240
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,972,240
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,388,376
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,388,376
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,174,212

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間
	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期中間計算期間	
	(令和 2年 3月10日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		378,531,471口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	5,174,212円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9863円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,863円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項



項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月10日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月10日現在)
期首元本額	283,071,447円
期中追加設定元本額	124,069,957円
期中一部解約元本額	28,609,933円

## (参考)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和 2年 3月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	556,903,083
国債証券	106,960,345,060

（令和 2年 3月10日現在）

地方債証券	8,543,065,325
特殊債証券	14,822,162,188
社債証券	6,627,134,000
未収入金	3,534,905,700
未収利息	460,559,553
前払費用	11,772,137
流動資産合計	141,516,847,046
資産合計	141,516,847,046
負債の部	
流動負債	
未払解約金	304,375,010
未払利息	1,659
その他未払費用	27,845
流動負債合計	304,404,514
負債合計	304,404,514
純資産の部	
元本等	
元本	108,804,752,567
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,407,689,965
元本等合計	141,212,442,532
純資産合計	141,212,442,532
負債純資産合計	141,516,847,046

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10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、特殊債証券、社債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(令和 2年 3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		108,804,752,567口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2979円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,979円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(令和 2年 3月10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	112,020,381,328円
同期中における追加設定元本額	11,875,604,973円
同期中における一部解約元本額	15,091,233,734円
令和 2年 3月10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)	5,067,471,309円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,650,758,651円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,813,096,213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)	733,649,704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)	52,225,073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)	185,555,474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)	360,676,057円

(令和2年3月10日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	347,458,179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)	140,879,741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)	256,174,236円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	129,388,682円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,273,641,525円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	929,358,799円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	329,852,067円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	14,876,285円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,056,557,888円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	362,350,675円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	482,710,012円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	85,294,510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	47,929,077円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	413,150円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	555,206円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	106,684円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,091,175円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,885,699,741円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	16,392,775,513円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	7,097,036,488円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	17,206,163,035円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	328,393,481円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	550,219,868円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	2,518,027円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	262,893,069円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	113,614,349円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,976,884,869円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,118,689,818円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,666,143,697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>	9,923,031,837円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	2,138,244円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,349,005,520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>	484,776,426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>	645,327,491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>	176,299,088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>	43,660,301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>	1,816,743,594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>	2,381,697,831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>	939,101,439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>	237,525,658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>	18,711,915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>	314,069,319円

（令和 2年 3月10日現在）	
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 >	5,901,023,194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 >	269,435,257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 >	258,882,686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 >	698,440,687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 >	653,105,499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 >	4,759,536,160円
合計	108,804,752,567円

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（令和 2年 3月10日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	38,408,047
コール・ローン	259,758,594
国債証券	24,840,053,867
派生商品評価勘定	819,044,309
未収利息	120,932,432
前払費用	43,209,912
流動資産合計	26,121,407,161
資産合計	26,121,407,161
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,756,115
未払利息	774
その他未払費用	10,423
流動負債合計	1,767,312
負債合計	1,767,312
純資産の部	
元本等	
元本	16,818,989,646
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,300,650,203
元本等合計	26,119,639,849
純資産合計	26,119,639,849
負債純資産合計	26,121,407,161

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10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 3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		16,818,989,646口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5530円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,530円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(令和 2年 3月10日現在)
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)

(令和 2年 3月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	189,150,147	-	187,394,032	1,756,115
	米ドル	92,446,621	-	91,598,435	848,186
	カナダドル	3,557,979	-	3,523,513	34,466
	ユーロ	72,773,015	-	72,083,677	689,338
	英ポンド	16,094,674	-	15,949,798	144,876
	オーストラリアドル	4,277,858	-	4,238,609	39,249
	売建	25,291,768,709	-	24,472,724,400	819,044,309
	米ドル	12,296,334,877	-	11,766,913,200	529,421,677
	カナダドル	484,007,147	-	453,060,000	30,947,147
	メキシコペソ	214,620,967	-	194,537,800	20,083,167
	ユーロ	9,444,627,583	-	9,293,503,000	151,124,583
	英ポンド	1,611,785,123	-	1,569,837,500	41,947,623
	スウェーデンクローナ	71,897,724	-	69,587,100	2,310,624
	ノルウェークローネ	61,477,813	-	57,726,500	3,751,313
	デンマーククローネ	125,022,250	-	123,165,000	1,857,250
	ポーランドズロチ	145,279,041	-	142,982,400	2,296,641
	オーストラリアドル	477,967,185	-	460,905,200	17,061,985
	シンガポールドル	221,854,204	-	212,898,400	8,955,804
	南アフリカランド	136,894,795	-	127,608,300	9,286,495
合計	25,480,918,856	-	24,660,118,432	817,288,194	

