

## 【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11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・資産最適化ファンド（1安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） 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・資産最適化ファンド（１安定重視型）

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

以下、上記ファンドを総称して、「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。また、各ファンドをそれぞれ「１安定重視型」、「２やや安定型」、「３バランス型」、「４やや成長型」、「５成長重視型」と略称でいうことがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド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、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」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。

## (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12日から2020年12月10日まで

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

## (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

## (9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

## (10) 【払込取扱場所】

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

## (11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

#### ハ スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」(ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること)による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

#### ニ 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。 )。

#### ホ 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。

#### ヘ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、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。

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単字型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型		その他資産 ( )
	内外	資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

す。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年9月14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DSアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>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行います。

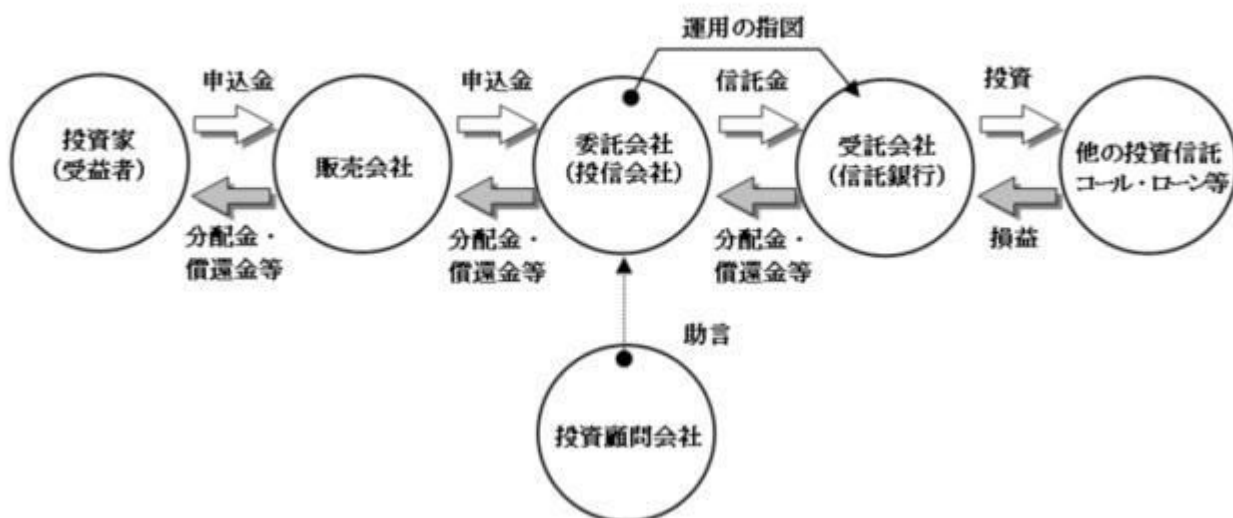
〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。

### 運営の仕組み



#### □ 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

##### (ハ) 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

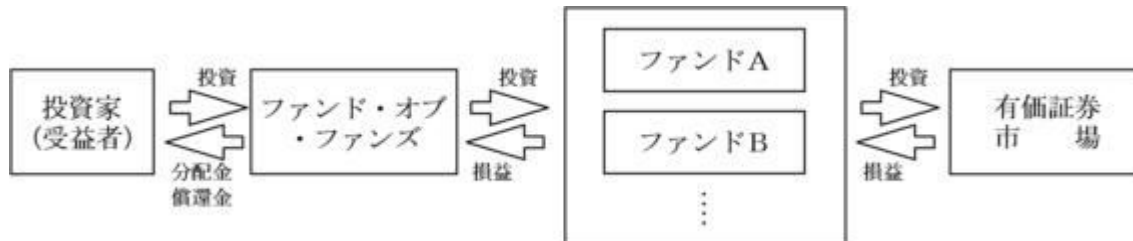


住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 八 ファンドの運用形態(ファンド・オブ・ファンズによる運用)

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

### 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

(1 安定重視型) 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

(2 やや安定型) 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

(3 バランス型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

(4 やや成長型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

(5 成長重視型) 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

( ) 主として、国内株式、先進国株式(除く日本)、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券(除く日本)、為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)、新興国債券に投資します。

( ) 投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

(ロ) イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

( ) 基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク(標準偏差)および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

(ハ) 実質組入外貨建資産については、投資信託証券内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) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (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。
- (ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

#### ■投資対象とする投資信託の投資方針等

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

#### ▶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)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。</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に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>●保有する外貨建て資産については、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%

## 為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <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に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>●保有する外貨建て資産については、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%

新興国債券…為替ヘッジなし<sup>\*1</sup>

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックス(米ドルベース)をベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。</li> <li>●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。</li> </ul>
取引通貨	米ドル
管理報酬等 <sup>*2</sup>	年0.39%
一般投資者の日本での購入の可否 <sup>*3</sup>	日本において一般投資者の購入が可能です。

※1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

※2 管理報酬等とはETFの運用管理費用およびその他費用をETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値はETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

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

## ▶ 株式

## 国内株式

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

## 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)の動きに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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。</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)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。</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(REIT)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。</li> <li>● 日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とします。</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%



## ファンドの特色

1

投資信託証券への投資を通じて、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。

インデックスファンドや上場投資信託証券(ETF)への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

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

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

イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

3

目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。



### 目標リスク水準とは

目標リスク水準は各ファンドのリスク(標準偏差)の目安を表示したものです。  
一般にリスクの数値が大きいほどリターン(収益)の振れ幅が大きくなる傾向があります。

**1安定重視型** 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

**2やや安定型** 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

**3バランス型** 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

**4やや成長型** 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

**5成長重視型** 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

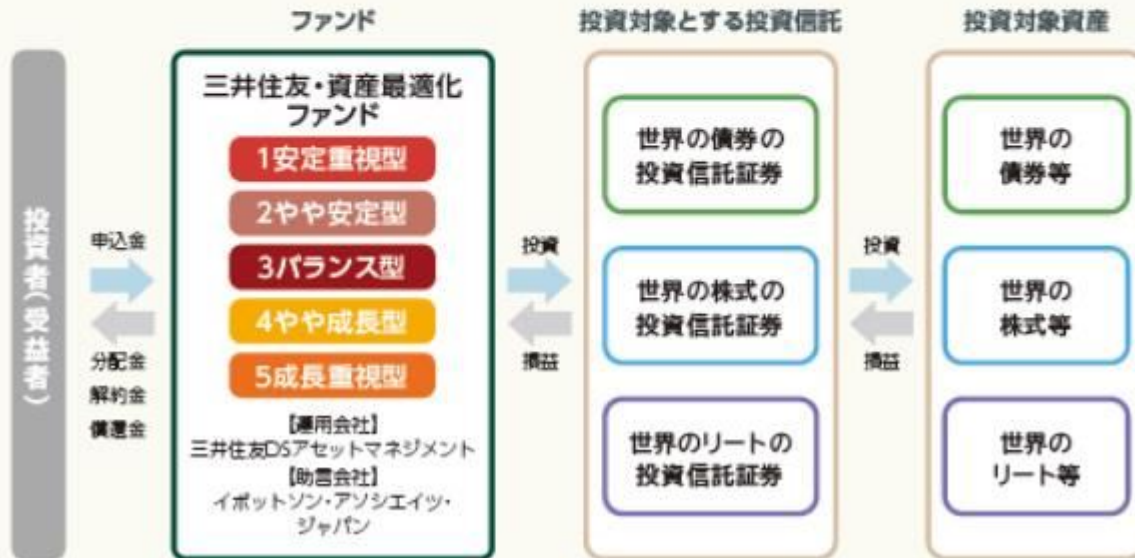
4

実質組入外貨建資産については、投資信託証券内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。

## ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

■投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

### 〔5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ〕



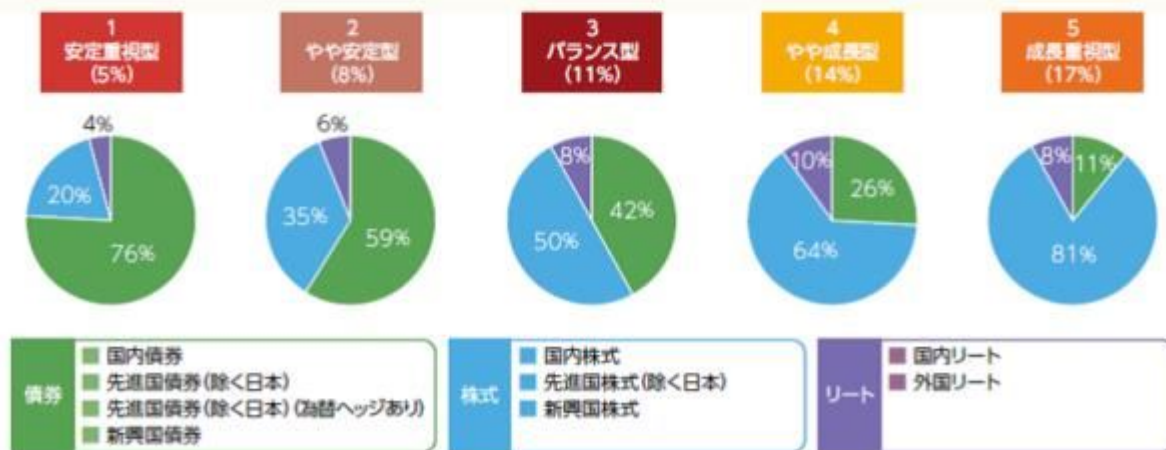
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※目標リスク水準は2020年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ポートフォリオの基本資産配分イメージ

■目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。



※( )内の数値は目標リスク水準です。

※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。

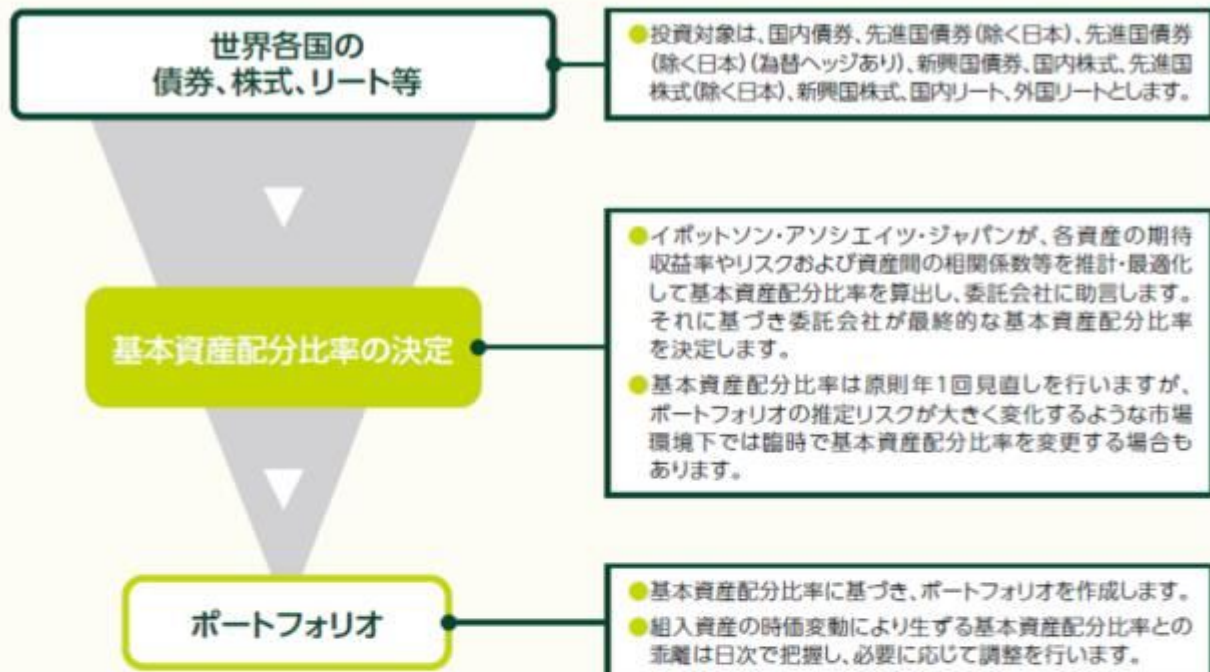
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2020年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。



## 運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象とし、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの助言に基づき基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2020年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について



- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。
- 1977年にロジャー・G・イボットソン(イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国 Ibbotson Associates, Inc. (現Morningstar Investment Management LLC) を設立しました。
- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、資本市場の長期的なリターンとリスクの調査研究に基づいて、中立的な立場から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

### (2) 【投資対象】

#### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

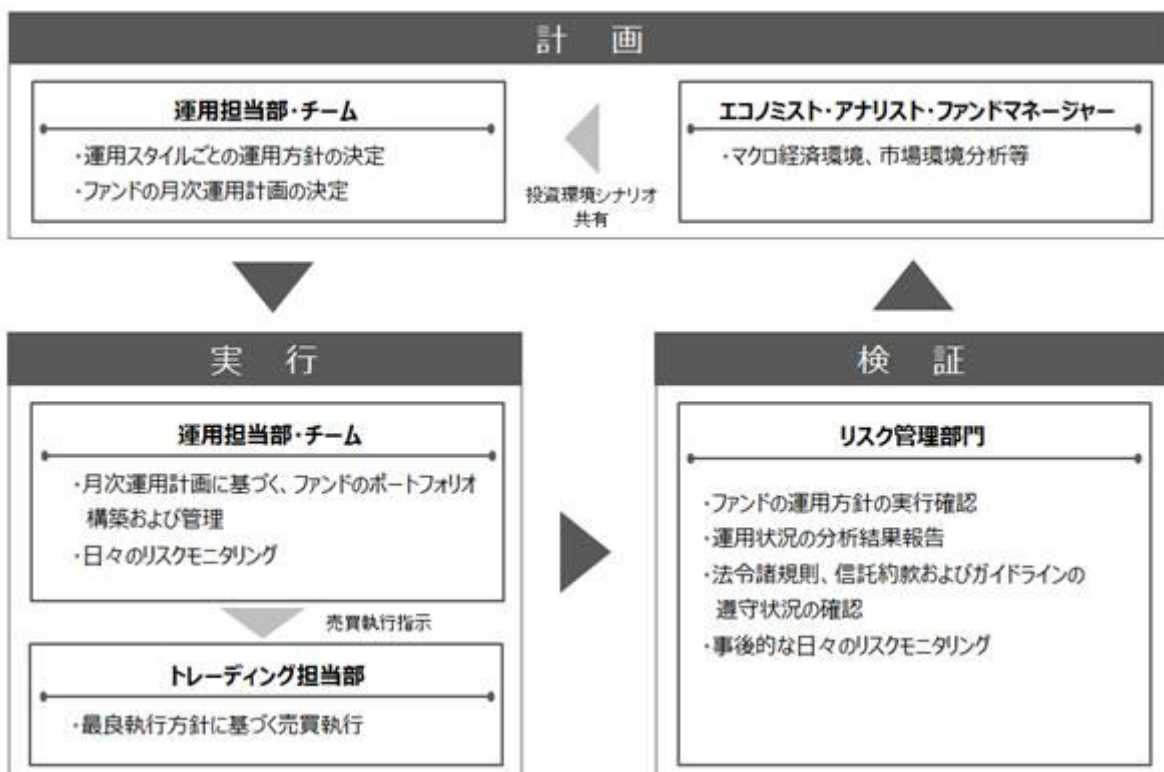
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

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

### （3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

□ 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）【配分方針】

年１回（原則として毎年９月15日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- 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 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 公社債の借入れの指図
  - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができません。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
  - （ロ）公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
  - （ハ）信託財産の一部解約等の事由により、借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ト 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。

チ 外国為替予約取引の指図

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

リ 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。

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）は、実質外貨建資産に対し原則として対円で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



ファンドの資金流出入に伴い、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場合があります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

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

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ■1安定重視型



### 「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。



#### ■2やや安定型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ■3 バランス型



### 「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。



#### ■4 やや成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

### ■5成長重視型

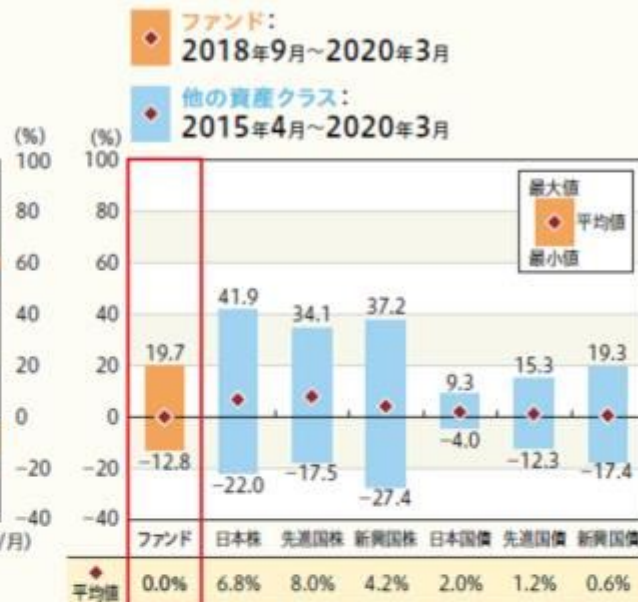


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※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。

## 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】

ファンド	純資産総額に年0.968% (税抜き0.88%) の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分(税抜き) >		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.39%	ファンドの運用等の対価
	販売会社	年0.46%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。 委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。		
投資対象とする投資信託	年0.39%程度(最大) <sup>*</sup> 管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年1.007%(最大)(税抜き0.919%)程度 <sup>*</sup> 実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。 ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。		

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

## (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0066% (税抜き0.006%) 以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、外国における資産の保管等に要する費用、および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）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

#### （５）【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

- （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- （ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

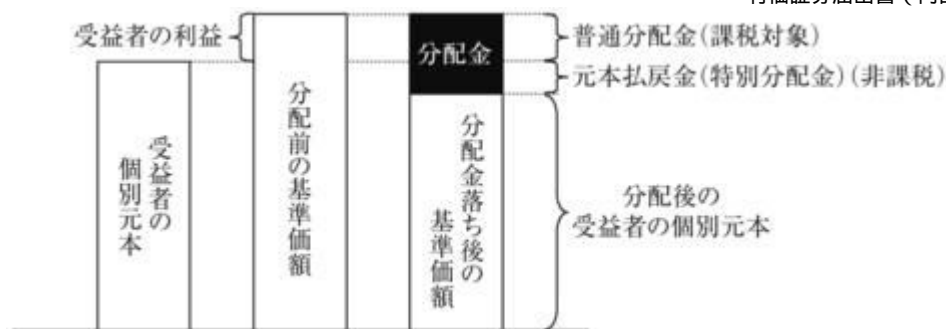
##### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

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

#### ・ 一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。

また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	公募株式投資信託（新たに購入が必要）	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる <b>配当所得</b> および <b>譲渡所得</b>	
利用対象と なる方	<b>20歳以上</b> の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	<b>0～19歳</b> の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長 <b>5年間</b> （投資期間は2023年まで）	
利用できる 限度額	<b>120万円/年</b> (最大 <b>600万円</b> )	<b>80万円/年</b> (最大 <b>400万円</b> )

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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	20,016,988	0.94
親投資信託受益証券	日本	2,091,928,421	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,690,716	1.01
合計(純資産総額)		2,133,636,125	100.00

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	16,963,549	1.68
親投資信託受益証券	日本	980,360,362	97.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,228,462	1.02
合計(純資産総額)		1,007,552,373	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	54,559,016	2.55
親投資信託受益証券	日本	2,065,451,480	96.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		22,227,733	1.03
合計(純資産総額)		2,142,238,229	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)

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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	30,205,720	3.55
親投資信託受益証券	日本	810,618,206	95.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,198,453	1.09
合計(純資産総額)		850,022,379	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	40,807,939	4.61
親投資信託受益証券	日本	834,297,386	94.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,648,399	1.09
合計(純資産総額)		884,753,724	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

## 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	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,050,444,772	1.2967	1,362,190,258	1.2846	1,349,401,354	63.24
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	64,967,115	3.5555	230,994,511	3.1452	204,334,570	9.58
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)	84,219,441	2.5221	212,409,853	2.2719	191,338,148	8.97
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	71,661,252	1.4712	105,432,024	1.5253	109,304,907	5.12
日本	親投資信託受 益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	56,776,890	1.8026	102,346,420	1.8646	105,866,189	4.96
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	25,359,901	2.2139	56,145,148	1.9658	49,852,493	2.34
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	25,962,928	1.9994	51,911,478	1.6524	42,901,142	2.01
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	36,509,067	1.2631	46,115,111	1.0663	38,929,618	1.82
アメリカ	投資信託受 益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米 ドル建てエマージング・マーケット 債券ETF	1,888	12,077.73	22,802,758	10,602.21	20,016,988	0.94

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(%)
投資信託受益証券	0.94
親投資信託受益証券	98.05
合計	98.98

## 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

## 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	国内債券パッシブ・マザーファンド	338,382,457	1.2972	438,954,950	1.2846	434,686,104	43.14
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	53,821,410	3.5645	191,846,416	3.1452	169,279,098	16.80
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）	72,638,725	2.5114	182,424,894	2.2719	165,027,919	16.38
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	60,159,644	1.8039	108,521,982	1.8646	112,173,672	11.13
日本	親投資信託受 益証券	リート・インデックス・マザー ファンド	17,271,591	2.2758	39,308,326	1.9658	33,952,493	3.37
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	17,024,151	2.0713	35,262,746	1.6524	28,130,707	2.79
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	24,955,594	1.2819	31,991,313	1.0663	26,610,149	2.64
アメリカ	投資信託受益 証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米 ドル建てエマージング・マーケット 債券ETF	1,600	12,331.63	19,730,609	10,602.21	16,963,549	1.68
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	6,884,036	1.4706	10,124,313	1.5253	10,500,220	1.04