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(令和 2年 3月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,979,833,935円
同期中における追加設定元本額	4,761,483,927円
同期中における一部解約元本額	5,922,328,216円
令和 2年 3月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,952,294,190円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,616,980,342円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	575,305,533円
イオン・バランス戦略ファンド	638,353,461円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	71,661,252円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	6,884,036円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	14,628,114円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	6,002,931円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	6,248,863円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,596,510円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,126,716,143円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,822,561円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,878,381,857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>	140,746,660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>	398,249,648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>	371,117,545円
合計	16,818,989,646円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表



(単位：円)

(令和 2年 3月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	482,903,680
コール・ローン	1,095,693,937
国債証券	166,391,872,742
未収入金	43,400,411
未収利息	1,042,560,218
前払費用	30,126,048
流動資産合計	169,086,557,036
資産合計	169,086,557,036
負債の部	
流動負債	
未払解約金	263,823,256
未払利息	3,265
その他未払費用	27,906
流動負債合計	263,854,427
負債合計	263,854,427
純資産の部	
元本等	
元本	91,548,481,487
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,274,221,122
元本等合計	168,822,702,609
純資産合計	168,822,702,609
負債純資産合計	169,086,557,036

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10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>
	外貨建資産等の会計処理

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「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 3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		91,548,481,487口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.8441円
	(10,000口当たりの純資産額)	18,441円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(令和 2年 3月10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	85,552,532,956円
同期中における追加設定元本額	14,752,744,482円
同期中における一部解約元本額	8,756,795,951円

(令和 2年 3月10日現在)

令和 2年 3月10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	21,821,795,885円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	654,063,788円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,751,167,412円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	848,843,153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)	96,850,141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)	74,616,897円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	154,874,606円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,332,494円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	130,923,357円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	152,303,609円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	117,736,675円
イオン・バランス戦略ファンド	26,141,038円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	6,642,404円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	56,776,890円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,807,634円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	118,763,534円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	44,666,622円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,619,785円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	44,618,051円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	594,319円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	53,592円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	112,044円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	51,364円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	1,285,542円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,030,881,579円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	65,167,979円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	10,024,402,241円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	5,354,597,256円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	12,066,503,063円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	39,245,451円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	100,280,656円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	499,477円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	711,855,158円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,676,639円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,197,048,093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>	1,484,202,283円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,866,690,760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>	5,956,158,110円

（令和 2年 3月10日現在）	
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,555,075円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,927,548,344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）	388,737,725円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	170,197,656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>	37,010,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,074,217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>	151,049,828円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	49,817,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,538,995円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,250,004,591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>	2,143,997,944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>	1,300,979,582円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,394,279,143円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	558,784,954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>	89,286,115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>	75,181,440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>	342,450,340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>	321,429,927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>	1,073,611,540円
合計	91,548,481,487円

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

（単位：円）

（令和 2年 3月10日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,291,650,177
株式	141,927,697,580
派生商品評価勘定	3,718,400
未収配当金	303,786,877
前払金	4,635,000
差入委託証拠金	710,120,000
流動資産合計	147,241,608,034
資産合計	147,241,608,034
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,574,500
未払金	3,090,541,684

（令和 2年 3月10日現在）

未払解約金	91,820,186
未払利息	12,789
その他未払費用	119,481
流動負債合計	3,191,068,640
負債合計	3,191,068,640
純資産の部	
元本等	
元本	64,047,066,405
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	80,003,472,989
元本等合計	144,050,539,394
純資産合計	144,050,539,394
負債純資産合計	147,241,608,034

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10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 3月10日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,640,000,000円</p>

2. 当計算期間の末日における受益権の総数		64,047,066,405口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.2491円
	(10,000口当たりの純資産額)	22,491円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10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 3月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,790,716,100	-	2,785,860,000	4,856,100
	東証株価指数先物	2,790,716,100	-	2,785,860,000	4,856,100
合計		2,790,716,100	-	2,785,860,000	4,856,100

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（令和 2年 3月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,012,358,207円
同期中における追加設定元本額	6,025,840,171円
同期中における一部解約元本額	8,991,131,973円
令和 2年 3月10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	9,894,487,820円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	985,142,643円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,493,625,634円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,179,756,287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）	106,896,223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）	7,399,939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）	26,237,389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）	69,245,648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）	116,183,655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）	79,295,737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）	172,662,057円
国内株式指数ファンド（T O P I X）	1,730,675,148円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	12,225,193,128円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	557,702,410円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	580,822,972円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	436,022,139円
イオン・バランス戦略ファンド	22,916,124円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	14,543,086円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	76,402,276円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	65,902,052円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	193,901,727円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	98,488,190円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	121,898,987円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	15,766,719円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,166,644円
三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）	90,048円
三井住友D S・年金バランス50（標準型）	332,490円
三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	215,555円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,821,558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）	3,955,890,429円
バランスファンドV A（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	23,906,380円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型＜適格機関投資家限定＞	215,384,938円
S M A M・バランスファンドV A 2 5＜適格機関投資家専用＞	2,898,933,915円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5＜適格機関投資家専用＞	2,241,924,223円
S M A M・バランスファンドV A 5 0＜適格機関投資家専用＞	8,217,603,910円
S M A M・バランスファンドV L 3 0＜適格機関投資家限定＞	52,551,780円
S M A M・バランスファンドV L 5 0＜適格機関投資家限定＞	201,585,714円
世界6資産バランスファンドV A＜適格機関投資家限定＞	764,319円

S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	879,991,453円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	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 >	1,271,854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 >	57,711,665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 >	21,561,406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 >	174,657,824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 >	104,728,065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 >	66,008,213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 >	847,806,239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 )	207,605,246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 >	17,198,789円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,008,998,374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 >	192,996,206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リスクリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	15,827,587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 >	54,472,805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 >	51,488,797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 >	243,161,875円
合計	64,047,066,405円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(令和 2年 3月10日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,556,372,117
コール・ローン	376,552,741
株式	165,500,209,298
投資証券	4,800,812,130
派生商品評価勘定	788,983
未収入金	43,182,403
未収配当金	439,661,479
前払金	855,957,843
差入委託証拠金	733,080,905
流動資産合計	177,306,617,899
資産合計	177,306,617,899



（令和 2年 3月10日現在）

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	858,398,726
未払解約金	57,748,000
未払利息	1,122
その他未払費用	19,377
流動負債合計	916,167,225
負債合計	916,167,225
純資産の部	
元本等	
元本	55,313,371,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	121,077,078,710
元本等合計	176,390,450,674
純資産合計	176,390,450,674
負債純資産合計	177,306,617,899

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 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>
	外貨建資産等の会計処理

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「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 3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		55,313,371,964口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.1889円
	(10,000口当たりの純資産額)	31,889円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(令和 2年 3月10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	7,009,964,310	-	6,154,006,467	855,957,843
	SPMINI 2003	5,107,673,670	-	4,526,330,173	581,343,497
	DJ EUR 2003	1,229,749,280	-	1,045,814,542	183,934,738
	FTSE 2003	393,529,097	-	339,434,909	54,094,188
	SPI200 2003	279,012,263	-	242,426,843	36,585,420