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（%）
投資信託受益証券	1.68
親投資信託受益証券	97.30
合計	98.98

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

## 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	国内債券パッシブ・マザーファンド	455,781,139	1.2965	590,940,654	1.2846	585,496,451	27.33
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	153,231,895	3.5816	548,818,921	3.1452	481,944,956	22.50
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）	208,213,914	2.5376	528,363,629	2.2719	473,041,191	22.08
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	113,820,288	1.8038	205,309,036	1.8646	212,229,309	9.91
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	108,688,669	1.2742	138,499,866	1.0663	115,894,727	5.41
日本	親投資信託受益証券	リリート・インデックス・マザーファンド	48,367,096	2.3002	111,254,383	1.9658	95,080,037	4.44
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	48,083,120	2.0481	98,480,573	1.6524	79,452,547	3.71
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	5,146	12,330.53	63,452,925	10,602.21	54,559,016	2.55
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	14,628,114	1.4701	21,505,687	1.5253	22,312,262	1.04

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 (%)
投資信託受益証券	2.55
親投資信託受益証券	96.42
合計	98.96

#### 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

##### 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	74,491,862	3.6113	269,014,191	3.1452	234,291,804	27.56
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）	100,341,929	2.5466	255,530,757	2.2719	227,966,828	26.82
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	76,392,632	1.2977	99,136,941	1.2846	98,133,975	11.54
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	74,360,743	1.2832	95,422,501	1.0663	79,290,860	9.33
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	40,814,859	1.8025	73,568,784	1.8646	76,103,386	8.95
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	22,685,667	2.3469	53,242,556	1.9658	44,595,484	5.25
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	24,860,566	2.0833	51,793,586	1.6524	41,079,599	4.83
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	2,849	12,323.64	35,110,055	10,602.21	30,205,720	3.55
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	6,002,931	1.4702	8,825,804	1.5253	9,156,270	1.08

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（%）
投資信託受益証券	3.55
親投資信託受益証券	95.36
合計	98.92

#### 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

#### 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	90,349,581	3.6006	325,315,040	3.1452	284,167,502	32.12
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 )	122,985,532	2.5538	314,080,511	2.2719	279,410,830	31.58
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	138,114,407	1.2775	176,454,428	1.0663	147,271,392	16.65
アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	3,849	12,274.10	47,243,036	10,602.21	40,807,939	4.61
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	19,521,125	1.8002	35,141,930	1.8646	36,399,089	4.11
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	17,797,692	2.3952	42,629,792	1.9658	34,986,702	3.95
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	20,189,353	2.1067	42,533,891	1.6524	33,360,886	3.77
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	6,248,863	1.4700	9,185,829	1.5253	9,531,390	1.08
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	7,138,094	1.2981	9,265,960	1.2846	9,169,595	1.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2020年 3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	4.61
親投資信託受益証券	94.30
合計	98.91

#### 【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド( 1 安定重視型 )

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド( 2 やや安定型 )

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド( 3 バランス型 )

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド( 4 やや成長型 )

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
第2期 (2019年 9月17日)	1,356,985,451	1,356,985,451	10,327	10,327
2019年 3月末日	808,320,955		10,062	
4月末日	897,367,643		10,051	
5月末日	974,178,214		10,024	

6月末日	1,082,793,377		10,190	
7月末日	1,215,162,658		10,251	
8月末日	1,327,701,728		10,301	
9月末日	1,394,269,619		10,335	
10月末日	1,515,931,168		10,407	
11月末日	1,686,690,607		10,429	
12月末日	1,853,752,241		10,450	
2020年 1月末日	2,068,736,400		10,466	
2月末日	2,118,303,307		10,319	
3月末日	2,133,636,125		9,927	

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2018年 9月18日)	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
第2期 (2019年 9月17日)	680,523,123	680,523,123	10,310	10,310
2019年 3月末日	385,989,532		10,074	
4月末日	424,917,993		10,129	
5月末日	450,114,344		9,947	
6月末日	509,700,538		10,137	
7月末日	588,218,826		10,226	
8月末日	633,133,823		10,161	
9月末日	686,692,392		10,298	
10月末日	777,755,757		10,467	
11月末日	862,725,436		10,539	
12月末日	909,455,342		10,610	
2020年 1月末日	972,900,595		10,601	
2月末日	1,015,669,038		10,286	
3月末日	1,007,552,373		9,712	

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2018年 9月18日)	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
第2期 (2019年 9月17日)	1,355,636,779	1,355,636,779	10,443	10,443
2019年 3月末日	906,238,225		10,219	
4月末日	996,739,685		10,341	

5月末日	1,001,891,370		10,011	
6月末日	1,116,280,214		10,237	
7月末日	1,199,668,754		10,354	
8月末日	1,268,779,411		10,175	
9月末日	1,381,699,451		10,409	
10月末日	1,538,890,784		10,667	
11月末日	1,750,229,498		10,786	
12月末日	1,948,392,019		10,911	
2020年 1月末日	2,071,870,915		10,871	
2月末日	2,124,198,784		10,387	
3月末日	2,142,238,229		9,597	

## 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
第2期 (2019年 9月17日)	635,299,500	635,299,500	10,455	10,455
2019年 3月末日	435,196,799		10,247	
4月末日	466,803,439		10,425	
5月末日	481,223,378		9,968	
6月末日	531,115,503		10,223	
7月末日	565,350,805		10,358	
8月末日	583,280,246		10,079	
9月末日	650,261,247		10,398	
10月末日	713,799,129		10,739	
11月末日	770,193,225		10,901	
12月末日	846,302,168		11,082	
2020年 1月末日	878,245,953		11,007	
2月末日	866,526,726		10,368	
3月末日	850,022,379		9,327	

## 三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
第2期 (2019年 9月17日)	758,503,160	758,503,160	10,399	10,399
2019年 3月末日	631,975,338		10,235	

4月末日	647,670,065		10,480
5月末日	644,001,522		9,878
6月末日	696,760,584		10,175
7月末日	723,447,029		10,313
8月末日	725,817,711		9,912
9月末日	753,210,606		10,300
10月末日	790,434,309		10,720
11月末日	819,395,628		10,927
12月末日	870,091,565		11,192
2020年 1月末日	917,253,617		11,050
2月末日	889,578,643		10,274
3月末日	884,753,724		9,009

## 【分配の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	収益率（％）
第1期	1.1
第2期	4.4
第3期（中間期）	6.2

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	収益率（％）
第1期	0.2
第2期	2.9
第3期（中間期）	9.9

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	収益率（％）
第1期	2.7
第2期	1.7
第3期（中間期）	13.6

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	収益率（％）
第1期	3.7



第2期	0.9
第3期(中間期)	17.3

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

	収益率(%)
第1期	4.5
第2期	0.4
第3期(中間期)	20.7

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

#### (4)【設定及び解約の実績】

#### 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	197,260,985	6,814,601
第2期	1,242,016,819	118,444,252
第3期(中間期)	931,929,330	164,819,838

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	235,257,377	140,052,522
第2期	593,034,885	28,199,968
第3期(中間期)	421,860,318	63,437,429

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	426,008,460	139,473,752
第2期	1,111,549,352	100,006,600
第3期(中間期)	976,184,247	136,799,725

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	411,158,724	219,693,175
第2期	485,641,046	69,477,173
第3期（中間期）	356,949,717	75,744,618

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	762,271,388	307,261,790
第2期	481,502,084	207,078,502
第3期（中間期）	379,799,066	178,543,955

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2020年 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

#### 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

## 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

## 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

## (2) 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

##### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 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

## □ 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- GENUSSCHEIN	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

□ 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

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

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	WIP 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

## 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

## □ 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

## 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

## 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	97.88
合計	97.88

## 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)

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

□ 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

## 投資不動産物件

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・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。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2020年 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
	イスラエルシェケル	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
イスラエルシェケル	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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・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
	デンマーククローネ	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。

## 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

### 1 安定重視型



※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。

### 2 やや安定型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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。

### 3 バランス型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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。

## ■ 4 やや成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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。

## ■ 5 成長重視型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

### ■1 安定重視型

#### 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	98.05
投資信託受益証券	アメリカ	0.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.01
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	63.24
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9.58
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)	8.97
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	5.12
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	4.96
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	2.34
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	2.01
日本	親投資信託受益証券	エマーシング株式インデックス・マザーファンド	1.82
アメリカ	投資信託受益証券	シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマーシング・マーケット債券ETF	0.94

### ■2 やや安定型

#### 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	97.30
投資信託受益証券	アメリカ	1.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.02
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	43.14
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	16.80
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)	16.38
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	11.13
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	3.37
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	2.79
日本	親投資信託受益証券	エマーシング株式インデックス・マザーファンド	2.64
アメリカ	投資信託受益証券	シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマーシング・マーケット債券ETF	1.68
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	1.04

### ■3 バランス型

#### 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	96.42
投資信託受益証券	アメリカ	2.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.03
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	27.33
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	22.50
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)	22.08
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	9.91
日本	親投資信託受益証券	エマーシング株式インデックス・マザーファンド	5.41
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	4.44
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	3.71
アメリカ	投資信託受益証券	シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマーシング・マーケット債券ETF	2.55
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	1.04

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## ■ 4 やや成長型

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.36
投資信託受益証券	アメリカ	3.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.09
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	27.56
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)	26.82
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	11.54
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	9.33
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	8.95
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	5.25
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	4.83
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	3.55
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	1.08

## ■ 5 成長重視型

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.30
投資信託受益証券	アメリカ	4.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.09
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	32.12
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)	31.58
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	16.65
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券ETF	4.61
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	4.11
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	3.95
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	3.77
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	1.08
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1.04

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
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

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 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

## ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/02/29	0.81
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

※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。



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

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
クウェート	国債証券	KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) MTN RegS 3.5% 3/20/2027	3.500	2027/03/20	0.92
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1% 6/18/2050	5.100	2050/06/18	0.90
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25% 6/23/2047	5.250	2047/06/23	0.86
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 5.1% 4/23/2048	5.100	2048/04/23	0.79
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 4.82% 3/14/2049	4.820	2049/03/14	0.79
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.63% 11/18/2050	5.630	2050/11/18	0.73
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 8.75% 11/21/2033	8.750	2033/11/21	0.72
コロンビア	国債証券	COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5% 6/15/2045	5.000	2045/06/15	0.65
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 4.97% 4/20/2055	4.970	2055/04/20	0.59
ウクライナ	国債証券	UKRAINE REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS 7.38% 9/25/2032	7.380	2032/09/25	0.57

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

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

※国・地域は発行国基準です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.58
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	NTTDコム	情報・通信業	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.15

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、株価指数先物取引の買建て(1.93%)を行っています。

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	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

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(2.14%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	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

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(38.83%)を行っています。

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	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

※上記のほか、Jリート・インデックス・マザーファンドにおいて、リート指数先物取引の買建て(1.95%)を行っています。

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

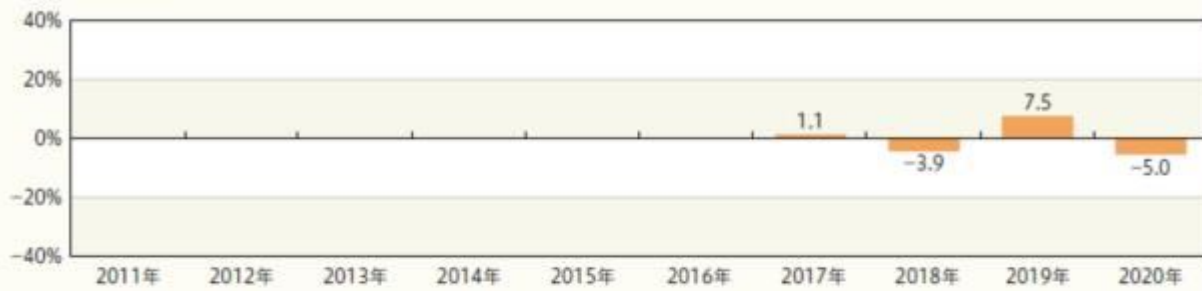
## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	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

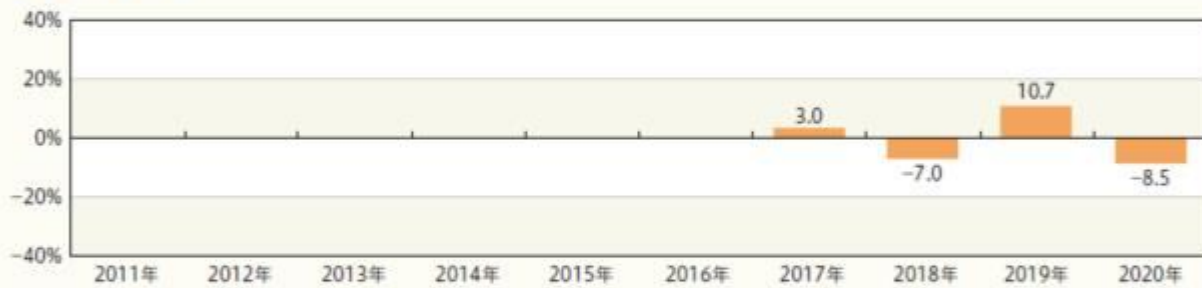
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

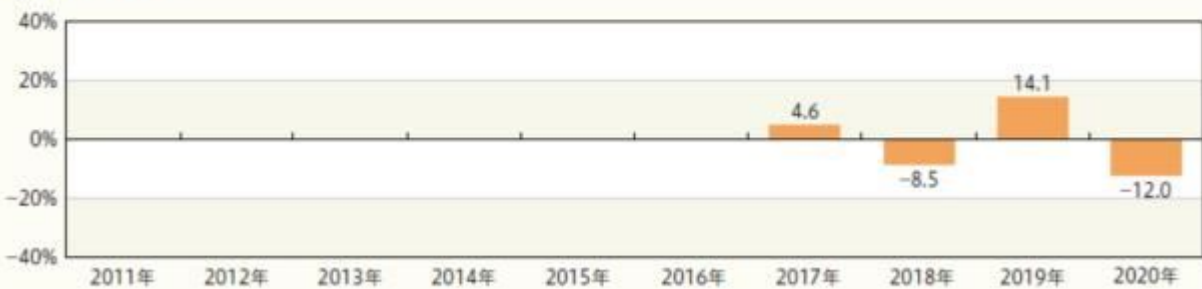
### ■ 1 安定重視型



### ■ 2 やや安定型



### ■ 3 バランス型



※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。

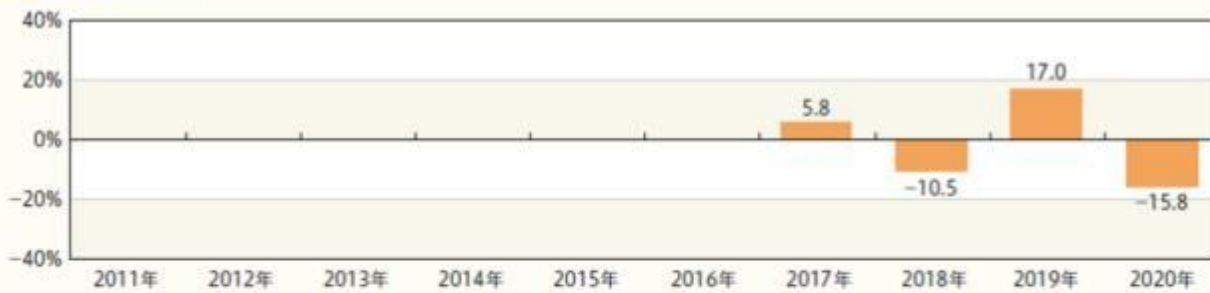
※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2020年のファンドの収益率は、年初から2020年3月31日までの騰落率を表示しています。

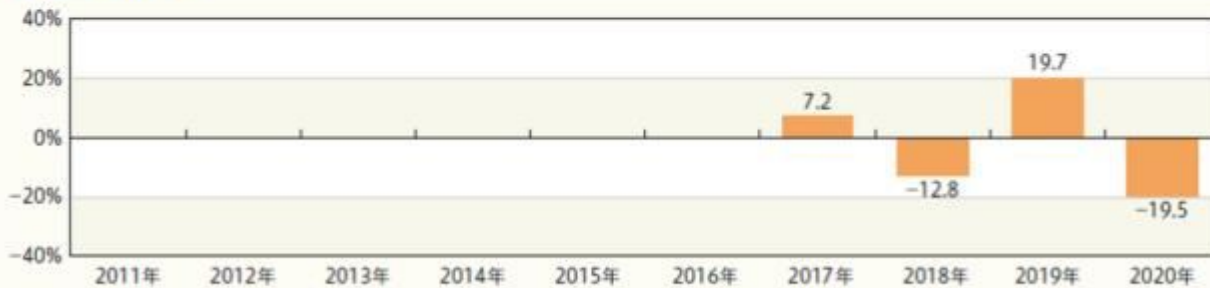
※ファンドにはベンチマークはありません。



## ■ 4 やや成長型



## ■ 5 成長重視型



※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9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。  
 ※2020年のファンドの収益率は、年初から2020年3月31日までの騰落率を表示しています。  
 ※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## イ 申込方法

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

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

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

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。

(ニ) 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。）。

## □ 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。

## 八 申込手数料

ありません。

## 二 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。

## へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

## ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、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（借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「1安定重視型」は「最適安定重視」、「2やや安定型」は「最適やや安定」、「3バランス型」は「最適バランス」、「4やや成長型」は「最適やや成長」、「5成長重視型」は「最適成長重視」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9月14日から2037年9月15日まで、もしくは下記「(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16日から翌年9月15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、各ファンドにつき残存口数が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発送します。
  - 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無手数料で再投資され、再投

資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (ロ) 償還金

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

#### 八 信託約款の変更等

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。

(ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

#### 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### ホ 販売会社との契約の更改等

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

#### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### ト 公告

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



す。

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

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

#### チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。

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

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

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### ハ 一部解約実行請求権

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

#### ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。



### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド(1 安定重視型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月18日現在)	第2期 (令和 1年 9月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	8,977	133,209
コール・ローン	2,823,416	19,226,553
投資信託受益証券	1,593,827	13,349,844
親投資信託受益証券	184,201,977	1,329,809,908
未収入金	-	4,000,000
流動資産合計	188,628,197	1,366,519,514
資産合計	188,628,197	1,366,519,514
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	48,677	4,474,491
未払受託者報酬	7,330	171,308
未払委託者報酬	207,733	4,853,613
未払利息	7	55
その他未払費用	1,416	34,596
流動負債合計	265,163	9,534,063
負債合計	265,163	9,534,063
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	190,446,384	1,314,018,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,083,350	42,966,500
元本等合計	188,363,034	1,356,985,451
純資産合計	188,363,034	1,356,985,451
負債純資産合計	188,628,197	1,366,519,514

## (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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自	平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
営業収益				
受取配当金		8,975		340,394
受取利息		1		515
有価証券売買等損益		195,087		54,697,787
為替差損益		10,776		249,283
営業収益合計		175,335		54,789,413
営業費用				
支払利息		223		6,020
受託者報酬		8,259		244,877
委託者報酬		234,151		6,938,043
その他費用		8,257		88,084
営業費用合計		250,890		7,277,024
営業利益又は営業損失( )		426,225		47,512,389
経常利益又は経常損失( )		426,225		47,512,389
当期純利益又は当期純損失( )		426,225		47,512,389
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( )		46,370		1,736,508
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		2,083,350
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,451		1,442,513
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,451		1,442,513
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,708,946		2,168,544
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,708,946		2,168,544
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,083,350		42,966,500

## ( 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19日 至 令和 1年 9月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 9月19日から令和 1年 9月17日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	( 平成30年 9月18日現在 )	( 令和 1年 9月17日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	190,446,384口	1,314,018,951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 2,083,350円	元本の欠損

3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	0.9891円 9,891円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.0327円 10,327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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（458,464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（222,622円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は681,086円（1万口当たり35.75円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,157,116円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（29,917,633円）、収益調整金（6,145,400円）、および分配準備積立金（383,439円）より、分配対象収益は51,603,588円（1万口当たり392.69円）であります。分配を行っておりません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期
	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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17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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券



## 第1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	18,064円
親投資信託受益証券	146,067円
合計	164,131円

## 第2期（自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	509,856円
親投資信託受益証券	17,867,098円
合計	18,376,954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19日 至 令和 1年 9月17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 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
期首元本額	2,000,000円	190,446,384円
期中追加設定元本額	195,260,985円	1,242,016,819円
期中一部解約元本額	6,814,601円	118,444,252円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,091	123,381.19	
	米ドル 小計		1,091	123,381.19 (13,349,844)	
投資信託受益証券合計				13,349,844 (13,349,844)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	49,266,302	125,678,336	
		外国株式インデックス・マザーファンド	34,094,377	124,567,215	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	44,542,125	65,543,736	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	37,548,866	67,366,420	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	664,371,830	863,550,504	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	10,585,962	26,975,148	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	12,331,320	27,490,211	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	22,116,255	28,638,338	
親投資信託受益証券合計			874,857,037	1,329,809,908	
合計				1,343,159,752 (13,349,844)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	1.0%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	21,365	135,509
コール・ローン	4,421,227	9,528,350
投資信託受益証券	1,653,299	13,068,408
親投資信託受益証券	91,960,491	660,650,074
未収入金	-	360,000
流動資産合計	98,056,382	683,742,341
資産合計	98,056,382	683,742,341
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,434,493	805,680
未払受託者報酬	6,637	81,721
未払委託者報酬	188,265	2,315,344
未払利息	12	27
その他未払費用	1,261	16,446
流動負債合計	2,630,668	3,219,218
負債合計	2,630,668	3,219,218
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	95,204,855	660,039,772
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	220,859	20,483,351
元本等合計	95,425,714	680,523,123
純資産合計	95,425,714	680,523,123
負債純資産合計	98,056,382	683,742,341

## (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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自	平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
営業収益				
受取配当金		21,357		330,659
受取利息		4		563
有価証券売買等損益		832,229		24,880,066
為替差損益		821		210,478
営業収益合計		811,689		25,000,810
営業費用				
支払利息		323		2,630
受託者報酬		9,596		118,383
委託者報酬		271,964		3,354,116
その他費用		41,545		65,743
営業費用合計		323,428		3,540,872
営業利益又は営業損失( )		1,135,117		21,459,938
経常利益又は経常損失( )		1,135,117		21,459,938
当期純利益又は当期純損失( )		1,135,117		21,459,938
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( )		1,595,346		384,216
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		220,859
剰余金増加額又は欠損金減少額		685,417		274,152
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		274,152
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		685,417		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		924,787		1,087,382
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		924,787		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,087,382
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		220,859		20,483,351

## ( 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19日 至 令和 1年 9月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 9月19日から令和 1年 9月17日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	( 平成30年 9月18日現在 )	( 令和 1年 9月17日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	95,204,855口	660,039,772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) 1.0023円 10,023円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0310円 10,310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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（454,312円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（5,917円）、収益調整金（221,376円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は681,605円（1万口当たり71.58円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,384,693円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（13,691,029円）、収益調整金（5,094,833円）、および分配準備積立金（428,649円）より、分配対象収益は26,599,204円（1万口当たり402.97円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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17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(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券



## 第1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	33,470円
親投資信託受益証券	707,188円
合計	673,718円

## 第2期（自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	490,483円
親投資信託受益証券	12,894,330円
合計	13,384,813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19日 至 令和 1年 9月17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 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
期首元本額	2,000,000円	95,204,855円
期中追加設定元本額	233,257,377円	593,034,885円
期中一部解約元本額	140,052,522円	28,199,968円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,068	120,780.12	
	米ドル 小計		1,068	120,780.12 (13,068,408)	
投資信託受益証券合計				13,068,408 (13,068,408)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	43,720,759	111,531,656	
		外国株式インデックス・マザーファンド	30,009,713	109,643,487	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4,912,620	7,228,920	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	40,579,240	72,803,214	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	230,357,700	299,418,938	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	7,675,091	19,557,666	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	8,927,413	19,901,881	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	15,881,004	20,564,312	
親投資信託受益証券合計			382,063,540	660,650,074	
合計				673,718,482 (13,068,408)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	1.9%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	129,631	286,800
コール・ローン	5,206,866	20,948,771
投資信託受益証券	7,957,245	38,116,192
親投資信託受益証券	281,631,985	1,302,968,211
流動資産合計	294,925,727	1,362,319,974
資産合計	294,925,727	1,362,319,974
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,455,666
未払受託者報酬	27,299	176,998
未払委託者報酬	773,405	5,014,777
未払利息	14	60
その他未払費用	5,423	35,694
流動負債合計	806,141	6,683,195
負債合計	806,141	6,683,195
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	286,534,708	1,298,077,460
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,584,878	57,559,319
元本等合計	294,119,586	1,355,636,779
純資産合計	294,119,586	1,355,636,779
負債純資産合計	294,925,727	1,362,319,974

## (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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自	平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		129,574		1,133,348
受取利息		35		1,810
有価証券売買等損益		310,478		51,231,099
為替差損益		84,846		778,447
営業収益合計		96,023		51,587,810
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,202		6,225
受託者報酬		36,581		266,039
委託者報酬		1,036,358		7,537,477
その他費用		77,819		116,266
営業費用合計		1,151,960		7,926,007
営業利益又は営業損失( )		1,247,983		43,661,803
経常利益又は経常損失( )		1,247,983		43,661,803
当期純利益又は当期純損失( )		1,247,983		43,661,803
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( )		2,982,686		481,971
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		7,584,878
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,896,348		7,854,502
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		9,896,348		7,854,502
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,046,173		1,059,893
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,046,173		1,059,893
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( )		7,584,878		57,559,319

## （ 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19日 至 令和 1年 9月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 9月19日から令和 1年 9月17日までとなっております。</p>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第1期	第2期
	（平成30年 9月18日現在）	（令和 1年 9月17日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	286,534,708口	1,298,077,460口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0265円 (10,000口当たりの純資産額 10,265円)	1口当たり純資産額 1.0443円 (10,000口当たりの純資産額 10,443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9月14日 至平成30年9月18日	自平成30年9月19日 至令和1年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,680,171円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（54,532円）、収益調整金（5,850,175円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は7,584,878円（1万口当たり264.69円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（16,724,129円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（26,455,703円）、収益調整金（12,855,136円）、および分配準備積立金（1,524,351円）より、分配対象収益は57,559,319円（1万口当たり443.38円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自平成30年9月19日 至令和1年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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17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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券



## 第1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	275,229円
親投資信託受益証券	2,751,644円
合計	2,476,415円

## 第2期（自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,726,637円
親投資信託受益証券	33,614,421円
合計	35,341,058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19日 至 令和 1年 9月17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 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
期首元本額	2,000,000円	286,534,708円
期中追加設定元本額	424,008,460円	1,111,549,352円
期中一部解約元本額	139,473,752円	100,006,600円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	3,115	352,275.35	
	米ドル 小計		3,115	352,275.35 (38,116,192)	
投資信託受益証券合計				38,116,192 (38,116,192)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	118,883,698	303,272,313	
		外国株式インデックス・マザーファンド	81,659,431	298,350,897	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	8,979,459	13,213,273	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	73,254,793	131,426,424	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	284,527,456	369,828,787	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	20,215,989	51,514,383	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	23,541,279	52,480,573	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	64,006,148	82,881,561	
親投資信託受益証券合計			675,068,253	1,302,968,211	
合計				1,341,084,403 (38,116,192)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	2.8%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月18日現在)	第2期 (令和 1年 9月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	170,176	215,794
コール・ローン	4,348,934	9,915,558
投資信託受益証券	7,219,802	23,970,986
親投資信託受益証券	187,459,921	604,508,634
未収入金	-	2,000,000
流動資産合計	199,198,833	640,610,972
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	48,801	2,844,787
未払受託者報酬	23,388	83,519
未払委託者報酬	662,542	2,366,324
未払利息	12	28
その他未払費用	4,626	16,814
流動負債合計	739,369	5,311,472
負債合計	739,369	5,311,472
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	191,465,549	607,629,422
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,993,915	27,670,078
元本等合計	198,459,464	635,299,500
純資産合計	198,459,464	635,299,500
負債純資産合計	199,198,833	640,610,972

## (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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自	平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		169,904		775,536
受取利息		48		848
有価証券売買等損益		3,150,064		21,035,151
為替差損益		61,827		522,041
営業収益合計		3,381,843		21,289,494
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,516		2,990
受託者報酬		35,662		133,213
委託者報酬		1,010,366		3,774,287
その他費用		85,549		79,813
営業費用合計		1,133,093		3,990,303
営業利益又は営業損失( )		2,248,750		17,299,191
経常利益又は経常損失( )		2,248,750		17,299,191
当期純利益又は当期純損失( )		2,248,750		17,299,191
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( )		1,244,442		240,489
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		6,993,915
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,609,817		4,684,473
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		15,609,817		4,684,473
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,620,210		1,547,990
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,620,210		1,547,990
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( )		6,993,915		27,670,078

## ( 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19日 至 令和 1年 9月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 9月19日から令和 1年 9月17日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	( 平成30年 9月18日現在 )	( 令和 1年 9月17日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	191,465,549口	607,629,422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) 1.0365円 10,365円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0455円 10,455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9月14日 至平成30年9月18日	自平成30年9月19日 至令和1年9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,413,380円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（5,580,535円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は6,993,915円（1万口当たり365.27円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,097,287円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（9,103,772円）、収益調整金（9,299,051円）、および分配準備積立金（1,169,968円）より、分配対象収益は27,670,078円（1万口当たり455.36円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自平成30年9月19日 至令和1年9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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17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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券



## 第1期(自平成29年9月14日 至平成30年9月18日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	359,535円
親投資信託受益証券	2,071,349円
合計	1,711,814円

## 第2期(自平成30年9月19日 至令和1年9月17日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,110,132円
親投資信託受益証券	16,600,669円
合計	17,710,801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19日 至令和1年9月17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 (平成30年9月18日現在)	第2期 (令和1年9月17日現在)
期首元本額	2,000,000円	191,465,549円
期中追加設定元本額	409,158,724円	485,641,046円
期中一部解約元本額	219,693,175円	69,477,173円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,959	221,543.31	
	米ドル 小計		1,959	221,543.31 (23,970,986)	
投資信託受益証券合計				23,970,986 (23,970,986)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	67,765,977	172,871,007	
		外国株式インデックス・マザーファンド	46,473,182	169,794,417	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4,097,558	6,029,556	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	31,130,869	55,851,892	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	57,074,810	74,185,838	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	12,197,848	31,082,556	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	13,918,944	31,029,501	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	49,165,084	63,663,867	
親投資信託受益証券合計			281,824,272	604,508,634	
合計				628,479,620 (23,970,986)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	3.8%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月18日現在)	第2期 (令和 1年 9月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	596,785	278,291
コール・ローン	6,945,237	12,844,722
投資信託受益証券	23,455,438	36,084,960
親投資信託受益証券	447,128,136	714,577,830
未収入金	490,000	12,800,000
流動資産合計	478,615,596	776,585,803
資産合計	478,615,596	776,585,803
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,224,186	14,814,091
未払受託者報酬	72,281	110,664
未払委託者報酬	2,047,904	3,135,571
未払利息	19	36
その他未払費用	14,418	22,281
流動負債合計	3,358,808	18,082,643
負債合計	3,358,808	18,082,643
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	455,009,598	729,433,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	20,247,190	29,069,980
元本等合計	475,256,788	758,503,160
純資産合計	475,256,788	758,503,160
負債純資産合計	478,615,596	776,585,803

## （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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自	平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		595,684		1,475,228
受取利息		171		1,586
有価証券売買等損益		1,660,598		16,371,400
為替差損益		317,325		934,156
営業収益合計		747,418		16,914,058
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,702		4,569
受託者報酬		98,830		195,986
委託者報酬		2,800,002		5,552,989
その他費用		112,659		101,150
営業費用合計		3,015,193		5,854,694
営業利益又は営業損失（ ）		3,762,611		11,059,364
経常利益又は経常損失（ ）		3,762,611		11,059,364
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,762,611		11,059,364
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（ ）		4,729,924		418,115
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		20,247,190
剰余金増加額又は欠損金減少額		34,460,896		4,027,860
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		34,460,896		4,027,860
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,181,019		6,682,549
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,181,019		6,682,549
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（ ）		20,247,190		29,069,980

## ( 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19日 至 令和 1年 9月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。  (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。  (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。  (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 9月19日から令和 1年 9月17日までとなっております。	

## ( 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18日現在 )	( 令和 1年 9月17日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	455,009,598口	729,433,180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) 1.0445円 10,445円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0399円 10,399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 9月14日 至 平成30年 9月18日	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,914,880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（16,332,310円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は20,247,190円（1万口当たり444.96円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,391,482円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（13,611円）、収益調整金（16,912,400円）、および分配準備積立金（2,752,487円）より、分配対象収益は29,069,980円（1万口当たり398.51円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期
	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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17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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券



第1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,420,201円
親投資信託受益証券	3,174,142円
合計	1,753,941円

第2期（自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,889,695円
親投資信託受益証券	13,235,978円
合計	15,125,673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19日 至 令和 1年 9月17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 （平成30年 9月18日現在）	第2期 （令和 1年 9月17日現在）
期首元本額	2,000,000円	455,009,598円
期中追加設定元本額	760,271,388円	481,502,084円
期中一部解約元本額	307,261,790円	207,078,502円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	2,949	333,502.41	
	米ドル 小計		2,949	333,502.41 (36,084,960)	
投資信託受益証券合計				36,084,960 (36,084,960)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	95,484,617	243,581,257	
		外国株式インデックス・マザーファンド	65,753,842	240,238,237	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4,749,100	6,988,300	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	16,168,572	29,008,035	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	5,513,818	7,166,860	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	11,475,916	29,242,929	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	13,295,119	29,638,808	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	99,400,266	128,713,404	
親投資信託受益証券合計			311,841,250	714,577,830	
合計				750,662,790 (36,084,960)	

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.8%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### （参考）

「三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）」「三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）」「三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）」「三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）」および「三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）」は、「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」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「iシェアーズ J.P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成30年 9月18日現在）	（令和 1年 9月17日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,857,844,318	2,952,459,346
株式	178,319,347,240	168,222,688,330
派生商品評価勘定	110,901,680	52,978,320
未収入金	253,564,782	18,216,451
未収配当金	72,300,585	78,368,047
差入委託証拠金	56,845,000	-
流動資産合計	181,670,803,605	171,324,710,494
資産合計	181,670,803,605	171,324,710,494
負債の部		
流動負債		
前受金	111,095,000	53,082,000
未払金	10,056,959	11,308,000
未払解約金	73,030,593	1,089,028,371
未払利息	8,045	8,495
その他未払費用	18,114	54,719
	112,208,711	54,719

	(平成30年 9月18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
流動負債合計	194,208,711	1,153,481,585
負債合計	194,208,711	1,153,481,585
純資産の部		
元本等		
元本	66,849,199,400	66,708,868,107
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	114,627,395,494	103,462,360,802
元本等合計	181,476,594,894	170,171,228,909
純資産合計	181,476,594,894	170,171,228,909
負債純資産合計	181,670,803,605	171,324,710,494

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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>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18日現在)	(令和 1年 9月17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 2,784,000,000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 2,978,000,000円</p>

2. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,849,199,400口	66,708,868,107口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.7147円 27,147円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.5510円 25,510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19日 至 令和 1年 9月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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17日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680
	東証株価指数先物	3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680
合計		3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680

(令和1年9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,480,141,680	-	1,533,120,000	52,978,320
	東証株価指数先物	1,480,141,680	-	1,533,120,000	52,978,320
合計		1,480,141,680	-	1,533,120,000	52,978,320

(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19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	77,555,837,479円
同期中における追加設定元本額	11,599,504,362円
同期中における一部解約元本額	22,306,142,441円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,110,015,968円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	720,304,579円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,474,932,392円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,575,339,657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)	109,573,345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)	7,031,846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)	23,342,106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)	58,890,208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)	81,862,705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)	47,949,422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(T O P I X)	1,741,573,278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	6,576,334,078円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	462,418,998円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	647,481,975円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	628,146,538円
イオン・バランス戦略ファンド	30,183,406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)	4,267,987円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,029,645円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	23,159,228円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,292,606円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	54,814,758円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	4,575,879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)	6,276,338,555円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	25,930,420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>	782,961,562円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	3,655,636,480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>	2,525,914,762円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	9,281,043,684円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	57,070,190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>	224,385,726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>	779,654円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	1,025,940,455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>	55,784,848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>	380,046,357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>	1,094,310,631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>	968,009,581円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,183,125,486円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	2,904,791円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,354,601,775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>	67,722,044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>	108,024,599円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円



S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	104,572,701円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	47,179,642円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	22,068,903円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	213,768,667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 >	387,184,313円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	162,473,705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 >	115,344,686円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	59,920,850円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	10,985,484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 >	76,185,056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 >	968,969,824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 )	205,175,335円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	19,535,802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 >	1,730,910,414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 >	249,740,027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 >	1,683,022,698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 >	156,929,929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 >	13,174,879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 >	127,663,987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 >	61,164,812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 >	152,667,380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 >	20,857円
合計	66,849,199,400円

(令和 1年 9月17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	66,849,199,400円
同期中における追加設定元本額	14,347,066,426円
同期中における一部解約元本額	14,487,397,719円
令和 1年 9月17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	10,271,097,495円
三井住友・D C 年金バランス3 0 ( 債券重点型 )	930,280,265円
三井住友・D C 年金バランス5 0 ( 標準型 )	4,266,518,518円
三井住友・D C 年金バランス7 0 ( 株式重点型 )	3,022,399,624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 )	104,139,432円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	7,521,416円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	26,124,447円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 ( 4 資産タイプ )	68,886,630円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 ( 4 資産タイプ )	114,015,385円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 ( 4 資産タイプ )	72,531,823円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 ( 4 資産タイプ )	161,839,879円
国内株式指数ファンド ( T O P I X )	1,839,661,098円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	10,915,374,164円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	693,647,222円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	699,457,476円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	652,446,903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)	49,266,302円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	43,720,759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)	67,765,977円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	95,484,617円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,109,372円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	84,449円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	145,980円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	205,814円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,250,129,576円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	25,118,165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〉	222,305,218円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,409,906,160円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,475,323,301円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,109,713,682円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	61,727,246円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	923,444,775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〉	59,055,804円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	383,289,354円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	938,468,985円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,062,442,396円
SMAM・バランスVA株40T〈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・VAS(適格機関投資家専用)	256,618,404円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	64,145,789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)	99,069,827円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	101,718,217円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	50,196,487円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	23,479,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	205,601,339円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	387,699,602円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	78,948,396円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	124,403,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	62,637,257円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	9,693,725円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	77,638,053円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	944,196,030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)	205,369,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	21,266,288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〉	1,332,237,799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 >	204,692,490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 >	125,203,643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	66,708,868,107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	2,943.00	10,300,500	
日本水産	100,400	639.00	64,155,600	
マルハニチロ	14,400	2,815.00	40,536,000	
カネコ種苗	4,000	1,256.00	5,024,000	
サカタのタネ	11,300	3,760.00	42,488,000	
ホクト	8,100	1,947.00	15,770,700	
日鉄鉱業	2,400	4,265.00	10,236,000	
三井松島ホールディングス	5,300	1,246.00	6,603,800	
国際石油開発帝石	399,800	1,102.00	440,579,600	
石油資源開発	14,000	2,981.00	41,734,000	
K & O エナジーグループ	5,100	1,314.00	6,701,400	
ヒノキヤグループ	3,200	1,912.00	6,118,400	
ショーボンドホールディングス	14,000	3,900.00	54,600,000	
ミライト・ホールディングス	26,700	1,655.00	44,188,500	
タマホーム	6,000	1,447.00	8,682,000	
ベステラ	2,700	1,243.00	3,356,100	
スペースバリューホールディングス	13,800	492.00	6,789,600	
安藤・間	64,300	772.00	49,639,600	
東急建設	29,100	801.00	23,309,100	
コムシスホールディングス	34,600	2,954.00	102,208,400	
ミサワホーム	8,500	1,145.00	9,732,500	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,445.00	15,403,500	
東建コーポレーション	2,900	6,700.00	19,430,000	
大成建設	80,800	4,170.00	336,936,000	

大林組	241,400	1,096.00	264,574,400
清水建設	247,300	989.00	244,579,700
飛鳥建設	8,200	1,179.00	9,667,800
長谷工コーポレーション	101,400	1,262.00	127,966,800
松井建設	11,200	734.00	8,220,800
銭高組	1,300	4,030.00	5,239,000
鹿島建設	189,500	1,433.00	271,553,500
不動テトラ	7,000	1,221.00	8,547,000
大末建設	5,400	939.00	5,070,600
鉄建建設	5,400	2,689.00	14,520,600
西松建設	18,600	2,027.00	37,702,200
三井住友建設	61,500	585.00	35,977,500
大豊建設	5,800	2,875.00	16,675,000
前田建設工業	60,300	945.00	56,983,500
奥村組	14,200	2,934.00	41,662,800
東鉄工業	9,400	3,215.00	30,221,000
浅沼組	3,300	3,825.00	12,622,500
戸田建設	95,700	629.00	60,195,300
熊谷組	11,800	3,100.00	36,580,000
北野建設	2,300	2,299.00	5,287,700
矢作建設工業	13,900	726.00	10,091,400
ピーエス三菱	11,100	716.00	7,947,600
日本ハウスホールディングス	20,000	483.00	9,660,000
大東建託	29,200	14,400.00	420,480,000
新日本建設	10,200	750.00	7,650,000
N I P P O	20,700	1,935.00	40,054,500
東亜道路工業	2,300	3,290.00	7,567,000
前田道路	25,300	2,417.00	61,150,100
日本道路	2,400	6,420.00	15,408,000
東亜建設工業	8,300	1,333.00	11,063,900
日本国土開発	15,000	532.00	7,980,000
若築建設	5,800	1,525.00	8,845,000
東洋建設	32,900	453.00	14,903,700
五洋建設	100,700	592.00	59,614,400
世紀東急工業	15,400	720.00	11,088,000
福田組	2,800	4,080.00	11,424,000
住友林業	56,900	1,435.00	81,651,500
巴コーポレーション	16,600	407.00	6,756,200
大和ハウス工業	225,800	3,535.00	798,203,000
ライト工業	16,100	1,403.00	22,588,300
積水ハウス	249,500	2,044.50	510,102,750
日特建設	9,500	643.00	6,108,500