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	344,312,200	-	342,660,300	1,651,900
	米ドル	249,047,000	-	247,836,500	1,210,500
	カナダドル	10,637,000	-	10,588,200	48,800
	ユーロ	58,927,700	-	58,780,000	147,700
	英ポンド	9,527,700	-	9,443,000	84,700
	スウェーデンク ローナ	1,658,100	-	1,633,500	24,600
	ノルウェークロー ネ	435,400	-	432,400	3,000
	デンマーククロー ネ	792,000	-	787,500	4,500
	オーストラリアド ル	4,132,800	-	4,078,800	54,000
	ニュージーランド ドル	652,400	-	652,000	400
	香港ドル	5,353,200	-	5,312,000	41,200
	シンガポールドル	2,259,300	-	2,236,800	22,500
	イスラエルシュケ ル	889,600	-	879,600	10,000
	合計	7,354,276,510	-	6,496,666,767	857,609,743

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （その他の注記）

（令和 2年 3月10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	49,466,918,390円
同期中における追加設定元本額	16,173,638,092円
同期中における一部解約元本額	10,327,184,518円
令和 2年 3月10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	24,890,896,660円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	319,305,555円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,248,505,972円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	820,360,750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）	59,786,023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）	8,347,651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）	48,314,359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）	36,829,058円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	84,598,220円
外国株式指数ファンド	531,744,546円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	5,279,402,935円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	319,249,595円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	331,456,094円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	247,778,268円
イオン・バランス戦略ファンド	15,616,155円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,890,147円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	48,866,339円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	42,996,227円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	125,347,331円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	64,033,643円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	79,900,307円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	20,878,594円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	292,541円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	29,730円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	93,305円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	56,262円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,643,256円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,238,035,051円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,610,951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＞	66,348,893円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	1,277,164,230円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,300,061,217円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	5,571,605,594円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	17,911,308円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	92,861,126円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	379,037円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	687,889,634円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	56,493,026円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	152,626,238円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	701,728,571円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	557,103,105円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,339,934,758円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	828,564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)	291,555,239円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	117,343,880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>	647,973,567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>	5,396,452,970円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	236,866,288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>	288,673,762円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	12,249,334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>	32,449,880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>	30,030,526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>	244,746,339円
合計	55,313,371,964円

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(令和2年3月10日現在)

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	274,354,516
コール・ローン	2,108,153,350
株式	3,799,954,398
投資信託受益証券	389,775,547
投資証券	107,606,673
派生商品評価勘定	108,582,664
未収入金	150,831
未収配当金	8,777,500
前払金	436,741,686
差入委託証拠金	176,690,239
流動資産合計	7,410,787,404

##### 資産合計

7,410,787,404

#### 負債の部

##### 流動負債

派生商品評価勘定	640,665,798
未払金	859,124

(令和 2年 3月10日現在)

未払解約金	4,960,000
未払利息	6,282
その他未払費用	89,627
流動負債合計	646,580,831
負債合計	646,580,831
純資産の部	
元本等	
元本	5,969,563,517
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	794,643,056
元本等合計	6,764,206,573
純資産合計	6,764,206,573
負債純資産合計	7,410,787,404

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 金融商品取引所等の上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 2年 3月10日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		5,969,563,517口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.1331円
	(10,000口当たりの純資産額)	11,331円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（令和 2年 3月10日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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 3月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,901,520,951	-	2,464,779,265	436,741,686
	MSCIE 2003	2,901,520,951	-	2,464,779,265	436,741,686
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,984,342,378	-	3,780,418,348	203,924,030
	米ドル	3,984,342,378	-	3,780,418,348	203,924,030
	売建	1,885,099,878	-	1,776,517,296	108,582,582
	米ドル	1,884,000,000	-	1,775,426,329	108,573,671

	ブラジルリアル	1,096,333	-	1,087,382	8,951
	香港ドル	3,545	-	3,585	40
	合計	8,770,963,207	-	8,021,714,909	532,083,134

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(令和 2年 3月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,738,111,812円
同期中における追加設定元本額	1,848,276,018円
同期中における一部解約元本額	1,616,824,313円
令和 2年 3月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC つみたてNISA・全海外株インデックスファンド	2,215,627,531円
三井住友・DC 新興国株式インデックスファンド	1,715,269,057円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	556,889,588円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	592,168,852円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	444,915,294円
イオン・バランス戦略ファンド	47,098,532円
三井住友DS・DC ターゲットイヤーファンド2050	11,464,709円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	30,415,221円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	22,033,610円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	93,912,971円