ユアテック	13,800	672.00	9,273,600
中電工	10,800	2,396.00	25,876,800
関電工	33,800	1,007.00	34,036,600
きんでん	53,100	1,635.00	86,818,500
東京エネシス	9,400	914.00	8,591,600
トーエネック	2,900	3,415.00	9,903,500
住友電設	6,000	2,117.00	12,702,000
日本電設工業	12,700	2,266.00	28,778,200
協和エクシオ	31,700	2,628.00	83,307,600
新日本空調	7,500	1,841.00	13,807,500
九電工	16,100	3,600.00	57,960,000
三機工業	18,500	1,285.00	23,772,500
日揮	71,200	1,517.00	108,010,400
中外炉工業	3,200	1,499.00	4,796,800
ヤマト	10,600	715.00	7,579,000
太平電業	5,800	2,354.00	13,653,200
高砂熱学工業	19,200	1,810.00	34,752,000
朝日工業社	2,300	2,900.00	6,670,000
明星工業	15,300	753.00	11,520,900
大気社	11,300	3,385.00	38,250,500
ダイダン	5,900	2,182.00	12,873,800
日比谷総合設備	7,900	2,006.00	15,847,400
東芝プラントシステム	17,600	1,801.00	31,697,600
OSJBホールディングス	41,700	245.00	10,216,500
レイズネクスト	15,500	1,209.00	18,739,500
日本製粉	21,200	1,722.00	36,506,400
日清製粉グループ本社	81,900	2,029.00	166,175,100
日東富士製粉	800	6,500.00	5,200,000
昭和産業	6,400	3,100.00	19,840,000
鳥越製粉	9,100	859.00	7,816,900
中部飼料	9,400	1,207.00	11,345,800
フィード・ワン	52,400	159.00	8,331,600
日本甜菜製糖	5,300	1,831.00	9,704,300
三井製糖	5,500	2,289.00	12,589,500
日新製糖	3,300	2,006.00	6,619,800
森永製菓	18,300	5,000.00	91,500,000
中村屋	2,500	4,430.00	11,075,000
江崎グリコ	22,200	4,760.00	105,672,000
名糖産業	3,900	1,314.00	5,124,600
井村屋グループ	3,600	2,178.00	7,840,800
不二家	4,500	2,065.00	9,292,500
山崎製パン	55,000	1,956.00	107,580,000

モロゾフ	1,600	4,980.00	7,968,000	
亀田製菓	4,500	4,790.00	21,555,000	
寿スピリッツ	7,600	6,640.00	50,464,000	
カルビー	33,400	3,390.00	113,226,000	
森永乳業	14,900	4,225.00	62,952,500	
六甲バター	5,600	1,755.00	9,828,000	
ヤクルト本社	53,900	6,350.00	342,265,000	
明治ホールディングス	51,300	7,830.00	401,679,000	
雪印メグミルク	17,900	2,604.00	46,611,600	
プリマハム	10,000	2,249.00	22,490,000	
日本ハム	30,200	4,390.00	132,578,000	
丸大食品	7,000	2,300.00	16,100,000	
S Foods	6,600	3,200.00	21,120,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	46,800	690.00	32,292,000	
サッポロホールディングス	25,500	2,658.00	67,779,000	
アサヒグループホールディングス	153,100	5,274.00	807,449,400	
キリンホールディングス	309,700	2,230.00	690,631,000	
宝ホールディングス	55,200	1,113.00	61,437,600	
オエノンホールディングス	24,800	396.00	9,820,800	
養命酒製造	3,200	1,911.00	6,115,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	51,300	2,448.00	125,582,400	
サントリー食品インターナショナル	48,400	4,725.00	228,690,000	
ダイドーグループホールディングス	4,000	4,490.00	17,960,000	
伊藤園	22,200	5,120.00	113,664,000	
キーコーヒー	7,200	2,194.00	15,796,800	
日清オイリオグループ	9,300	3,440.00	31,992,000	
不二製油グループ本社	18,100	3,050.00	55,205,000	
かどや製油	1,000	3,575.00	3,575,000	
J - オイルミルズ	3,700	4,080.00	15,096,000	
キッコーマン	47,900	5,130.00	245,727,000	
味の素	162,700	1,993.50	324,342,450	
キューピー	40,800	2,609.00	106,447,200	
ハウス食品グループ本社	27,300	4,070.00	111,111,000	
カゴメ	29,600	2,766.00	81,873,600	
焼津水産化学工業	5,700	1,062.00	6,053,400	
アリアケジャパン	6,600	8,350.00	55,110,000	
ニチレイ	37,900	2,442.00	92,551,800	
東洋水産	37,300	4,450.00	165,985,000	
イートアンド	3,800	1,749.00	6,646,200	
日清食品ホールディングス	30,900	7,590.00	234,531,000	
永谷園ホールディングス	4,600	2,150.00	9,890,000	
一正蒲鉾	3,900	1,101.00	4,293,900	

フジッコ	8,000	1,981.00	15,848,000
ロック・フィールド	7,000	1,451.00	10,157,000
日本たばこ産業	421,500	2,332.50	983,148,750
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,320.00	10,904,000
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,847.00	9,419,700
なとり	5,500	1,619.00	8,904,500
ピククルスコーポレーション	2,300	2,500.00	5,750,000
北の達人コーポレーション	25,600	716.00	18,329,600
ユーグレナ	31,100	918.00	28,549,800
ミヨシ油脂	4,300	1,120.00	4,816,000
理研ビタミン	3,000	3,550.00	10,650,000
片倉工業	10,000	1,260.00	12,600,000
ゲンゼ	4,900	4,510.00	22,099,000
東洋紡	31,700	1,427.00	45,235,900
ユニチカ	25,300	334.00	8,450,200
富士紡ホールディングス	4,300	2,880.00	12,384,000
倉敷紡績	6,900	2,234.00	15,414,600
シキボウ	6,300	945.00	5,953,500
日本毛織	23,800	962.00	22,895,600
ダイドーリミテッド	15,000	271.00	4,065,000
帝国繊維	8,400	1,805.00	15,162,000
帝人	56,900	2,069.00	117,726,100
東レ	554,600	809.30	448,837,780
住江織物	2,600	2,958.00	7,690,800
アツギ	8,700	837.00	7,281,900
ダイニック	6,200	718.00	4,451,600
セーレン	17,900	1,273.00	22,786,700
小松マテーレ	13,700	816.00	11,179,200
ワコールホールディングス	20,400	2,744.00	55,977,600
ホギメディカル	9,200	3,010.00	27,692,000
T S Iホールディングス	27,000	584.00	15,768,000
マツオカコーポレーション	3,000	2,054.00	6,162,000
ワールド	9,400	2,384.00	22,409,600
三陽商会	5,100	1,479.00	7,542,900
オンワードホールディングス	43,500	543.00	23,620,500
ルックホールディングス	3,000	1,080.00	3,240,000
ゴールドウイン	6,500	17,330.00	112,645,000
デサント	17,600	1,499.00	26,382,400
特種東海製紙	4,400	3,925.00	17,270,000
王子ホールディングス	317,200	522.00	165,578,400
日本製紙	34,300	1,869.00	64,106,700
三菱製紙	14,800	486.00	7,192,800

北越コーポレーション	46,900	569.00	26,686,100
中越パルプ工業	4,000	1,548.00	6,192,000
巴川製紙所	3,700	901.00	3,333,700
大王製紙	34,600	1,382.00	47,817,200
レンゴー	74,100	807.00	59,798,700
トモク	5,200	1,587.00	8,252,400
ザ・パック	5,400	3,605.00	19,467,000
クラレ	111,200	1,342.00	149,230,400
旭化成	506,800	1,095.50	555,199,400
昭和電工	50,600	3,060.00	154,836,000
住友化学	559,700	500.00	279,850,000
住友精化	3,500	3,370.00	11,795,000
日産化学	43,400	4,495.00	195,083,000
ラサ工業	3,600	1,253.00	4,510,800
クレハ	6,600	6,450.00	42,570,000
多木化学	2,200	5,110.00	11,242,000
テイカ	6,000	1,949.00	11,694,000
石原産業	14,300	960.00	13,728,000
日本曹達	11,400	2,651.00	30,221,400
東ソー	108,600	1,485.00	161,271,000
トクヤマ	21,000	2,417.00	50,757,000
セントラル硝子	16,300	2,351.00	38,321,300
東亜合成	45,600	1,193.00	54,400,800
大阪ソーダ	7,800	2,674.00	20,857,200
関東電化工業	17,700	789.00	13,965,300
デンカ	27,900	2,992.00	83,476,800
信越化学工業	125,700	11,660.00	1,465,662,000
日本カーバイド工業	3,200	1,246.00	3,987,200
堺化学工業	5,200	2,565.00	13,338,000
第一稀元素化学工業	8,400	839.00	7,047,600
エア・ウォーター	57,600	1,947.00	112,147,200
大陽日酸	58,700	2,100.00	123,270,000
日本化学工業	2,900	2,433.00	7,055,700
日本パーカライズニング	40,100	1,226.00	49,162,600
高压ガス工業	12,800	827.00	10,585,600
四国化成工業	12,300	1,142.00	14,046,600
戸田工業	2,200	2,219.00	4,881,800
ステラ ケミファ	4,600	2,902.00	13,349,200
保土谷化学工業	3,100	3,045.00	9,439,500
日本触媒	12,100	6,430.00	77,803,000
大日精化工業	6,000	3,175.00	19,050,000
カネカ	18,100	3,475.00	62,897,500



三菱瓦斯化学	72,100	1,465.00	105,626,500
三井化学	63,500	2,478.00	157,353,000
J S R	71,700	1,783.00	127,841,100
東京応化工業	12,600	3,980.00	50,148,000
大阪有機化学工業	8,300	1,043.00	8,656,900
三菱ケミカルホールディングス	474,000	810.00	383,940,000
K Hネオケム	11,000	2,371.00	26,081,000
ダイセル	105,700	905.00	95,658,500
住友ベークライト	12,600	4,125.00	51,975,000
積水化学工業	152,900	1,744.00	266,657,600
日本ゼオン	64,300	1,334.00	85,776,200
アイカ工業	21,700	3,225.00	69,982,500
宇部興産	35,600	2,222.00	79,103,200
積水樹脂	11,800	2,132.00	25,157,600
タキロンシーアイ	17,300	653.00	11,296,900
旭有機材	5,700	1,337.00	7,620,900
日立化成	33,000	3,405.00	112,365,000
ニチバン	4,300	1,627.00	6,996,100
リケンテクノス	21,800	481.00	10,485,800
大倉工業	4,300	1,631.00	7,013,300
積水化成成品工業	12,000	748.00	8,976,000
群栄化学工業	2,500	2,399.00	5,997,500
ダイキョーニシカワ	15,400	792.00	12,196,800
森六ホールディングス	4,400	2,514.00	11,061,600
日本化薬	44,900	1,297.00	58,235,300
カーリットホールディングス	9,500	589.00	5,595,500
日本精化	7,300	1,218.00	8,891,400
扶桑化学工業	7,200	2,370.00	17,064,000
トリケミカル研究所	1,800	6,260.00	11,268,000
A D E K A	35,700	1,382.00	49,337,400
日油	26,700	3,615.00	96,520,500
ハリマ化成グループ	6,500	1,259.00	8,183,500
花王	174,200	7,793.00	1,357,540,600
第一工業製薬	3,000	2,809.00	8,427,000
三洋化成工業	4,700	4,960.00	23,312,000
大日本塗料	9,300	1,128.00	10,490,400
日本ペイントホールディングス	58,600	5,040.00	295,344,000
関西ペイント	80,400	2,260.00	181,704,000
中国塗料	24,000	895.00	21,480,000
日本特殊塗料	6,900	1,112.00	7,672,800
藤倉化成	12,600	544.00	6,854,400
太陽ホールディングス	5,900	3,485.00	20,561,500

D I C	29,900	3,015.00	90,148,500
サカタインクス	16,000	1,085.00	17,360,000
東洋インキS Cホールディングス	13,900	2,428.00	33,749,200
T & K T O K A	6,600	982.00	6,481,200
富士フィルムホールディングス	150,900	4,796.00	723,716,400
資生堂	144,600	8,713.00	1,259,899,800
ライオン	94,600	2,099.00	198,565,400
高砂香料工業	5,200	2,718.00	14,133,600
マンダム	16,500	2,781.00	45,886,500
ミルボン	9,100	5,040.00	45,864,000
ファンケル	32,600	2,843.00	92,681,800
コーセー	12,300	19,200.00	236,160,000
コタ	4,800	1,201.00	5,764,800
ポーラ・オルビスホールディングス	31,100	2,493.00	77,532,300
ノエビアホールディングス	7,000	5,940.00	41,580,000
エステー	5,800	1,641.00	9,517,800
アグロ カネショウ	3,800	1,561.00	5,931,800
コニシ	13,100	1,500.00	19,650,000
長谷川香料	9,100	2,006.00	18,254,600
星光P M C	8,000	771.00	6,168,000
小林製薬	20,500	8,260.00	169,330,000
荒川化学工業	7,300	1,463.00	10,679,900
メック	6,900	1,458.00	10,060,200
タカラバイオ	19,100	2,313.00	44,178,300
J C U	9,800	2,054.00	20,129,200
デクセリアルズ	19,400	787.00	15,267,800
アース製薬	5,500	5,300.00	29,150,000
北興化学工業	10,500	498.00	5,229,000
大成ラミック	2,700	2,871.00	7,751,700
クミアイ化学工業	30,500	909.00	27,724,500
日本農薬	15,700	476.00	7,473,200
アキレス	5,900	1,725.00	10,177,500
有沢製作所	13,100	1,066.00	13,964,600
日東電工	50,200	5,394.00	270,778,800
レック	8,100	1,000.00	8,100,000
藤森工業	6,400	2,991.00	19,142,400
前澤化成工業	5,700	1,199.00	6,834,300
未来工業	4,700	1,924.00	9,042,800
J S P	4,800	1,829.00	8,779,200
エフピコ	8,000	6,430.00	51,440,000
天馬	5,600	2,050.00	11,480,000
信越ポリマー	14,000	769.00	10,766,000

東リ	24,400	258.00	6,295,200
ニフコ	29,100	2,656.00	77,289,600
バルカー	6,200	2,278.00	14,123,600
ユニ・チャーム	141,000	3,254.00	458,814,000
協和キリン	72,200	2,100.00	151,620,000
武田薬品工業	635,300	3,788.00	2,406,516,400
アステラス製薬	639,600	1,529.00	977,948,400
大日本住友製薬	54,300	1,906.00	103,495,800
塩野義製薬	92,800	5,891.00	546,684,800
田辺三菱製薬	74,800	1,254.00	93,799,200
あすか製薬	9,900	1,108.00	10,969,200
日本新薬	19,100	8,690.00	165,979,000
中外製薬	75,800	7,640.00	579,112,000
科研製薬	12,600	5,150.00	64,890,000
エーザイ	87,400	5,388.00	470,911,200
ロート製薬	37,500	2,880.00	108,000,000
小野薬品工業	172,500	2,021.00	348,622,500
久光製薬	21,500	4,775.00	102,662,500
持田製薬	11,200	4,190.00	46,928,000
参天製薬	135,400	1,898.00	256,989,200
扶桑薬品工業	3,800	1,991.00	7,565,800
日本ケミファ	1,800	2,800.00	5,040,000
ツムラ	23,100	3,015.00	69,646,500
日医工	18,700	1,247.00	23,318,900
キッセイ薬品工業	13,300	2,599.00	34,566,700
生化学工業	14,600	1,145.00	16,717,000
栄研化学	13,100	1,666.00	21,824,600
鳥居薬品	4,200	2,900.00	12,180,000
JCRファーマ	5,200	7,840.00	40,768,000
東和薬品	10,500	2,475.00	25,987,500
富士製薬工業	5,300	1,320.00	6,996,000
沢井製薬	15,300	5,630.00	86,139,000
ゼリア新薬工業	14,700	1,949.00	28,650,300
第一三共	208,100	6,992.00	1,455,035,200
キョーリン製薬ホールディングス	16,700	1,834.00	30,627,800
大幸薬品	4,100	2,400.00	9,840,000
ダイト	4,200	2,921.00	12,268,200
大塚ホールディングス	138,500	4,707.00	651,919,500
大正製薬ホールディングス	15,100	8,020.00	121,102,000
ペプチドリーム	36,800	5,380.00	197,984,000
日本コークス工業	75,000	88.00	6,600,000
ニチレキ	10,100	1,122.00	11,332,200

ユシロ化学工業	4,800	1,369.00	6,571,200
富士石油	23,300	261.00	6,081,300
MORESCO	3,800	1,363.00	5,179,400
出光興産	83,400	3,305.00	275,637,000
JXTGホールディングス	1,203,800	512.00	616,345,600
コスモエネルギーホールディングス	21,300	2,358.00	50,225,400
横浜ゴム	42,600	2,192.00	93,379,200
TOYO TIRE	38,900	1,425.00	55,432,500
ブリヂストン	224,000	4,267.00	955,808,000
住友ゴム工業	66,300	1,297.00	85,991,100
オカモト	5,200	4,175.00	21,710,000
ニッタ	8,100	3,030.00	24,543,000
住友理工	14,600	888.00	12,964,800
三ツ星ベルト	10,000	1,882.00	18,820,000
バンドー化学	15,200	880.00	13,376,000
日東紡績	11,000	3,220.00	35,420,000
AGC	71,500	3,340.00	238,810,000
日本板硝子	22,900	674.00	15,434,600
日本山村硝子	4,500	1,275.00	5,737,500
日本電気硝子	29,400	2,439.00	71,706,600
オハラ	4,100	1,456.00	5,969,600
住友大阪セメント	15,200	4,710.00	71,592,000
太平洋セメント	46,000	2,934.00	134,964,000
日本ヒューム	8,900	714.00	6,354,600
日本コンクリート工業	20,500	291.00	5,965,500
三谷セキサン	3,700	3,130.00	11,581,000
アジアパイルホールディングス	11,700	522.00	6,107,400
東海カーボン	76,500	1,150.00	87,975,000
日本カーボン	3,600	3,955.00	14,238,000
東洋炭素	4,600	2,438.00	11,214,800
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	4,055.00	17,842,000
TOTO	55,900	4,205.00	235,059,500
日本碍子	88,000	1,590.00	139,920,000
日本特殊陶業	61,500	2,111.00	129,826,500
MARUWA	2,600	6,680.00	17,368,000
品川リフラクトリーズ	2,200	2,686.00	5,909,200
黒崎播磨	1,600	5,660.00	9,056,000
ヨータイ	8,700	611.00	5,315,700
東京窯業	12,600	299.00	3,767,400
ニッカトー	5,100	695.00	3,544,500
フジミインコーポレーテッド	6,700	2,535.00	16,984,500
ニチアス	20,100	1,935.00	38,893,500

ニチハ	10,200	2,934.00	29,926,800
日本製鉄	334,500	1,581.50	529,011,750
神戸製鋼所	132,400	612.00	81,028,800
中山製鋼所	13,000	462.00	6,006,000
合同製鐵	4,300	2,287.00	9,834,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	194,000	1,383.00	268,302,000
東京製鐵	38,800	873.00	33,872,400
共英製鋼	8,300	1,970.00	16,351,000
大和工業	15,700	2,847.00	44,697,900
東京鐵鋼	4,700	1,304.00	6,128,800
大阪製鐵	5,600	1,368.00	7,660,800
淀川製鋼所	9,100	1,982.00	18,036,200
丸一鋼管	25,700	2,838.00	72,936,600
モリ工業	2,700	1,904.00	5,140,800
大同特殊鋼	11,900	4,385.00	52,181,500
日本冶金工業	62,700	231.00	14,483,700
山陽特殊製鋼	9,400	1,525.00	14,335,000
愛知製鋼	4,000	3,245.00	12,980,000
日立金属	77,100	1,238.00	95,449,800
大平洋金属	5,200	2,294.00	11,928,800
新日本電工	50,200	175.00	8,785,000
栗本鐵工所	4,600	1,504.00	6,918,400
三菱製鋼	6,300	1,161.00	7,314,300
シンニッタン	14,700	456.00	6,703,200
大紀アルミニウム工業所	11,500	758.00	8,717,000
日本輕金属ホールディングス	199,600	203.00	40,518,800
三井金属鉱業	19,100	2,613.00	49,908,300
東邦亜鉛	4,600	2,056.00	9,457,600
三菱マテリアル	47,100	2,936.00	138,285,600
住友金属鉱山	98,900	3,517.00	347,831,300
D O W A ホールディングス	16,700	3,675.00	61,372,500
古河機械金属	12,100	1,456.00	17,617,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,700	1,816.00	15,799,200
東邦チタニウム	13,400	846.00	11,336,400
U A C J	10,800	1,853.00	20,012,400
C K サンエツ	1,800	2,870.00	5,166,000
古河電気工業	20,300	2,578.00	52,333,400
住友電気工業	267,800	1,412.50	378,267,500
フジクラ	90,900	412.00	37,450,800
昭和電線ホールディングス	10,000	883.00	8,830,000
タツタ電線	16,300	468.00	7,628,400
平河ヒューテック	4,000	1,120.00	4,480,000

リョービ	9,000	1,817.00	16,353,000
アーレスティ	11,000	590.00	6,490,000
アサヒホールディングス	13,500	2,326.00	31,401,000
稲葉製作所	5,700	1,442.00	8,219,400
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,618.00	5,339,400
トーカロ	18,800	928.00	17,446,400
アルファC o	4,300	1,206.00	5,185,800
SUMCO	86,700	1,506.00	130,570,200
川田テクノロジーズ	1,700	6,820.00	11,594,000
RS Technologies	2,200	3,590.00	7,898,000
東洋製罐グループホールディングス	45,500	1,742.00	79,261,000
ホッカンホールディングス	4,800	1,524.00	7,315,200
コロナ	5,900	1,051.00	6,200,900
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,653.00	22,811,400
三和ホールディングス	74,200	1,262.00	93,640,400
文化シャッター	22,000	904.00	19,888,000
三協立山	10,500	1,251.00	13,135,500
アルインコ	8,900	951.00	8,463,900
LIXILグループ	106,500	1,880.00	200,220,000
ノーリツ	15,500	1,305.00	20,227,500
長府製作所	7,200	2,442.00	17,582,400
リンナイ	13,000	7,340.00	95,420,000
日東精工	14,000	574.00	8,036,000
岡部	15,200	850.00	12,920,000
ジーテクト	8,000	1,711.00	13,688,000
東プレ	13,000	1,755.00	22,815,000
高周波熱錬	14,600	876.00	12,789,600
東京製綱	7,000	971.00	6,797,000
パイオラックス	11,400	1,882.00	21,454,800
エイチワン	9,300	663.00	6,165,900
日本発條	72,200	848.00	61,225,600
三益半導体工業	6,200	1,900.00	11,780,000
日本製鋼所	22,500	2,143.00	48,217,500
三浦工業	31,400	3,080.00	96,712,000
タクマ	26,800	1,259.00	33,741,200
ツガミ	16,900	917.00	15,497,300
オークマ	9,200	5,880.00	54,096,000
東芝機械	8,200	2,328.00	19,089,600
アマダホールディングス	106,900	1,184.00	126,569,600
アイダエンジニアリング	19,500	855.00	16,672,500
F U J I	27,300	1,571.00	42,888,300
牧野フライス製作所	8,300	4,745.00	39,383,500

オーエスジー	33,900	2,258.00	76,546,200
旭ダイヤモンド工業	19,600	661.00	12,955,600
D M G 森精機	45,900	1,597.00	73,302,300
ソディック	16,100	799.00	12,863,900
ディスコ	9,700	21,660.00	210,102,000
日東工器	4,400	2,182.00	9,600,800
日進工具	2,400	1,941.00	4,658,400
豊和工業	5,300	783.00	4,149,900
津田駒工業	2,200	1,364.00	3,000,800
島精機製作所	10,000	2,548.00	25,480,000
オプトラン	7,200	3,280.00	23,616,000
フリュー	7,600	957.00	7,273,200
ヤマシンフィルタ	13,200	745.00	9,834,000
日阪製作所	10,500	898.00	9,429,000
やまびこ	14,400	1,155.00	16,632,000
平田機工	3,400	7,000.00	23,800,000
ペガサスミシン製造	8,600	500.00	4,300,000
ナプテスコ	42,500	3,475.00	147,687,500
三井海洋開発	7,900	2,805.00	22,159,500
レオン自動機	7,300	1,615.00	11,789,500
S M C	21,300	44,950.00	957,435,000
ホソカワミクロン	2,600	3,930.00	10,218,000
ユニオンツール	2,600	3,300.00	8,580,000
オイレス工業	10,000	1,633.00	16,330,000
日精エー・エス・ビー機械	2,600	3,500.00	9,100,000
サトーホールディングス	8,900	2,829.00	25,178,100
技研製作所	6,200	3,335.00	20,677,000
日精樹脂工業	7,300	1,008.00	7,358,400
オカダアイヨン	3,200	1,195.00	3,824,000
小松製作所	329,100	2,515.50	827,851,050
住友重機械工業	41,000	3,400.00	139,400,000
日立建機	28,700	2,652.00	76,112,400
日工	2,800	3,395.00	9,506,000
巴工業	3,700	2,453.00	9,076,100
井関農機	7,900	1,499.00	11,842,100
T O W A	7,800	837.00	6,528,600
北川鉄工所	3,800	2,006.00	7,622,800
ローツェ	3,500	2,498.00	8,743,000
クボタ	389,900	1,693.00	660,100,700
荏原実業	3,500	2,081.00	7,283,500
三菱化工機	3,900	1,808.00	7,051,200
月島機械	15,000	1,424.00	21,360,000

帝国電機製作所	6,000	1,185.00	7,110,000
新東工業	17,600	966.00	17,001,600
澁谷工業	6,500	2,841.00	18,466,500
アイチ コーポレーション	14,200	707.00	10,039,400
小森コーポレーション	18,500	1,181.00	21,848,500
鶴見製作所	6,000	2,070.00	12,420,000
住友精密工業	2,000	3,025.00	6,050,000
酒井重工業	2,000	2,784.00	5,568,000
荏原製作所	32,600	2,863.00	93,333,800
西島製作所	9,800	1,024.00	10,035,200
北越工業	8,100	1,264.00	10,238,400
ダイキン工業	99,200	14,335.00	1,422,032,000
オルガノ	3,100	4,510.00	13,981,000
トーヨーカネツ	3,300	1,932.00	6,375,600
栗田工業	39,300	2,920.00	114,756,000
椿本チエイン	9,000	3,570.00	32,130,000
大同工業	6,000	849.00	5,094,000
アネスト岩田	12,800	943.00	12,070,400
ダイフク	39,700	5,530.00	219,541,000
加藤製作所	4,200	1,894.00	7,954,800
タダノ	36,300	1,065.00	38,659,500
フジテック	26,200	1,353.00	35,448,600
C K D	20,600	1,283.00	26,429,800
キトー	6,100	1,574.00	9,601,400
平和	20,400	2,165.00	44,166,000
理想科学工業	6,800	1,685.00	11,458,000
S A N K Y O	18,600	3,800.00	70,680,000
日本金銭機械	9,400	976.00	9,174,400
マースグループホールディングス	5,200	1,923.00	9,999,600
福島工業	4,600	3,215.00	14,789,000
ダイコク電機	4,300	1,544.00	6,639,200
竹内製作所	12,100	1,681.00	20,340,100
アマノ	20,900	3,340.00	69,806,000
J U K I	10,600	936.00	9,921,600
蛇の目ミシン工業	10,400	418.00	4,347,200
マックス	11,400	1,859.00	21,192,600
グローリー	20,700	3,115.00	64,480,500
新晃工業	7,400	1,700.00	12,580,000
大和冷機工業	10,800	1,147.00	12,387,600
セガサミーホールディングス	73,400	1,532.00	112,448,800
日本ピストンリング	3,800	1,339.00	5,088,200
リケン	3,400	3,810.00	12,954,000



T P R	9,700	1,823.00	17,683,100
ツバキ・ナカシマ	15,400	1,683.00	25,918,200
ホシザキ	21,400	8,310.00	177,834,000
大豊工業	6,900	806.00	5,561,400
日本精工	146,800	983.00	144,304,400
N T N	156,600	328.00	51,364,800
ジェイテクト	67,800	1,303.00	88,343,400
不二越	7,000	4,740.00	33,180,000
日本トムソン	23,600	474.00	11,186,400
T H K	42,300	2,884.00	121,993,200
ユーシン精機	6,300	1,008.00	6,350,400
前澤給装工業	4,100	2,000.00	8,200,000
イーグル工業	9,700	1,031.00	10,000,700
日本ピラー工業	8,300	1,229.00	10,200,700
キッツ	30,000	741.00	22,230,000
マキタ	88,300	3,325.00	293,597,500
日立造船	57,100	351.00	20,042,100
三菱重工業	122,200	4,404.00	538,168,800
I H I	56,400	2,453.00	138,349,200
スター精密	12,400	1,596.00	19,790,400
日清紡ホールディングス	46,900	884.00	41,459,600
イビデン	45,200	2,137.00	96,592,400
コニカミノルタ	158,900	800.00	127,120,000
ブラザー工業	93,900	1,984.00	186,297,600
ミネベアミツミ	134,300	1,908.00	256,244,400
日立製作所	327,200	4,126.00	1,350,027,200
三菱電機	728,100	1,472.00	1,071,763,200
富士電機	47,100	3,455.00	162,730,500
東洋電機製造	4,400	1,584.00	6,969,600
安川電機	84,200	3,945.00	332,169,000
シンフォニアテクノロジー	10,500	1,260.00	13,230,000
明電舎	14,700	1,923.00	28,268,100
オリジン	3,200	1,399.00	4,476,800
山洋電気	3,600	4,745.00	17,082,000
デンヨー	7,700	1,800.00	13,860,000
東芝テック	9,100	3,180.00	28,938,000
芝浦メカトロニクス	1,700	3,030.00	5,151,000
マブチモーター	19,800	4,190.00	82,962,000
日本電産	87,500	15,310.00	1,339,625,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,200	763.00	3,967,600
トレックス・セミコンダクター	4,100	1,240.00	5,084,000
東光高岳	4,600	1,178.00	5,418,800

ダイヘン	8,200	3,275.00	26,855,000
ヤーマン	11,200	686.00	7,683,200
JVCケンウッド	57,500	316.00	18,170,000
ミマキエンジニアリング	7,700	547.00	4,211,900
第一精工	3,900	2,424.00	9,453,600
日新電機	17,300	1,282.00	22,178,600
大崎電気工業	16,200	661.00	10,708,200
オムロン	77,200	5,870.00	453,164,000
日東工業	12,100	2,091.00	25,301,100
I D E C	9,800	1,999.00	19,590,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,900	1,918.00	51,594,200
サクサホールディングス	2,700	1,856.00	5,011,200
メルコホールディングス	3,200	2,779.00	8,892,800
日本電気	94,100	4,570.00	430,037,000
富士通	70,200	8,458.00	593,751,600
沖電気工業	32,800	1,464.00	48,019,200
電気興業	4,100	3,110.00	12,751,000
サンケン電気	8,300	2,163.00	17,952,900
アイホン	5,400	1,596.00	8,618,400
ルネサスエレクトロニクス	345,900	685.00	236,941,500
セイコーエプソン	89,400	1,546.00	138,212,400
ワコム	53,300	359.00	19,134,700
アルバック	14,700	4,650.00	68,355,000
E I Z O	6,800	3,800.00	25,840,000
日本信号	18,800	1,222.00	22,973,600
京三製作所	18,500	387.00	7,159,500
能美防災	9,900	2,158.00	21,364,200
ホーチキ	5,500	1,464.00	8,052,000
エレコム	6,900	4,170.00	28,773,000
パナソニック	830,400	901.50	748,605,600
シャープ	72,700	1,278.00	92,910,600
アンリツ	47,000	2,065.00	97,055,000
富士通ゼネラル	23,200	1,786.00	41,435,200
ソニー	488,100	6,542.00	3,193,150,200
T D K	37,900	9,540.00	361,566,000
帝国通信工業	5,400	1,140.00	6,156,000
タムラ製作所	28,600	590.00	16,874,000
アルプスアルパイン	75,800	2,067.00	156,678,600
日本トリム	1,600	4,525.00	7,240,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,020.00	8,686,000
フォスター電機	8,000	1,885.00	15,080,000
S M K	2,600	2,828.00	7,352,800

ヨコオ	5,500	2,877.00	15,823,500
ホシデン	21,900	1,087.00	23,805,300
ヒロセ電機	10,400	13,500.00	140,400,000
日本航空電子工業	16,800	1,622.00	27,249,600
T O A	8,600	1,296.00	11,145,600
マクセルホールディングス	15,800	1,582.00	24,995,600
古野電気	10,100	979.00	9,887,900
ユニデンホールディングス	2,900	1,894.00	5,492,600
スミダコーポレーション	7,000	1,075.00	7,525,000
アイコム	4,700	2,161.00	10,156,700
リオン	4,000	2,234.00	8,936,000
本多通信工業	8,300	519.00	4,307,700
船井電機	10,700	572.00	6,120,400
横河電機	73,000	2,023.00	147,679,000
新電元工業	3,100	3,595.00	11,144,500
アズビル	45,700	2,884.00	131,798,800
東亜ディーケーケー	5,100	833.00	4,248,300
日本光電工業	32,800	3,060.00	100,368,000
チノー	4,500	1,376.00	6,192,000
共和電業	15,800	421.00	6,651,800
堀場製作所	14,600	6,380.00	93,148,000
アドバンテスト	49,700	4,700.00	233,590,000
エスペック	6,700	1,921.00	12,870,700
キーエンス	35,700	67,130.00	2,396,541,000
日置電機	4,000	3,565.00	14,260,000
シスメックス	57,000	7,288.00	415,416,000
日本マイクロニクス	13,400	883.00	11,832,200
メガチップス	6,300	1,756.00	11,062,800
O B A R A G R O U P	3,600	3,785.00	13,626,000
コーセル	11,200	1,050.00	11,760,000
イリソ電子工業	6,800	5,350.00	36,380,000
オブテックスグループ	12,200	1,603.00	19,556,600
千代田インテグレ	3,600	2,116.00	7,617,600
アイ・オー・データ機器	4,300	892.00	3,835,600
レーザーテック	14,900	6,600.00	98,340,000
スタンレー電気	51,200	2,848.00	145,817,600
岩崎電気	4,700	1,267.00	5,954,900
ウシオ電機	43,100	1,553.00	66,934,300
ヘリオス テクノ ホールディング	8,800	564.00	4,963,200
日本セラミック	7,300	2,762.00	20,162,600
古河電池	6,800	597.00	4,059,600
山一電機	5,800	1,253.00	7,267,400

図研	5,400	1,869.00	10,092,600	
日本電子	14,700	2,574.00	37,837,800	
カシオ計算機	65,300	1,626.00	106,177,800	
ファナック	69,100	20,150.00	1,392,365,000	
日本シイエムケイ	19,400	598.00	11,601,200	
エンプラス	3,700	3,555.00	13,153,500	
ローム	34,700	8,500.00	294,950,000	
浜松ホトニクス	52,000	3,910.00	203,320,000	
三井ハイテック	8,700	1,678.00	14,598,600	
新光電気工業	24,300	953.00	23,157,900	
京セラ	111,000	6,850.00	760,350,000	
太陽誘電	32,700	2,475.00	80,932,500	
村田製作所	228,900	5,124.00	1,172,883,600	
双葉電子工業	12,100	1,374.00	16,625,400	
ニチコン	23,800	981.00	23,347,800	
日本ケミコン	5,400	1,587.00	8,569,800	
K O A	11,500	1,357.00	15,605,500	
市光工業	11,700	855.00	10,003,500	
小糸製作所	43,100	5,410.00	233,171,000	
ミツバ	14,300	643.00	9,194,900	
S C R E E Nホールディングス	12,800	6,580.00	84,224,000	
キャノン電子	6,800	1,828.00	12,430,400	
キャノン	391,700	2,945.00	1,153,556,500	
リコー	218,500	1,045.00	228,332,500	
象印マホービン	17,700	1,425.00	25,222,500	
東京エレクトロン	48,500	20,915.00	1,014,377,500	
トヨタ紡織	24,800	1,552.00	38,489,600	
ユニプレス	14,100	1,834.00	25,859,400	
豊田自動織機	58,900	6,320.00	372,248,000	
モリタホールディングス	12,900	1,765.00	22,768,500	
三櫻工業	11,900	569.00	6,771,100	
デンソー	160,400	4,831.00	774,892,400	
東海理化電機製作所	19,100	1,913.00	36,538,300	
三井E & S ホールディングス	25,700	942.00	24,209,400	
川崎重工業	56,600	2,447.00	138,500,200	
名村造船所	25,400	277.00	7,035,800	
日本車輛製造	3,300	2,517.00	8,306,100	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,069.00	9,834,800	
日産自動車	857,700	716.70	614,713,590	
いすゞ自動車	229,500	1,250.00	286,875,000	
トヨタ自動車	811,200	7,445.00	6,039,384,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,200	941.00	84,878,200	

三菱自動車工業	269,200	502.00	135,138,400
エフテック	6,700	715.00	4,790,500
武蔵精密工業	17,900	1,418.00	25,382,200
日産車体	14,200	937.00	13,305,400
新明和工業	30,400	1,353.00	41,131,200
極東開発工業	14,900	1,321.00	19,682,900
日信工業	13,200	1,507.00	19,892,400
トピー工業	6,000	2,000.00	12,000,000
ティラド	3,500	1,855.00	6,492,500
タチエス	12,000	1,299.00	15,588,000
N O K	39,000	1,674.00	65,286,000
フタバ産業	21,300	759.00	16,166,700
K Y B	7,400	3,160.00	23,384,000
大同メタル工業	13,900	669.00	9,299,100
プレス工業	37,100	468.00	17,362,800
ミクニ	12,500	318.00	3,975,000
太平洋工業	15,500	1,576.00	24,428,000
ケーヒン	16,500	1,675.00	27,637,500
河西工業	9,900	846.00	8,375,400
アイシン精機	59,400	3,655.00	217,107,000
マツダ	228,800	1,007.50	230,516,000
今仙電機製作所	8,800	900.00	7,920,000
本田技研工業	613,900	2,928.00	1,797,499,200
スズキ	133,500	4,314.00	575,919,000
S U B A R U	226,300	3,091.00	699,493,300
安永	4,100	1,338.00	5,485,800
ヤマハ発動機	94,200	1,963.00	184,914,600
ショーワ	17,100	1,517.00	25,940,700
T B K	16,500	416.00	6,864,000
エクセディ	9,700	2,169.00	21,039,300
豊田合成	23,500	2,236.00	52,546,000
愛三工業	12,900	822.00	10,603,800
日本プラスト	7,800	708.00	5,522,400
ヨロズ	7,900	1,339.00	10,578,100
エフ・シー・シー	13,100	2,149.00	28,151,900
シマノ	27,200	16,240.00	441,728,000
テイ・エス テック	17,000	3,320.00	56,440,000
ジャムコ	4,000	1,555.00	6,220,000
テルモ	205,700	3,279.00	674,490,300
日機装	22,500	1,215.00	27,337,500
島津製作所	92,900	2,796.00	259,748,400
J M S	10,000	666.00	6,660,000

長野計器	7,400	714.00	5,283,600
ブイ・テクノロジー	3,400	5,530.00	18,802,000
東京計器	6,000	914.00	5,484,000
インターアクション	4,300	2,076.00	8,926,800
東京精密	13,200	3,245.00	42,834,000
マニー	28,500	2,546.00	72,561,000
ニコン	126,400	1,411.00	178,350,400
トプコン	39,700	1,472.00	58,438,400
オリンパス	433,100	1,411.00	611,104,100
理研計器	6,400	2,071.00	13,254,400
タムロン	6,300	2,273.00	14,319,900
HOYA	146,500	8,944.00	1,310,296,000
シード	3,700	921.00	3,407,700
ノーリツ鋼機	6,100	1,908.00	11,638,800
エー・アンド・デイ	7,900	713.00	5,632,700
朝日インテック	61,800	2,665.00	164,697,000
シチズン時計	81,400	551.00	44,851,400
リズム時計工業	3,500	908.00	3,178,000
メニコン	9,900	3,825.00	37,867,500
松風	5,100	1,519.00	7,746,900
セイコーホールディングス	11,100	2,365.00	26,251,500
ニプロ	51,700	1,245.00	64,366,500
スノーピーク	3,600	1,307.00	4,705,200
パラマウントベッドホールディングス	8,300	4,125.00	34,237,500
トランザクション	5,100	972.00	4,957,200
ニホンフラッシュ	3,600	2,391.00	8,607,600
前田工織	8,200	1,453.00	11,914,600
永大産業	14,700	344.00	5,056,800
アートネイチャー	10,700	662.00	7,083,400
バンダイナムコホールディングス	75,300	6,400.00	481,920,000
SHOEI	3,700	4,675.00	17,297,500
フランスベッドホールディングス	12,800	1,047.00	13,401,600
パイロットコーポレーション	13,000	3,945.00	51,285,000
萩原工業	4,700	1,520.00	7,144,000
トッパン・フォームズ	15,300	1,025.00	15,682,500
フジシールインターナショナル	16,400	2,801.00	45,936,400
タカラトミー	31,000	1,201.00	37,231,000
廣済堂	10,100	711.00	7,181,100
プロネクサス	7,900	1,168.00	9,227,200
大建工業	5,800	2,007.00	11,640,600
凸版印刷	106,000	1,936.00	205,216,000
大日本印刷	102,000	2,822.00	287,844,000

共同印刷	3,000	2,748.00	8,244,000
N I S S H A	15,400	1,048.00	16,139,200
宝印刷	5,100	1,685.00	8,593,500
アシックス	60,100	1,668.00	100,246,800
ヤマハ	43,100	4,735.00	204,078,500
河合楽器製作所	2,600	2,832.00	7,363,200
クリナップ	9,500	559.00	5,310,500
ピジョン	44,400	4,400.00	195,360,000
キングジム	8,800	868.00	7,638,400
リンテック	17,700	2,140.00	37,878,000
イトーキ	15,800	441.00	6,967,800
任天堂	41,700	41,890.00	1,746,813,000
三菱鉛筆	12,000	1,745.00	20,940,000
タカラスタANDARD	14,600	1,820.00	26,572,000
コクヨ	35,600	1,469.00	52,296,400
ナカバヤシ	10,000	527.00	5,270,000
グローブライド	3,900	2,876.00	11,216,400
オカムラ	25,400	1,092.00	27,736,800
美津濃	7,400	2,773.00	20,520,200
東京電力ホールディングス	576,400	550.00	317,020,000
中部電力	222,300	1,590.00	353,457,000
関西電力	297,300	1,338.50	397,936,050
中国電力	101,000	1,412.00	142,612,000
北陸電力	71,100	720.00	51,192,000
東北電力	169,500	1,098.00	186,111,000
四国電力	66,700	1,067.00	71,168,900
九州電力	147,500	1,095.00	161,512,500
北海道電力	70,100	578.00	40,517,800
沖縄電力	13,300	1,710.00	22,743,000
電源開発	57,500	2,578.00	148,235,000
エフオン	5,800	708.00	4,106,400
イーレックス	12,400	1,112.00	13,788,800
レノバ	13,700	886.00	12,138,200
東京瓦斯	143,300	2,752.00	394,361,600
大阪瓦斯	139,500	2,039.00	284,440,500
東邦瓦斯	35,900	4,230.00	151,857,000
北海道瓦斯	5,400	1,550.00	8,370,000
広島ガス	21,900	344.00	7,533,600
西部瓦斯	8,000	2,403.00	19,224,000
静岡ガス	21,400	905.00	19,367,000
メタウォーター	3,900	3,670.00	14,313,000
S B S ホールディングス	7,400	1,536.00	11,366,400