三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	66,337,383円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	119,086,536円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	29,192,723円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,409,280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>	22,742,230円
合計	5,969,563,517円

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(令和2年3月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	43,867,322
投資証券	5,490,084,650
派生商品評価勘定	3,699,000
未収配当金	90,835,603
差入委託証拠金	20,647,000
流動資産合計	5,649,133,575
資産合計	5,649,133,575
負債の部	
流動負債	
前受金	3,710,000
未払金	15,334,000
未払解約金	10,727,588
未払利息	130
その他未払費用	2,423
流動負債合計	29,774,141
負債合計	29,774,141
純資産の部	
元本等	
元本	2,397,968,997
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,221,390,437
元本等合計	5,619,359,434
純資産合計	5,619,359,434
負債純資産合計	5,649,133,575

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
----	--------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		2,397,968,997口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2,3434円
	(10,000口当たりの純資産額)	23,434円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和2年3月10日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

## （デリバティブ取引に関する注記）

（令和 2年 3月10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	90,826,000	-	94,525,000	3,699,000
	東証REIT指数先物	90,826,000	-	94,525,000	3,699,000
	合計	90,826,000	-	94,525,000	3,699,000

## （注）1．時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （その他の注記）

（令和 2年 3月10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	3,086,904,697円
同期中における追加設定元本額	1,381,918,261円
同期中における一部解約元本額	2,070,853,961円
令和 2年 3月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	303,052,223円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	418,742,392円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	311,977,932円
イオン・バランス戦略ファンド	52,383,199円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,083,254,139円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,123,547円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	15,225,872円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	11,343,060円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	32,614,501円

三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	16,846,893円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,949,604円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,635,367円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	937,240円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	375,294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>	7,540,810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>	14,733,390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>	53,266,109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>	49,967,425円
合計	2,397,968,997円

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(令和2年3月10日現在)

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	112,792,931
コール・ローン	2,896,120
投資証券	5,911,022,720
派生商品評価勘定	6,300
未収入金	336,204
未収配当金	8,030,414
流動資産合計	6,035,084,689

##### 資産合計

6,035,084,689

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金	57,058,298
未払利息	8
その他未払費用	397
流動負債合計	57,058,703

##### 負債合計

57,058,703

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	3,082,959,575
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,895,066,411
元本等合計	5,978,025,986

##### 純資産合計

5,978,025,986

#### 負債純資産合計

6,035,084,689

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 9月11日 至 令和 2年 3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 2年 3月10日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		3,082,959,575口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.9391円
	(10,000口当たりの純資産額)	19,391円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 2年 3月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(令和2年3月10日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(令和2年3月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,942,200	-	27,935,900	6,300
	米ドル	16,524,800	-	16,521,600	3,200
	ユーロ	1,763,700	-	1,763,400	300
	英ポンド	4,047,300	-	4,046,700	600
	オーストラリアドル	2,040,300	-	2,039,400	900
	香港ドル	1,329,000	-	1,328,000	1,000
	シンガポールドル	2,237,100	-	2,236,800	300
合計		27,942,200	-	27,935,900	6,300

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

( 令和 2年 3月10日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,482,007,106円
同期中における追加設定元本額	1,186,238,323円
同期中における一部解約元本額	585,285,854円
令和 2年 3月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	37,376,988円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	42,466,360円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	32,781,872円
イオン・バランス戦略ファンド	14,811,163円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,802,428,904円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	1,816,146円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	17,749,375円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	12,987,870円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	35,765,226円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	19,304,888円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	15,715,384円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,134,334円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	392,853円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	422,069円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド <適格機関投資家限定>	8,353,532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>	14,452,611円
合計	3,082,959,575円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2020年 3月31日現在

資産総額	379,016,866円
負債総額	4,163,739円
純資産総額（ - ）	374,853,127円
発行済口数	393,560,596口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9525円
（1万口当たり純資産額）	（9,525円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割



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

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2020年3月31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3月31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	751	6,962,544
単位型株式投資信託	122	555,128
追加型公社債投資信託	1	28,505
単位型公社債投資信託	185	467,368
合計	1,059	8,013,546