東武鉄道	75,600	3,545.00	268,002,000
相鉄ホールディングス	25,300	2,952.00	74,685,600
東急	197,600	2,053.00	405,672,800
京浜急行電鉄	99,800	2,081.00	207,683,800
小田急電鉄	115,600	2,549.00	294,664,400
京王電鉄	40,400	6,730.00	271,892,000
京成電鉄	54,000	4,280.00	231,120,000
富士急行	10,000	4,510.00	45,100,000
新京成電鉄	3,600	2,100.00	7,560,000
東日本旅客鉄道	129,400	10,430.00	1,349,642,000
西日本旅客鉄道	65,400	9,386.00	613,844,400
東海旅客鉄道	65,100	22,210.00	1,445,871,000
西武ホールディングス	90,800	1,905.00	172,974,000
鴻池運輸	11,200	1,666.00	18,659,200
西日本鉄道	20,900	2,485.00	51,936,500
ハマキョウレックス	5,700	3,600.00	20,520,000
サカイ引越センター	3,900	6,220.00	24,258,000
近鉄グループホールディングス	68,200	5,640.00	384,648,000
阪急阪神ホールディングス	92,000	4,230.00	389,160,000
南海電気鉄道	31,400	2,859.00	89,772,600
京阪ホールディングス	30,700	4,740.00	145,518,000
神戸電鉄	2,700	4,040.00	10,908,000
名古屋鉄道	56,000	3,305.00	185,080,000
山陽電気鉄道	6,000	2,257.00	13,542,000
日本通運	26,300	5,710.00	150,173,000
ヤマトホールディングス	122,100	1,888.00	230,524,800
山九	19,100	5,430.00	103,713,000
丸全昭和運輸	5,900	3,160.00	18,644,000
センコーグループホールディングス	37,700	830.00	31,291,000
トナミホールディングス	1,800	4,940.00	8,892,000
ニッコンホールディングス	26,200	2,529.00	66,259,800
福山通運	8,800	3,885.00	34,188,000
セイノーホールディングス	51,600	1,415.00	73,014,000
神奈川中央交通	2,500	3,910.00	9,775,000
日立物流	14,600	3,165.00	46,209,000
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	1,256.00	10,801,600
九州旅客鉄道	58,000	3,330.00	193,140,000
S Gホールディングス	65,100	2,729.00	177,657,900
日本郵船	58,700	1,851.00	108,653,700
商船三井	41,400	2,879.00	119,190,600
川崎汽船	15,400	1,280.00	19,712,000



N S ユナイテッド海運	4,400	2,308.00	10,155,200
飯野海運	35,500	348.00	12,354,000
乾汽船	8,400	1,083.00	9,097,200
日本航空	126,400	3,390.00	428,496,000
A N A ホールディングス	126,100	3,733.00	470,731,300
トランコム	2,000	6,050.00	12,100,000
日新	6,500	1,547.00	10,055,500
三菱倉庫	24,300	2,736.00	66,484,800
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,697.00	14,594,200
住友倉庫	24,300	1,428.00	34,700,400
澁澤倉庫	5,500	1,995.00	10,972,500
東陽倉庫	20,300	332.00	6,739,600
日本トランスシティ	19,500	483.00	9,418,500
川西倉庫	2,800	1,087.00	3,043,600
安田倉庫	8,700	942.00	8,195,400
東洋埠頭	3,800	1,371.00	5,209,800
上組	42,800	2,505.00	107,214,000
キューソー流通システム	2,300	1,895.00	4,358,500
近鉄エクスプレス	12,800	1,518.00	19,430,400
エーアイティー	5,700	976.00	5,563,200
N E C ネットエスアイ	7,900	2,873.00	22,696,700
システナ	25,500	1,520.00	38,760,000
デジタルアーツ	3,900	6,850.00	26,715,000
日鉄ソリューションズ	10,500	3,550.00	37,275,000
キューブシステム	6,800	810.00	5,508,000
コア	4,400	1,348.00	5,931,200
ソリトンシステムズ	5,200	993.00	5,163,600
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,727.00	7,598,800
T I S	23,800	6,100.00	145,180,000
ネオス	4,300	770.00	3,311,000
電算システム	3,500	2,926.00	10,241,000
グリー	49,700	498.00	24,750,600
コーエーテクモホールディングス	14,800	2,256.00	33,388,800
三菱総合研究所	3,300	3,530.00	11,649,000
ファインデックス	8,100	965.00	7,816,500
ブレインパッド	1,500	7,360.00	11,040,000
K L a b	13,400	1,232.00	16,508,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,300	1,004.00	10,341,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,837.00	3,122,900
ネクソン	202,600	1,461.00	295,998,600
アイスタイル	18,900	669.00	12,644,100
エムアップ	2,700	2,127.00	5,742,900

エイチーム	5,300	944.00	5,003,200
エニグモ	5,600	1,086.00	6,081,600
テクノスジャパン	7,300	526.00	3,839,800
コロプラ	24,600	793.00	19,507,800
ブロードリーフ	37,200	576.00	21,427,200
デジタルハーツホールディングス	4,300	954.00	4,102,200
システム情報	4,300	1,005.00	4,321,500
メディアドゥホールディングス	2,700	3,510.00	9,477,000
じげん	10,900	600.00	6,540,000
フィックスターズ	7,500	1,395.00	10,462,500
CARTA HOLDINGS	4,800	1,019.00	4,891,200
オブティム	3,700	2,801.00	10,363,700
セレス	2,800	1,302.00	3,645,600
ティーガイア	4,900	2,215.00	10,853,500
セック	1,400	3,085.00	4,319,000
豆蔵ホールディングス	6,500	1,583.00	10,289,500
テクマトリックス	5,500	2,155.00	11,852,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,700	2,344.00	41,488,800
GMOペイメントゲートウェイ	11,800	6,700.00	79,060,000
インターネットイニシアティブ	12,000	2,511.00	30,132,000
さくらインターネット	11,000	624.00	6,864,000
ヴィンクス	3,000	1,219.00	3,657,000
GMOクラウド	2,000	2,549.00	5,098,000
SRAホールディングス	4,300	2,544.00	10,939,200
eBASE	5,800	984.00	5,707,200
アバント	3,100	1,845.00	5,719,500
アドソル日進	3,000	2,158.00	6,474,000
フリービット	5,800	936.00	5,428,800
コムチュア	4,200	3,895.00	16,359,000
アステリア	5,100	645.00	3,289,500
マークライنز	3,900	1,937.00	7,554,300
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,114.00	7,798,000
gumi	10,200	639.00	6,517,800
モバイルファクトリー	2,700	1,642.00	4,433,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,474.00	5,306,400
PCIホールディングス	1,800	2,086.00	3,754,800
ダブルスタンダード	800	4,630.00	3,704,000
オープンドア	3,900	2,241.00	8,739,900
アカツキ	2,600	7,330.00	19,058,000
Ubicomホールディングス	1,800	1,561.00	2,809,800
LINE	16,600	4,075.00	67,645,000
チェンジ	1,500	2,004.00	3,006,000

オークネット	5,200	1,385.00	7,202,000
AOI TYO Holdings	8,700	638.00	5,550,600
マクロミル	12,600	944.00	11,894,400
オロ	2,200	2,704.00	5,948,800
フェイス	5,300	780.00	4,134,000
プロトコーポレーション	7,200	1,194.00	8,596,800
野村総合研究所	135,700	2,080.00	282,256,000
サイバネットシステム	8,000	622.00	4,976,000
インテージホールディングス	10,700	940.00	10,058,000
ソースネクスト	28,800	463.00	13,334,400
インフォコム	8,100	2,385.00	19,318,500
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,372.00	11,662,000
フォーカスシステムズ	6,000	869.00	5,214,000
クレスコ	2,500	3,405.00	8,512,500
フジ・メディア・ホールディングス	75,100	1,471.00	110,472,100
オービック	24,800	11,540.00	286,192,000
ジャストシステム	10,100	3,740.00	37,774,000
TDCソフト	7,400	771.00	5,705,400
ヤフー	468,900	318.00	149,110,200
トレンドマイクロ	32,100	5,110.00	164,031,000
日本オラクル	14,400	9,250.00	133,200,000
アルファシステムズ	2,900	2,806.00	8,137,400
フューチャー	8,800	1,756.00	15,452,800
CAC Holdings	7,200	1,312.00	9,446,400
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	2,018.00	6,861,200
オービックビジネスコンサルタント	7,200	4,325.00	31,140,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,500	2,872.00	93,340,000
アイティフォー	10,300	846.00	8,713,800
大塚商会	38,600	4,075.00	157,295,000
サイボウズ	10,600	1,039.00	11,013,400
ソフトブレーン	7,800	622.00	4,851,600
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	3,360.00	48,048,000
EMシステムズ	7,200	1,872.00	13,478,400
ウェザーニューズ	3,000	3,310.00	9,930,000
C I J	9,000	829.00	7,461,000
WOWOW	3,600	2,632.00	9,475,200
スカラ	7,700	1,025.00	7,892,500
IMAGICA GROUP	7,400	522.00	3,862,800
ネットワンシステムズ	25,600	2,785.00	71,296,000
アルゴグラフィックス	6,300	2,560.00	16,128,000
マーベラス	12,200	800.00	9,760,000

エイベックス	12,800	1,299.00	16,627,200
日本ユニシス	22,200	3,310.00	73,482,000
兼松エレクトロニクス	4,000	3,090.00	12,360,000
東京放送ホールディングス	47,700	1,791.00	85,430,700
日本テレビホールディングス	66,000	1,447.00	95,502,000
朝日放送グループホールディングス	10,500	736.00	7,728,000
テレビ朝日ホールディングス	20,400	1,786.00	36,434,400
スカパーJ S A Tホールディングス	49,400	444.00	21,933,600
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,146.00	13,090,600
ビジョン	2,300	4,890.00	11,247,000
コネクシオ	6,000	1,402.00	8,412,000
日本電信電話	488,400	5,348.00	2,611,963,200
K D D I	584,800	2,925.00	1,710,540,000
ソフトバンク	757,700	1,530.00	1,159,281,000
光通信	8,400	23,500.00	197,400,000
N T T ドコモ	452,300	2,843.50	1,286,115,050
エムティーアイ	9,800	719.00	7,046,200
G M O インターネット	26,500	1,707.00	45,235,500
K A D O K A W A	21,500	1,529.00	32,873,500
学研ホールディングス	2,600	5,260.00	13,676,000
ゼンリン	14,500	1,854.00	26,883,000
アイネット	5,200	1,383.00	7,191,600
松竹	4,900	13,510.00	66,199,000
東宝	47,200	4,620.00	218,064,000
東映	3,000	15,270.00	45,810,000
エヌ・ティ・ティ・データ	188,700	1,423.00	268,520,100
ピー・シー・エー	1,200	3,570.00	4,284,000
D T S	15,700	2,242.00	35,199,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,600	4,605.00	154,728,000
シーイーシー	7,700	2,204.00	16,970,800
カブコン	31,600	2,600.00	82,160,000
アイ・エス・ビー	2,200	1,493.00	3,284,600
ジャステック	5,800	1,120.00	6,496,000
S C S K	19,000	5,060.00	96,140,000
日本システムウエア	2,800	2,440.00	6,832,000
アイネス	10,300	1,062.00	10,938,600
T K C	6,000	4,570.00	27,420,000
富士ソフト	9,200	4,505.00	41,446,000
N S D	11,600	3,035.00	35,206,000
コナミホールディングス	29,400	4,970.00	146,118,000
福井コンピュータホールディングス	3,100	2,182.00	6,764,200
J B C C ホールディングス	6,600	1,538.00	10,150,800

ミロク情報サービス	7,300	2,862.00	20,892,600
ソフトバンクグループ	566,500	4,690.00	2,656,885,000
伊藤忠食品	2,000	4,340.00	8,680,000
エレマテック	7,800	1,030.00	8,034,000
J A L U X	2,400	2,384.00	5,721,600
あらた	5,400	3,955.00	21,357,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,086.00	7,926,800
フィールズ	8,500	510.00	4,335,000
双日	389,900	352.00	137,244,800
アルフレッサ ホールディングス	78,800	2,523.00	198,812,400
横浜冷凍	20,200	1,050.00	21,210,000
ラクーンホールディングス	5,800	616.00	3,572,800
アルコニックス	8,700	1,263.00	10,988,100
神戸物産	12,300	4,870.00	59,901,000
あい ホールディングス	10,700	1,803.00	19,292,100
ダイワボウホールディングス	6,600	4,390.00	28,974,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,800	1,459.00	28,888,200
ラクト・ジャパン	3,000	3,565.00	10,695,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,081.00	15,134,000
八洲電機	9,000	912.00	8,208,000
レスターホールディングス	8,400	1,731.00	14,540,400
ジューテックホールディングス	2,900	958.00	2,778,200
T O K A I ホールディングス	37,300	1,027.00	38,307,100
三洋貿易	4,400	2,274.00	10,005,600
ウイン・パートナーズ	5,300	1,152.00	6,105,600
シップヘルスケアホールディングス	15,100	4,595.00	69,384,500
コメダホールディングス	17,300	1,974.00	34,150,200
小野建	7,100	1,365.00	9,691,500
佐島電機	7,300	791.00	5,774,300
伯東	5,900	1,180.00	6,962,000
コンドーテック	8,000	924.00	7,392,000
ナガイレーベン	10,800	2,224.00	24,019,200
三菱食品	7,000	2,710.00	18,970,000
松田産業	6,200	1,467.00	9,095,400
第一興商	11,000	4,960.00	54,560,000
メディバルホールディングス	76,700	2,445.00	187,531,500
S P K	1,800	2,499.00	4,498,200
萩原電気ホールディングス	3,200	2,681.00	8,579,200
アズワン	5,200	8,740.00	45,448,000
尾家産業	4,100	1,359.00	5,571,900
シモジマ	5,400	1,134.00	6,123,600
ドウシシャ	6,500	1,779.00	11,563,500

高速	6,200	1,321.00	8,190,200
丸文	9,000	575.00	5,175,000
ハビネット	6,700	1,328.00	8,897,600
日本ライフライン	21,000	1,861.00	39,081,000
エクセル	3,300	1,246.00	4,111,800
マルカ	3,200	2,074.00	6,636,800
I D O M	26,700	440.00	11,748,000
日本エム・ディ・エム	5,100	1,617.00	8,246,700
進和	4,800	2,188.00	10,502,400
ダイترون	4,100	1,282.00	5,256,200
シークス	9,400	1,509.00	14,184,600
オーハシテクニカ	5,900	1,423.00	8,395,700
伊藤忠商事	501,100	2,264.00	1,134,490,400
丸紅	706,200	766.70	541,443,540
長瀬産業	40,200	1,573.00	63,234,600
蝶理	5,200	1,696.00	8,819,200
豊田通商	79,600	3,750.00	298,500,000
三共生興	18,000	506.00	9,108,000
兼松	27,700	1,272.00	35,234,400
三井物産	591,000	1,905.00	1,125,855,000
日本紙パルプ商事	4,200	3,980.00	16,716,000
日立ハイテクノロジーズ	21,900	6,170.00	135,123,000
カメイ	9,900	1,156.00	11,444,400
スターゼン	3,000	4,300.00	12,900,000
山善	26,900	958.00	25,770,200
椿本興業	2,200	3,650.00	8,030,000
住友商事	424,100	1,777.50	753,837,750
内田洋行	3,900	3,845.00	14,995,500
三菱商事	502,900	2,814.00	1,415,160,600
第一実業	3,500	2,914.00	10,199,000
キャノンマーケティングジャパン	21,200	2,261.00	47,933,200
西華産業	4,800	1,314.00	6,307,200
佐藤商事	8,000	856.00	6,848,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,876.00	14,632,800
東京産業	10,100	506.00	5,110,600
ユアサ商事	7,200	3,175.00	22,860,000
神鋼商事	2,000	2,388.00	4,776,000
阪和興業	12,400	3,135.00	38,874,000
正栄食品工業	5,000	3,280.00	16,400,000
カナデン	7,900	1,339.00	10,578,100
菱電商事	6,900	1,614.00	11,136,600
フルサト工業	5,200	1,453.00	7,555,600

岩谷産業	16,400	3,655.00	59,942,000
極東貿易	3,400	1,843.00	6,266,200
イワキ	11,600	493.00	5,718,800
三愛石油	19,200	1,130.00	21,696,000
稲畑産業	16,100	1,348.00	21,702,800
ワキタ	16,400	1,089.00	17,859,600
東邦ホールディングス	21,400	2,550.00	54,570,000
サンゲツ	21,700	2,073.00	44,984,100
ミツウロコグループホールディングス	11,100	1,015.00	11,266,500
シナネンホールディングス	3,600	1,776.00	6,393,600
伊藤忠エネクス	15,100	859.00	12,970,900
サンリオ	22,100	2,130.00	47,073,000
サンワテクノス	5,700	819.00	4,668,300
リョーサン	7,900	2,813.00	22,222,700
新光商事	7,400	1,887.00	13,963,800
トーヨー	4,100	1,850.00	7,585,000
三信電気	5,700	1,522.00	8,675,400
東陽テクニカ	11,000	1,079.00	11,869,000
モスフードサービス	9,500	2,507.00	23,816,500
加賀電子	7,400	1,965.00	14,541,000
ソーダニッカ	11,200	554.00	6,204,800
立花エレテック	6,100	1,669.00	10,180,900
PALTA C	12,600	5,340.00	67,284,000
太平洋興発	6,600	797.00	5,260,200
西本Wismettacホールディングス	1,800	3,455.00	6,219,000
国際紙パルプ商事	18,100	314.00	5,683,400
ヤマタネ	4,800	1,377.00	6,609,600
日鉄物産	4,400	4,385.00	19,294,000
泉州電業	3,000	2,732.00	8,196,000
トラスコ中山	14,900	2,550.00	37,995,000
オートバックスセブン	29,200	1,831.00	53,465,200
モリト	7,700	764.00	5,882,800
加藤産業	10,800	3,385.00	36,558,000
イノテック	5,800	882.00	5,115,600
イエローハット	13,600	1,627.00	22,127,200
J Kホールディングス	10,000	529.00	5,290,000
日伝	6,500	2,051.00	13,331,500
杉本商事	4,800	2,110.00	10,128,000
因幡電機産業	9,900	4,845.00	47,965,500
東テク	3,000	2,088.00	6,264,000
ミスミグループ本社	89,700	2,602.00	233,399,400
タキヒヨー	2,000	1,798.00	3,596,000

スズケン	32,600	5,900.00	192,340,000
ジェコス	6,500	879.00	5,713,500
ローソン	18,500	5,840.00	108,040,000
サンエー	5,200	4,815.00	25,038,000
カワチ薬品	6,200	2,107.00	13,063,400
エービーシー・マート	11,200	6,730.00	75,376,000
アスクル	7,500	2,882.00	21,615,000
ゲオホールディングス	11,100	1,334.00	14,807,400
アダストリア	10,200	2,388.00	24,357,600
くら寿司	3,800	4,505.00	17,119,000
キャンドウ	5,100	1,679.00	8,562,900
パルグループホールディングス	4,100	3,275.00	13,427,500
エディオン	30,000	1,044.00	31,320,000
サーラコーポレーション	16,600	617.00	10,242,200
ハローズ	3,100	2,237.00	6,934,700
フジオフードシステム	3,300	2,745.00	9,058,500
あみやき亭	2,000	3,490.00	6,980,000
ひらまつ	20,500	355.00	7,277,500
大黒天物産	2,000	3,360.00	6,720,000
ハニーズホールディングス	7,800	1,426.00	11,122,800
アルペン	6,100	1,673.00	10,205,300
クオールホールディングス	10,900	1,500.00	16,350,000
ジinzホールディングス	3,800	6,470.00	24,586,000
ビックカメラ	42,000	1,131.00	47,502,000
D C Mホールディングス	37,900	1,057.00	40,060,300
ペッパーフードサービス	6,200	1,567.00	9,715,400
Monotaro	51,400	2,880.00	148,032,000
DDホールディングス	4,000	1,507.00	6,028,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	1,939.00	10,664,500
J.フロント リテイリング	92,100	1,312.00	120,835,200
ドトール・日レスホールディングス	12,300	2,125.00	26,137,500
マツモトキヨシホールディングス	29,500	4,080.00	120,360,000
ブロンコビリー	4,100	2,345.00	9,614,500
Z O Z O	77,800	2,471.00	192,243,800
物語コーポレーション	1,900	10,040.00	19,076,000
ココカラファイン	7,900	6,110.00	48,269,000
三越伊勢丹ホールディングス	133,800	879.00	117,610,200
ウエルシアホールディングス	18,900	5,560.00	105,084,000
クリエイティブSDホールディングス	9,800	2,464.00	24,147,200
チムニー	2,800	2,508.00	7,022,400
シュッピン	5,900	994.00	5,864,600
ネクステージ	10,700	1,090.00	11,663,000



ジョイフル本田	20,500	1,379.00	28,269,500
鳥貴族	3,000	2,329.00	6,987,000
キリン堂ホールディングス	3,600	2,019.00	7,268,400
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	1,917.00	155,468,700
綿半ホールディングス	3,100	2,080.00	6,448,000
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	1,004.00	19,176,400
B E E N O S	2,800	1,245.00	3,486,000
あさひ	6,700	1,233.00	8,261,100
日本調剤	2,700	3,795.00	10,246,500
コスモス薬品	3,200	21,650.00	69,280,000
セブン&アイ・ホールディングス	300,200	4,145.00	1,244,329,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,500	1,675.00	30,987,500
ツルハホールディングス	15,600	12,170.00	189,852,000
サンマルクホールディングス	5,500	2,421.00	13,315,500
トリドールホールディングス	9,100	2,610.00	23,751,000
T O K Y O B A S E	7,300	846.00	6,175,800
ジャパンミート	4,400	2,245.00	9,878,000
アレンザホールディングス	5,000	802.00	4,010,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	986.00	6,803,400
クスリのアオキホールディングス	7,100	8,500.00	60,350,000
スシローグローバルホールディングス	8,000	7,000.00	56,000,000
L I X I L ビバ	6,800	1,641.00	11,158,800
メディカルシステムネットワーク	10,700	590.00	6,313,000
ノジマ	11,900	1,810.00	21,539,000
カップ・クリエイト	11,200	1,457.00	16,318,400
ライトオン	8,000	680.00	5,440,000
良品計画	102,000	2,060.00	210,120,000
三城ホールディングス	15,500	312.00	4,836,000
アドヴァン	12,600	1,161.00	14,628,600
アルビス	3,200	2,432.00	7,782,400
コナカ	17,200	433.00	7,447,600
G - 7ホールディングス	2,600	3,160.00	8,216,000
イオン北海道	10,100	746.00	7,534,600
コジマ	15,000	483.00	7,245,000
コーナン商事	9,300	2,457.00	22,850,100
エコス	3,100	1,649.00	5,111,900
ワタミ	10,300	1,417.00	14,595,100
パン・パシフィック・インターナショナルホ	171,600	1,736.00	297,897,600
西松屋チェーン	16,400	964.00	15,809,600
ゼンショーホールディングス	34,600	2,443.00	84,527,800