## 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		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	354,695		1,462
投資有価証券償還損		141,666		13,668
投資有価証券売却損		9,634		14,605
関係会社株式評価損	3	-		160,455
合併関連費用	4	-		187,140

特別損失合計	505,996	377,331
税引前当期純利益	7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税	2,350,891	1,750,031
法人税等調整額	280,166	90,084
法人税等合計	2,070,725	1,840,116
当期純利益	4,955,483	4,183,413

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413

株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。



数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

##### (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

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

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

##### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

#### 2 当座借越契約

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

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

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

#### 3 保証債務

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

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

##### (損益計算書関係)

#### 1 過去勤務費用償却益

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

#### 2 固定資産除却損

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

#### 3 関係会社株式評価損

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

#### 4 合併関連費用

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

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

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

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

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成31年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

#### 負債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成30年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成31年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度（平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
728,127	7,247	14,605

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

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

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した

上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額（注）	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

（セグメント情報等）

前事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	------------	-----	-------------	-----------	----------------	-----------	-------	------	----	------



親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又は 職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

### (1 株当たり情報)

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

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

### (重要な後発事象)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

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

当事業年度(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

取得による企業結合

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

## 1. 企業結合の概要

### (1) 被取得企業の名称及び事業の内容

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

### (2) 企業結合を行う主な理由

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

### (3) 企業結合日

平成31年4月1日

### (4) 企業結合の法的形式

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

### (5) 結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

### (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

### (1) 合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたしました。

### (2) 合併比率の算定方法

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

### (3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

## 4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間  
(令和1年9月30日)

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

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当中間期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			77,989	77,989	77,989
当中間期変動額合計	1,881,513	80,045,486	77,989	77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 2～50年

器具備品 3～20年

## (2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

## (3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3．引当金の計上基準

## (1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間にお

いて発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(中間損益計算書)

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

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

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,557,220千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額150,945千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

(変動事由の概要)

合併に伴う普通株式の発行による増加 16,230,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間（令和1年9月30日）

令和1年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

(単位：千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

その他有価証券

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

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

(7) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

(有価証券関係)

第35期中間会計期間（令和1年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 11,208,183千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

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

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 45,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

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



## 1. 企業結合の概要

## (1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

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

## (2) 企業結合を行った主な理由

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

## (3) 企業結合日

平成31年4月1日

## (4) 企業結合の法的形式

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

## (5) 結合後企業の名称

三井住友D S アセットマネジメント株式会社

## (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成31年1月16日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成31年1月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年4月1日から令和1年9月30日

## 3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

## 4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

## (1) 合併比率

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

## (2) 合併比率の算定方法

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

## (3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

## 6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

## (1) 発生したのれんの金額

37,043,811千円

## (2) 発生原因

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

## (3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

## 7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

## （資産除去債務関係）

当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

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

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

なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

## （セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

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

（参考）大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**強調事項**

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**（1）貸借対照表**

（単位：千円）

	第46期 （平成30年3月31日）	第47期 （平成31年3月31日）
資産の部		

流動資産			
現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

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

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

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

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

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

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	繰越利益剰余金
				別途積立金		
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 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。 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。 建物 2～30年 器具備品 4～15年 （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。 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。 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 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

(追加情報)

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

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

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

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

第47期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当た り配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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

## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

## (1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

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

## 関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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



## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円		
株式会社S B I証券	48,323百万円		
auカブコム証券株式会社	7,196百万円		
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円		
岡三にいがた証券株式会社	852百万円		
静岡東海証券株式会社	600百万円		
フィリップ証券株式会社	950百万円		
松井証券株式会社	11,945百万円		
マネックス証券株式会社	12,200百万円		
楽天証券株式会社	7,495百万円		
株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円		銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	27,484百万円		
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。	

資本金の額は、2019年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(1)「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
  - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。
  - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
  - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
  - (8) 「ご購入の際は、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
  - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
  - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
  - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の監査報告書**

令和1年10月21日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの平成30年9月11日から令和1年9月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの令和1年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

令和1年11月22日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

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

## 利害関係

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

以 上

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



**独立監査人の中間監査報告書**

令和2年4月21日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの令和1年9月11日から令和2年3月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの令和2年3月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和1年9月11日から令和2年3月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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