幸楽苑ホールディングス	4,700	2,441.00	11,472,700
サイゼリヤ	11,500	2,685.00	30,877,500
V Tホールディングス	32,000	465.00	14,880,000
ユナイテッドアローズ	8,400	3,005.00	25,242,000
ハイデイ日高	10,000	2,103.00	21,030,000
コロワイド	24,500	2,171.00	53,189,500
ピーシーデポコーポレーション	11,800	509.00	6,006,200
壱番屋	5,000	5,040.00	25,200,000
スギホールディングス	15,900	5,880.00	93,492,000
薬王堂ホールディングス	3,000	2,600.00	7,800,000
ヴィア・ホールディングス	13,300	686.00	9,123,800
スクロール	14,200	338.00	4,799,600
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,652.00	22,011,600
ファミリーマート	80,300	2,665.00	213,999,500
木曽路	8,900	2,760.00	24,564,000
S R Sホールディングス	11,200	1,070.00	11,984,000
ケーヨー	17,000	499.00	8,483,000
上新電機	8,600	2,120.00	18,232,000
日本瓦斯	11,700	3,030.00	35,451,000
ロイヤルホールディングス	12,300	2,643.00	32,508,900
いなげや	8,000	1,629.00	13,032,000
島忠	15,500	2,687.00	41,648,500
チヨダ	7,400	1,677.00	12,409,800
ライフコーポレーション	5,600	2,202.00	12,331,200
リンガーハット	9,100	2,523.00	22,959,300
MrMaxHD	11,800	458.00	5,404,400
AOKIホールディングス	14,100	1,091.00	15,383,100
オークワ	11,000	1,228.00	13,508,000
コメリ	11,100	2,276.00	25,263,600
青山商事	13,100	1,971.00	25,820,100
しまむら	8,300	8,530.00	70,799,000
高島屋	57,800	1,310.00	75,718,000
松屋	15,300	844.00	12,913,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,200	1,246.00	46,351,200
近鉄百貨店	3,000	3,110.00	9,330,000
パルコ	7,700	1,279.00	9,848,300
丸井グループ	60,900	2,272.00	138,364,800
アクシアル リテイリング	5,600	4,050.00	22,680,000
イオン	275,400	2,011.00	553,829,400
イズミ	14,800	4,355.00	64,454,000
平和堂	14,000	2,105.00	29,470,000
フジ	9,000	1,926.00	17,334,000

ヤオコー	7,900	4,925.00	38,907,500
ゼビオホールディングス	8,700	1,205.00	10,483,500
ケーズホールディングス	75,700	1,205.00	91,218,500
Olympicグループ	5,800	615.00	3,567,000
日産東京販売ホールディングス	17,800	287.00	5,108,600
Genky DrugStores	4,000	2,183.00	8,732,000
総合メディカルホールディングス	6,400	1,738.00	11,123,200
アインホールディングス	9,800	6,240.00	61,152,000
元気寿司	2,300	2,901.00	6,672,300
ヤマダ電機	218,100	530.00	115,593,000
アークランドサカモト	12,400	1,321.00	16,380,400
ニトリホールディングス	31,100	15,955.00	496,200,500
グルメ杵屋	8,200	1,202.00	9,856,400
吉野家ホールディングス	26,400	2,229.00	58,845,600
松屋フーズホールディングス	3,400	3,890.00	13,226,000
サガミホールディングス	10,800	1,383.00	14,936,400
関西スーパーマーケット	6,900	1,118.00	7,714,200
王将フードサービス	5,200	6,970.00	36,244,000
プレナス	8,000	1,792.00	14,336,000
ミニストップ	5,900	1,451.00	8,560,900
アークス	12,400	2,283.00	28,309,200
パローホールディングス	15,800	1,856.00	29,324,800
ベルク	3,400	5,260.00	17,884,000
大庄	5,500	1,594.00	8,767,000
ファーストリテイリング	9,600	64,840.00	622,464,000
サンドラッグ	26,900	3,430.00	92,267,000
サックスパー ホールディングス	7,300	917.00	6,694,100
ベルーナ	17,800	721.00	12,833,800
じもとホールディングス	59,100	102.00	6,028,200
めぶきフィナンシャルグループ	375,600	267.00	100,285,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,300	1,390.00	14,317,000
九州フィナンシャルグループ	120,000	452.00	54,240,000
ゆうちょ銀行	203,300	1,077.00	218,954,100
富山第一銀行	19,600	317.00	6,213,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	450,700	427.00	192,448,900
西日本フィナンシャルホールディングス	45,600	722.00	32,923,200
関西みらいフィナンシャルグループ	34,500	730.00	25,185,000
三十三フィナンシャルグループ	6,000	1,727.00	10,362,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	2,702.00	34,585,600
新生銀行	53,200	1,579.00	84,002,800
あおぞら銀行	40,200	2,740.00	110,148,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,938,000	571.70	2,823,054,600

りそなホールディングス	786,700	480.50	378,009,350
三井住友トラスト・ホールディングス	140,600	4,021.00	565,352,600
三井住友フィナンシャルグループ	505,700	3,806.00	1,924,694,200
千葉銀行	248,100	579.00	143,649,900
群馬銀行	144,600	370.00	53,502,000
武蔵野銀行	11,100	1,890.00	20,979,000
千葉興業銀行	20,600	308.00	6,344,800
筑波銀行	32,800	186.00	6,100,800
七十七銀行	23,200	1,661.00	38,535,200
青森銀行	5,400	2,651.00	14,315,400
秋田銀行	5,100	2,068.00	10,546,800
山形銀行	8,600	1,490.00	12,814,000
岩手銀行	5,300	2,572.00	13,631,600
東邦銀行	67,200	258.00	17,337,600
東北銀行	4,000	1,044.00	4,176,000
みちのく銀行	5,000	1,669.00	8,345,000
ふくおかフィナンシャルグループ	63,500	2,117.00	134,429,500
静岡銀行	175,500	826.00	144,963,000
十六銀行	9,900	2,368.00	23,443,200
スルガ銀行	56,000	452.00	25,312,000
八十二銀行	173,100	435.00	75,298,500
山梨中央銀行	9,600	1,081.00	10,377,600
大垣共立銀行	15,200	2,424.00	36,844,800
福井銀行	6,900	1,463.00	10,094,700
北國銀行	7,500	2,583.00	19,372,500
清水銀行	3,500	1,929.00	6,751,500
富山銀行	1,700	2,427.00	4,125,900
滋賀銀行	14,700	2,514.00	36,955,800
南都銀行	11,100	2,527.00	28,049,700
百五銀行	65,400	360.00	23,544,000
京都銀行	25,500	4,435.00	113,092,500
紀陽銀行	25,800	1,621.00	41,821,800
ほくほくフィナンシャルグループ	48,500	1,051.00	50,973,500
広島銀行	106,600	550.00	58,630,000
山陰合同銀行	43,700	659.00	28,798,300
中国銀行	62,200	1,001.00	62,262,200
伊予銀行	96,100	574.00	55,161,400
百十四銀行	8,100	2,203.00	17,844,300
四国銀行	11,100	1,000.00	11,100,000
阿波銀行	11,200	2,364.00	26,476,800
大分銀行	4,700	3,030.00	14,241,000
宮崎銀行	5,200	2,493.00	12,963,600

佐賀銀行	4,700	1,514.00	7,115,800
沖縄銀行	6,900	3,425.00	23,632,500
琉球銀行	17,000	1,135.00	19,295,000
セブン銀行	242,900	298.00	72,384,200
みずほフィナンシャルグループ	9,747,600	168.90	1,646,369,640
山口フィナンシャルグループ	89,200	774.00	69,040,800
名古屋銀行	6,000	3,150.00	18,900,000
北洋銀行	112,300	236.00	26,502,800
愛知銀行	2,600	3,570.00	9,282,000
中京銀行	3,000	2,250.00	6,750,000
大光銀行	2,500	1,688.00	4,220,000
愛媛銀行	10,200	1,119.00	11,413,800
京葉銀行	32,300	649.00	20,962,700
栃木銀行	42,500	194.00	8,245,000
東和銀行	13,800	799.00	11,026,200
トモニホールディングス	58,400	356.00	20,790,400
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	198.00	16,077,600
F P G	23,500	1,158.00	27,213,000
S B I ホールディングス	86,500	2,531.00	218,931,500
ジャフコ	12,100	4,180.00	50,578,000
大和証券グループ本社	579,400	511.50	296,363,100
野村ホールディングス	1,268,900	476.70	604,884,630
岡三証券グループ	63,600	385.00	24,486,000
丸三証券	22,500	536.00	12,060,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87,100	323.00	28,133,300
水戸証券	26,500	215.00	5,697,500
いちよし証券	16,600	681.00	11,304,600
松井証券	35,900	923.00	33,135,700
マネックスグループ	69,900	330.00	23,067,000
極東証券	11,100	899.00	9,978,900
岩井コスモホールディングス	8,000	1,160.00	9,280,000
藍澤証券	15,600	727.00	11,341,200
スパークス・グループ	30,000	250.00	7,500,000
かんぽ生命保険	27,000	1,667.00	45,009,000
S O M P O ホールディングス	126,200	4,738.00	597,935,600
アニコム ホールディングス	6,200	3,930.00	24,366,000
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	3,595.00	674,062,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	59,300	2,370.00	140,541,000
第一生命ホールディングス	404,800	1,660.50	672,170,400
東京海上ホールディングス	256,800	5,919.00	1,519,999,200
T & D ホールディングス	221,600	1,181.00	261,709,600

アドバンスクリエイト	2,000	1,923.00	3,846,000
全国保証	20,500	4,180.00	85,690,000
C a s a	4,000	1,225.00	4,900,000
アルヒ	7,200	2,055.00	14,796,000
プレミアグループ	4,400	1,919.00	8,443,600
クレディセゾン	50,400	1,392.00	70,156,800
芙蓉総合リース	8,400	6,700.00	56,280,000
興銀リース	14,300	3,015.00	43,114,500
東京センチュリー	14,400	5,170.00	74,448,000
日本証券金融	32,200	515.00	16,583,000
アイフル	98,800	250.00	24,700,000
リコーリース	6,100	3,570.00	21,777,000
イオンフィナンシャルサービス	45,500	1,706.00	77,623,000
アコム	146,800	420.00	61,656,000
ジャックス	8,400	2,342.00	19,672,800
オリエントコーポレーション	203,000	143.00	29,029,000
日立キャピタル	17,200	2,296.00	39,491,200
オリックス	477,200	1,755.00	837,486,000
三菱UFJリース	162,400	656.00	106,534,400
日本取引所グループ	194,700	1,830.00	356,301,000
イー・ギャランティ	7,100	1,274.00	9,045,400
NECキャピタルソリューション	3,300	2,140.00	7,062,000
いちご	94,200	441.00	41,542,200
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	1,875.00	7,500,000
ヒューリック	152,800	1,097.00	167,621,600
三栄建築設計	3,600	1,466.00	5,277,600
野村不動産ホールディングス	48,200	2,401.00	115,728,200
三重交通グループホールディングス	16,400	552.00	9,052,800
サムティ	10,600	1,886.00	19,991,600
ディア・ライフ	11,100	516.00	5,727,600
日本商業開発	5,500	1,538.00	8,459,000
プレサンスコーポレーション	12,100	1,698.00	20,545,800
ユニゾホールディングス	11,300	4,160.00	47,008,000
日本管理センター	5,800	1,400.00	8,120,000
フージャースホールディングス	17,800	641.00	11,409,800
オープンハウス	10,600	5,210.00	55,226,000
東急不動産ホールディングス	192,400	681.00	131,024,400
飯田グループホールディングス	59,700	1,807.00	107,877,900
ムゲンエステート	8,200	621.00	5,092,200
ビーロッド	2,000	1,661.00	3,322,000
ハウズドゥ	4,800	1,608.00	7,718,400

パーク24	39,100	2,419.00	94,582,900
パラカ	2,800	2,184.00	6,115,200
三井不動産	380,800	2,700.50	1,028,350,400
三菱地所	503,400	2,078.00	1,046,065,200
平和不動産	14,100	2,497.00	35,207,700
東京建物	80,000	1,469.00	117,520,000
ダイビル	22,200	1,102.00	24,464,400
京阪神ビルディング	14,500	1,210.00	17,545,000
住友不動産	161,800	4,099.00	663,218,200
テオオーシー	17,500	842.00	14,735,000
東京楽天地	1,800	5,710.00	10,278,000
スターツコーポレーション	9,600	2,585.00	24,816,000
フジ住宅	11,800	702.00	8,283,600
空港施設	13,300	541.00	7,195,300
ゴールドクレスト	6,700	2,213.00	14,827,100
日本エスリード	4,200	1,649.00	6,925,800
日神不動産	13,500	456.00	6,156,000
日本エスコン	14,100	789.00	11,124,900
タカラレーベン	36,800	422.00	15,529,600
サンヨーハウジング名古屋	7,000	891.00	6,237,000
イオンモール	37,100	1,725.00	63,997,500
カチタス	8,300	4,535.00	37,640,500
トーセイ	10,800	1,294.00	13,975,200
サンフロンティア不動産	10,500	1,258.00	13,209,000
エフ・ジェー・ネクスト	7,800	1,041.00	8,119,800
ランドビジネス	6,500	759.00	4,933,500
日本空港ビルデング	23,000	4,535.00	104,305,000
日本工営	5,100	3,005.00	15,325,500
L I F U L L	26,800	625.00	16,750,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,100	2,025.00	10,327,500
日本M & Aセンター	52,200	2,994.00	156,286,800
メンバーズ	2,600	1,730.00	4,498,000
タケエイ	10,300	939.00	9,671,700
トラスト・テック	7,400	1,246.00	9,220,400
コシダカホールディングス	16,200	1,588.00	25,725,600
パソナグループ	8,200	1,536.00	12,595,200
リンクアンドモチベーション	13,400	584.00	7,825,600
G C A	8,500	750.00	6,375,000
エス・エム・エス	25,200	2,635.00	66,402,000
パーソルホールディングス	69,600	2,292.00	159,523,200
リニカル	4,400	1,024.00	4,505,600
クックパッド	24,700	309.00	7,632,300

学情	3,800	1,368.00	5,198,400
スタジオアリス	4,100	1,985.00	8,138,500
シミックホールディングス	4,500	1,717.00	7,726,500
総合警備保障	27,700	5,460.00	151,242,000
カカクコム	52,900	2,550.00	134,895,000
アイロムグループ	3,200	1,607.00	5,142,400
ルネサンス	4,500	1,620.00	7,290,000
ディップ	11,400	2,543.00	28,990,200
オプトホールディング	4,800	1,563.00	7,502,400
新日本科学	11,600	722.00	8,375,200
ツクイ	20,000	449.00	8,980,000
ベネフィット・ワン	19,200	1,828.00	35,097,600
エムスリー	146,800	2,485.00	364,798,000
アウトソーシング	37,100	1,032.00	38,287,200
ウェルネット	8,600	714.00	6,140,400
ワールドホールディングス	2,200	1,622.00	3,568,400
ディー・エヌ・エー	38,300	1,938.00	74,225,400
博報堂D Yホールディングス	96,500	1,648.00	159,032,000
ぐるなび	11,500	708.00	8,142,000
タカミヤ	9,400	653.00	6,138,200
ジャパンベストレスキューシステム	5,900	1,093.00	6,448,700
ファンコミュニケーションズ	21,000	546.00	11,466,000
ライク	3,500	1,581.00	5,533,500
WDBホールディングス	3,600	2,661.00	9,579,600
バリューコマース	4,200	1,714.00	7,198,800
インフォマート	39,000	1,626.00	63,414,000
J Pホールディングス	25,400	287.00	7,289,800
E P Sホールディングス	10,700	1,313.00	14,049,100
プレステージ・インターナショナル	13,600	1,697.00	23,079,200
アミューズ	4,600	2,730.00	12,558,000
ドリームインキュベータ	3,200	1,354.00	4,332,800
クイック	5,000	1,319.00	6,595,000
ケネディクス	63,400	558.00	35,377,200
電通	71,800	3,930.00	282,174,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,229.00	4,178,600
ぴあ	2,100	4,395.00	9,229,500
イオンファンタジー	2,400	2,732.00	6,556,800
シーティーエス	9,200	701.00	6,449,200
ネクシィーズグループ	2,600	1,920.00	4,992,000
みらかホールディングス	20,100	2,500.00	50,250,000
アルプス技研	7,000	1,535.00	10,745,000
日本空調サービス	9,600	703.00	6,748,800



オリエンタルランド	82,100	15,680.00	1,287,328,000
ダスキン	18,100	2,843.00	51,458,300
明光ネットワークジャパン	10,600	897.00	9,508,200
ファルコホールディングス	5,200	1,680.00	8,736,000
ラウンドワン	21,200	1,594.00	33,792,800
リゾートトラスト	30,800	1,756.00	54,084,800
ビー・エム・エル	9,100	2,981.00	27,127,100
りらいあコミュニケーションズ	12,800	1,347.00	17,241,600
リソー教育	36,700	446.00	16,368,200
ユー・エス・エス	85,100	2,062.00	175,476,200
サイバーエージェント	40,300	4,150.00	167,245,000
楽天	325,200	1,060.00	344,712,000
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,163.00	5,698,700
テー・オー・ダブリュー	8,300	743.00	6,166,900
山田コンサルティンググループ	4,000	1,662.00	6,648,000
セントラルスポーツ	2,900	3,190.00	9,251,000
フルキャストホールディングス	6,700	2,094.00	14,029,800
エン・ジャパン	10,200	4,220.00	43,044,000
テクノプロ・ホールディングス	14,200	6,490.00	92,158,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,200	3,475.00	11,120,000
Gunosy	5,400	1,460.00	7,884,000
イー・ガーディアン	4,200	1,746.00	7,333,200
ジャパンマテリアル	19,300	1,275.00	24,607,500
ベクトル	8,900	941.00	8,374,900
チャーム・ケア・コーポレーション	2,500	1,887.00	4,717,500
I B J	5,600	1,031.00	5,773,600
アサンテ	3,500	2,043.00	7,150,500
N・フィールド	5,900	623.00	3,675,700
バリューHR	2,100	3,090.00	6,489,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,400	6,230.00	14,952,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,436.00	6,031,200
アビスト	1,500	2,730.00	4,095,000
シグマクシス	4,400	1,315.00	5,786,000
ウィルグループ	5,400	881.00	4,757,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,100	236.00	2,855,600
リクルートホールディングス	497,700	3,250.00	1,617,525,000
エラン	4,800	1,750.00	8,400,000
日本郵政	568,600	1,029.00	585,089,400
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,549.00	18,588,000
鎌倉新書	5,400	1,452.00	7,840,800
LITALICO	2,300	1,861.00	4,280,300
エボラブルアジア	3,500	2,025.00	7,087,500

アトラエ	2,300	2,567.00	5,904,100
ストライク	3,100	2,630.00	8,153,000
ソラスト	17,300	1,212.00	20,967,600
インソース	3,700	2,293.00	8,484,100
ベikalレント・コンサルティング	5,000	4,385.00	21,925,000
MS - J a p a n	3,200	1,466.00	4,691,200
グレイステクノロジー	2,900	2,833.00	8,215,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,500	2,463.00	13,546,500
日総工産	4,900	1,110.00	5,439,000
キュービーネットホールディングス	4,600	2,159.00	9,931,400
R P Aホールディングス	3,000	1,650.00	4,950,000
スプリックス	2,800	1,443.00	4,040,400
リログループ	38,100	2,470.00	94,107,000
東祥	4,500	2,278.00	10,251,000
エイチ・アイ・エス	11,200	2,752.00	30,822,400
共立メンテナンス	10,600	4,430.00	46,958,000
イチネンホールディングス	8,500	1,123.00	9,545,500
建設技術研究所	5,700	1,626.00	9,268,200
スペース	4,300	1,253.00	5,387,900
燦ホールディングス	2,500	2,185.00	5,462,500
東京テアトル	4,900	1,390.00	6,811,000
ナガワ	2,100	5,650.00	11,865,000
よみうりランド	2,300	4,610.00	10,603,000
東京都競馬	4,700	3,370.00	15,839,000
常磐興産	4,300	1,729.00	7,434,700
カナモト	10,700	2,672.00	28,590,400
東京ドーム	27,000	1,032.00	27,864,000
西尾レントオール	7,200	2,879.00	20,728,800
トランス・コスモス	7,800	2,535.00	19,773,000
乃村工藝社	32,800	1,299.00	42,607,200
藤田観光	3,300	2,844.00	9,385,200
K N T - C Tホールディングス	4,300	1,454.00	6,252,200
日本管財	7,000	1,883.00	13,181,000
トーカイ	6,800	2,336.00	15,884,800
セコム	73,800	9,547.00	704,568,600
セントラル警備保障	3,500	5,240.00	18,340,000
丹青社	13,300	1,245.00	16,558,500
メイテック	8,700	5,310.00	46,197,000
応用地質	8,800	1,132.00	9,961,600
船井総研ホールディングス	14,300	2,387.00	34,134,100
オオバ	8,200	621.00	5,092,200
学究社	4,200	1,235.00	5,187,000

ベネッセホールディングス	26,200	2,790.00	73,098,000	
イオンディライト	8,400	3,505.00	29,442,000	
ナック	6,000	964.00	5,784,000	
ニチイ学館	10,800	1,655.00	17,874,000	
ダイセキ	11,900	2,812.00	33,462,800	
合 計	84,786,200		168,222,688,330	

## (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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	3,140,754,221	2,958,671,186
コール・ローン	269,918,099	651,058,620
株式	180,812,175,751	177,112,462,289
投資証券	4,109,804,689	4,655,504,664
派生商品評価勘定	53,528,142	145,255,192
未収入金	5,973,894	5,608,024
未収配当金	379,639,369	386,435,786
差入委託証拠金	1,938,073,552	1,171,202,979
<b>流動資産合計</b>	<b>190,709,867,717</b>	<b>187,086,198,740</b>
<b>資産合計</b>	<b>190,709,867,717</b>	<b>187,086,198,740</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	44,685,518	2,394,714
前受金	8,841,265	142,854,978
未払金	-	181,470,532
未払解約金	163,224,139	552,384,974
未払利息	759	1,873
その他未払費用	1,869	8,517
<b>流動負債合計</b>	<b>216,753,550</b>	<b>879,115,588</b>
<b>負債合計</b>	<b>216,753,550</b>	<b>879,115,588</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	52,677,733,208	50,965,014,742
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	137,815,380,959	135,242,068,410
<b>元本等合計</b>	<b>190,493,114,167</b>	<b>186,207,083,152</b>
<b>純資産合計</b>	<b>190,493,114,167</b>	<b>186,207,083,152</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>190,709,867,717</b>	<b>187,086,198,740</b>

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 9月18日現在）	（令和 1年 9月17日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	52,677,733,208口	50,965,014,742口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6162円 (10,000口当たりの純資産額 36,162円)	1口当たり純資産額 3.6536円 (10,000口当たりの純資産額 36,536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19日 至 令和 1年 9月17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	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17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）

（平成30年9月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,547,498,854	-	5,556,340,119	8,841,265
	SPMINI 1809	3,912,274,699	-	3,960,431,492	48,156,793
	DJ EUR 1809	1,008,797,927	-	983,425,477	25,372,450
	FTSE 1809	376,239,885	-	364,854,000	11,385,885
市場取引以外の取引	SPI200 1809	250,186,343	-	247,629,150	2,557,193
	為替予約取引				
	売建	313,959	-	312,600	1,359
	イスラエルシュケル	313,959	-	312,600	1,359
合計		5,547,812,813	-	5,556,652,719	8,842,624

（令和1年9月17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	4,264,380,075	-	4,407,235,053	142,854,978
	SPMINI 1909	3,097,472,508	-	3,196,350,807	98,878,299
	DJ EUR 1909	710,736,728	-	743,492,712	32,755,984
	FTSE 1909	251,040,364	-	256,690,453	5,650,089
	SPI200 1909	205,130,475	-	210,701,081	5,570,606
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,530,500	-	1,525,000	5,500
	イスラエルシュケル	1,530,500	-	1,525,000	5,500
合計		4,265,910,575	-	4,408,760,053	142,860,478

## （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19日

至 令和 1年 9月17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18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,193,909,515円
同期中における追加設定元本額	9,729,660,960円
同期中における一部解約元本額	18,245,837,267円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	13,307,564,097円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	264,175,978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
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)	88,047,999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)	38,929,988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)	25,664,105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	495,608,000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	2,292,791,312円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	321,659,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	374,547,333円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	328,208,003円
イオン・バランス戦略ファンド	66,750,946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)	3,100,399円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,653,198円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	16,822,085円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	14,016,857円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	40,131,729円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,739,446円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,229,376,295円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	9,361,545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>	277,470,008円
S M A M ・ バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,801,742,634円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,639,347,501円
S M A M ・ バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,907,514,410円
S M A M ・ バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	21,665,789円
S M A M ・ 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



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 >	866,405,229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 >	63,322,997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 >	188,955,118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 >	839,861,789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 >	714,395,294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 >	1,784,766,652円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	2,126,892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 )	718,873,301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 )	987,929,595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 >	150,067,778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 >	78,822,498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 )	1,267,904,169円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	26,825,416円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	14,190,765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 >	6,986,832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 >	51,561,872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 >	123,124,057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 >	123,108,430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 >	1,304,117,644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 >	183,651,181円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	6,759,467,341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 >	369,452,547円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	3,103,743,780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 >	9,073,361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 >	111,024,727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 >	53,183,061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 >	132,134,455円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	14,580円
合計	52,677,733,208円

(令和1年9月17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	52,677,733,208円
同期中における追加設定元本額	15,400,963,679円
同期中における一部解約元本額	17,113,682,145円
令和1年9月17日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	15,900,793,442円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	324,051,175円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	1,278,490,969円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	835,733,670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)	79,730,718円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	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)	8,914,474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)	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	520,461,464円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	4,254,870,688円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	418,441,899円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	419,175,542円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	390,063,541円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,099,786円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,094,377円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,009,713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)	46,473,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	65,753,842円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	16,812,410円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,291円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,578,047,523円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	8,634,186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〉	73,969,974円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,538,560,440円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,460,709,925円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	6,139,461,309円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	20,735,530円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	103,934,006円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	416,205円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	721,059,973円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	60,844,158円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	171,173,908円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	770,537,138円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	637,137,232円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,547,704,635円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	807,485円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	302,639,714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)	177,699,618円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	132,466,704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)	68,601,362円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	22,834,055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〉	45,880,427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〉	54,031,036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〉	920,577,561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 >	143,279,352円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	6,025,032,914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 >	280,124,883円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	2,703,040,647円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	8,696,255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 >	45,189,709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 >	62,375,876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 >	99,546,999円
合計	50,965,014,742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	28.45	466,551.55	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,431	23.81	557,892.11	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	18.15	356,320.80	
	CHENIERE ENERGY INC	10,007	65.83	658,760.81	
	CHEVRON CORPORATION	84,367	124.12	10,471,632.04	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	53.77	219,381.60	
	CONCHO RESOURCES INC	8,637	76.15	657,707.55	
	CONOCOPHILLIPS	50,700	62.53	3,170,271.00	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	39.16	177,590.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	17,911	28.12	503,657.32	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,082	105.04	743,893.28	
	EOG RESOURCES INC	25,219	85.64	2,159,755.16	
	EXXON MOBIL CORPORATION	187,166	73.73	13,799,749.18	
	HALLIBURTON CO	37,453	22.49	842,317.97	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	47.40	193,392.00	
	HESS CORPORATION	12,828	70.29	901,680.12	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,365	53.78	396,089.70	
	KINDER MORGAN INC	89,794	20.67	1,856,041.98	
	MARATHON OIL CORP	36,817	14.17	521,696.89	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	30,123	52.41	1,578,746.43	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	23.39	394,074.72		
NOBLE ENERGY INC	20,924	25.23	527,912.52		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,105	47.80	1,821,419.00		
ONEOK INC	17,884	75.83	1,356,143.72		

PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	19.86	182,870.88
PHILLIPS 66	20,496	104.03	2,132,198.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,229	144.24	1,042,710.96
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	22.81	178,054.86
SCHLUMBERGER LTD	60,249	39.31	2,368,388.19
TARGA RESOURCES CORP	9,334	43.27	403,882.18
TECHNIPFMC PLC	18,187	25.76	468,497.12
VALERO ENERGY CORP	18,039	82.39	1,486,233.21
WILLIAMS COS INC	52,630	24.99	1,315,223.70
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,506	215.24	2,046,071.44
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	68.84	316,870.52
AMCOR PLC	69,886	9.67	675,797.62
AVERY DENNISON CORP	3,941	112.94	445,096.54
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,327	31.31	229,408.37
BALL CORPORATION	13,670	72.20	986,974.00
CELANESE CORPORATION	5,647	124.45	702,769.15
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	51.34	520,536.26
CORTEVA INC	33,348	29.40	980,431.20
CROWN HOLDINGS INC	5,272	63.08	332,557.76
DOW INC	32,241	49.01	1,580,131.41
DUPONT DE NEMOURS INC	33,826	72.14	2,440,207.64
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	74.29	442,471.24
ECOLAB INC	11,687	192.11	2,245,189.57
FMC CORPORATION	5,698	91.09	519,030.82
FREEMONT-MCMORAN INC	68,880	10.47	721,173.60
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	42.48	727,724.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	122.03	594,408.13
LINDE PLC	24,191	188.52	4,560,487.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,907	89.67	1,067,700.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	263.19	678,240.63
MOSAIC CO/THE	15,550	22.97	357,183.50
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	35,566	38.48	1,368,579.68
NUCOR CORP	13,218	53.16	702,668.88
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	105.87	428,350.02
PPG INDUSTRIES INC	10,300	115.36	1,188,208.00
SEALED AIR CORP	5,566	40.33	224,476.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,758	527.49	1,982,307.42
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	31.79	323,971.89
VULCAN MATERIALS CO	6,174	145.63	899,119.62
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	69.11	101,937.25
WESTROCK CO	11,330	37.92	429,633.60
3M COMPANY	25,702	169.67	4,360,858.34

ACUITY BRANDS INC	1,884	138.43	260,802.12
AERCAP HOLDINGS NV	5,590	55.59	310,748.10
ALLEGION PLC	3,946	102.13	403,004.98
AMETEK INC	9,623	90.86	874,345.78
ARCONIC INC	19,024	27.20	517,452.80
BOEING CO	23,693	378.85	8,976,093.05
CATERPILLAR INC	25,589	133.15	3,407,175.35
CUMMINS INC	6,358	163.70	1,040,804.60
DEERE & CO	13,578	164.59	2,234,803.02
DOVER CORP	6,165	99.25	611,876.25
EATON CORP PLC	19,224	86.46	1,662,107.04
EMERSON ELECTRIC CO	26,867	65.66	1,764,087.22
FASTENAL COMPANY	23,906	33.46	799,894.76
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	49.50	240,025.50
FLUOR CORP	5,677	21.91	124,383.07
FORTIVE CORP	13,068	69.50	908,226.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	53.45	344,752.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,088	190.97	2,117,475.36
GENERAL ELECTRIC CO	389,834	9.38	3,656,642.92
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	39.60	308,365.20
HEICO CORP	1,888	127.98	241,626.24
HEICO CORP-CLASS A	2,789	100.13	279,262.57
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,369	166.21	5,380,051.49
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	222.66	407,913.12
IDEX CORP	3,078	171.53	527,969.34
ILLINOIS TOOL WORKS	14,676	156.79	2,301,050.04
INGERSOLL-RAND PLC	10,301	123.93	1,276,602.93
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,934	92.67	549,903.78
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	10,700	56.17	601,019.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	32.36	294,476.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	36,243	43.71	1,584,181.53
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,528	214.00	2,038,992.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	234.81	362,077.02
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,349	392.66	4,456,298.34
MASCO CORP	13,282	42.72	567,407.04
MIDDLEBY CORP	2,315	120.15	278,147.25
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,250	371.43	2,692,867.50
OWENS CORNING	4,859	59.18	287,555.62
PACCAR INC	15,965	70.95	1,132,716.75
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,503	179.18	986,027.54
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	37.66	263,845.96
RAYTHEON COMPANY	12,594	204.06	2,569,931.64

ROCKWELL AUTOMATION INC	5,199	165.80	861,994.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,497	356.73	1,604,214.81
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	51.71	367,451.26
SMITH(A.O.) CORP	5,944	48.75	289,770.00
SNAP-ON INC	2,448	162.05	396,698.40
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	85.31	438,237.47
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,018	143.63	1,007,995.34
TEXTRON INC	10,639	52.60	559,611.40
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	523.54	1,057,550.80
UNITED RENTALS INC	3,677	128.35	471,942.95
UNITED TECHNOLOGIES CORP	36,478	138.08	5,036,882.24
WABCO HOLDINGS INC	2,109	134.20	283,027.80
WABTEC CORP	7,279	76.19	554,587.01
WW GRAINGER INC	1,980	295.81	585,703.80
XYLEM INC	7,965	78.06	621,747.90
CINTAS CORP	3,754	247.46	928,964.84
COPART INC	8,553	82.18	702,885.54
COSTAR GROUP INC	1,549	579.56	897,738.44
EQUIFAX INC	5,242	139.98	733,775.16
IHS MARKIT LTD	16,812	68.15	1,145,737.80
MANPOWERGROUP	2,036	86.56	176,236.16
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	22.65	342,830.40
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	84.89	825,215.69
ROBERT HALF INTL INC	4,666	57.12	266,521.92
ROLLINS INC	6,451	34.64	223,462.64
TRANSUNION	7,559	80.36	607,441.24
VERISK ANALYTICS INC	6,607	156.52	1,034,127.64
WASTE CONNECTIONS INC	11,199	88.47	990,775.53
WASTE MANAGEMENT INC	18,342	111.90	2,052,469.80
AMERCO	390	385.55	150,364.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	27.77	157,622.52
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	85.29	517,113.27
CSX CORPORATION	34,588	72.39	2,503,825.32
DELTA AIR LINES INC	7,251	59.07	428,316.57
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,504	75.39	565,726.56
FEDEX CORP	10,884	173.57	1,889,135.88
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	115.00	405,145.00
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	132.75	617,154.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	5,115	35.30	180,559.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,376	182.28	2,073,617.28
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	174.24	459,819.36
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	55.81	352,495.96

UBER TECHNOLOGIES INC	6,744	34.43	232,195.92
UNION PACIFIC CORP	31,496	168.95	5,321,249.20
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	88.76	255,628.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,151	122.57	3,818,178.07
XPO LOGISTICS INC	4,716	74.56	351,624.96
APTIV PLC	11,455	89.59	1,026,253.45
AUTOLIV INC	4,001	79.41	317,719.41
BORGWARNER INC	8,566	39.49	338,271.34
FORD MOTOR COMPANY	166,213	9.30	1,545,780.90
GENERAL MOTORS CO	56,262	37.21	2,093,509.02
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	36.14	265,520.58
LEAR CORP	2,531	124.03	313,919.93
TESLA INC	5,985	242.81	1,453,217.85
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	32.26	200,947.54
D.R.HORTON INC	15,658	49.03	767,711.74
GARMIN LTD	5,857	85.07	498,254.99
HANESBRANDS INC	13,181	15.63	206,019.03
HASBRO INC	5,156	119.07	613,924.92
LEGGETT & PLATT INC	5,036	41.87	210,857.32
LENNAR CORP-CL A	13,519	53.34	721,103.46
LULULEMON ATHLETICA INC	5,139	193.70	995,424.30
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	122.45	350,574.35
NEWELL BRANDS INC	18,477	18.28	337,759.56
NIKE INC -CL B	55,388	87.27	4,833,710.76
NVR INC	143	3,576.34	511,416.62
POLARIS INC	2,467	90.93	224,324.31
PULTE GROUP INC	13,065	35.20	459,888.00
PVH CORP	3,303	90.62	299,317.86
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	103.15	214,242.55
ROKU INC	3,613	149.54	540,288.02
TAPESTRY INC	11,987	25.51	305,788.37
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	21.11	182,263.74
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	19.02	157,694.82
VF CORP	14,995	88.42	1,325,857.90
WHIRLPOOL CORP	2,604	148.77	387,397.08
ARAMARK	10,783	42.90	462,590.70
CARNIVAL CORP	19,584	48.92	958,049.28
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,118	799.87	894,254.66
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	126.91	681,760.52
DOMINO'S PIZZA INC	1,661	244.79	406,596.19
H&R BLOCK INC	7,820	24.06	188,149.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,833	93.66	1,108,278.78

LAS VEGAS SANDS CORP	15,327	59.64	914,102.28
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,056	130.48	1,573,066.88
MCDONALD'S CORPORATION	33,891	207.40	7,028,993.40
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,525	21.57	248,594.25
MGM MIRAGE	22,498	29.69	667,965.62
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	53.34	487,260.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,767	113.93	884,894.31
STARBUCKS CORP	53,936	89.42	4,822,957.12
VAIL RESORTS INC	1,680	233.99	393,103.20
WYNN RESORTS LTD	4,252	116.60	495,783.20
YUM! BRANDS INC	13,431	110.54	1,484,662.74
ACTIVISION BLIZZARD INC	34,654	55.78	1,933,000.12
ALPHABET INC-CL A	13,239	1,231.63	16,305,549.57
ALPHABET INC-CL C	13,856	1,231.30	17,060,892.80
ALTICE USA INC-A	6,300	29.60	186,480.00
CBS CORP-CL B	14,639	44.05	644,847.95
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,060	423.25	2,988,145.00
COMCAST CORP-CLASS A	199,934	46.27	9,250,946.18
DISCOVERY INC-A	7,075	27.97	197,887.75
DISCOVERY INC-C	15,919	26.32	418,988.08
DISH NETWORK CORP.	9,780	36.08	352,862.40
ELECTRONIC ARTS INC	12,994	99.12	1,287,965.28
FACEBOOK INC-A	105,889	186.22	19,718,649.58
FOX CORPORATION-CLASS A	15,479	33.60	520,094.40
FOX CORPORATION-CLASS B	6,260	33.49	209,647.40
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	229.23	740,642.13
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	21.41	332,797.04
LIBERTY BROADBAND-C	4,599	108.50	498,991.50
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	28.04	236,433.28
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	27.08	570,819.32
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	41.85	358,570.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	41.88	320,298.24
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	41.53	171,975.73
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	69.23	419,879.95
NETFLIX INC	19,270	294.29	5,670,968.30
NEWS CORP-CLASS A	16,662	14.08	234,600.96
OMNICOM GROUP	9,445	78.97	745,871.65
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.37	434,765.24
SNAP INC-A	29,243	15.76	460,869.68
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	128.63	618,453.04
THE WALT DISNEY CO.	79,688	135.80	10,821,630.40
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	41.15	166,698.65



TWITTER INC	32,213	42.76	1,377,427.88
VIACOM INC-CLASS B	14,668	26.17	383,861.56
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	32.32	171,942.40
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	156.07	515,655.28
AMAZON.COM INC	18,444	1,807.84	33,343,800.96
AUTOZONE INC	1,086	1,130.66	1,227,896.76
BEST BUY COMPANY INC	10,543	68.91	726,518.13
BOOKING HOLDINGS INC	1,908	2,072.95	3,955,188.60
BURLINGTON STORES INC	3,144	192.27	604,496.88
CARMAX INC	7,453	84.26	627,989.78
DOLLAR GENERAL CORP	11,704	153.17	1,792,701.68
DOLLAR TREE INC	10,263	109.56	1,124,414.28
EBAY INC	35,266	40.30	1,421,219.80
EXPEDIA GROUP INC	6,177	131.28	810,916.56
GAP INC/THE	9,218	18.55	170,993.90
GENUINE PARTS CO	6,098	97.89	596,933.22
GRUBHUB INC	4,403	65.91	290,201.73
HOME DEPOT INC	48,709	230.99	11,251,291.91
KOHL'S CORP	6,991	53.13	371,431.83
L BRANDS INC	10,675	19.44	207,522.00
LKQ CORPORATION	13,945	32.06	447,076.70
LOWE'S COMPANIES INC	35,397	112.63	3,986,764.11
MACY'S INC	13,521	17.42	235,535.82
MERCADOLIBRE INC	2,047	554.05	1,134,140.35
NORDSTROM INC	4,756	35.57	169,170.92
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,483	380.44	1,325,072.52
QURATE RETAIL INC	18,982	11.88	225,506.16
ROSS STORES INC	16,129	107.59	1,735,319.11
TARGET CORP	22,041	106.96	2,357,505.36
TIFFANY & CO	4,643	96.40	447,585.20
TJX COMPANIES INC	53,447	55.43	2,962,567.21
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	95.66	504,893.48
ULTA BEAUTY INC	2,389	225.45	538,600.05
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	133.66	385,876.42
COSTCO WHOLESALE CORP	19,384	288.69	5,595,966.96
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	7.04	95,040.00
KROGER CO	35,553	25.98	923,666.94
SYSCO CORP	21,225	77.19	1,638,357.75
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,132	55.34	1,944,204.88
WALMART INC	63,182	115.57	7,301,943.74
ALTRIA GROUP INC	82,458	41.41	3,414,585.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,953	41.96	1,047,027.88

BROWN-FORMAN CORPORATION	13,617	64.18	873,939.06
BUNGE LIMITED	5,968	57.82	345,069.76
CAMPBELL SOUP CO	7,879	46.74	368,264.46
COCA-COLA CO/THE	179,471	53.96	9,684,255.16
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	10,371	55.00	570,405.00
CONAGRA BRANDS INC	20,188	30.44	614,522.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,370	203.84	1,502,300.80
GENERAL MILLS INC	26,391	54.54	1,439,365.14
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	42.83	532,933.69
INGREDION INC	3,320	83.27	276,456.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	107.18	526,682.52
KELLOGG CO	11,216	63.78	715,356.48
KRAFT HEINZ COMPANY	29,657	29.62	878,440.34
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	73.19	445,727.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,718	158.28	905,045.04
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	57.55	452,573.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	63,485	54.05	3,431,364.25
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,558	59.23	1,039,960.34
PEPSICO INC	61,783	134.88	8,333,291.04
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,570	72.60	4,978,182.00
THE HERSHEY COMPANY	6,652	148.04	984,762.08
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	86.34	1,089,610.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,852	72.38	785,467.76
CLOROX COMPANY	5,583	153.77	858,497.91
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	35,946	69.43	2,495,730.78
COTY INC-CL A	16,985	10.85	184,287.25
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,584	192.55	1,845,399.20
KIMBERLY-CLARK CORP	15,152	128.78	1,951,274.56
PROCTER & GAMBLE CO	110,551	119.75	13,238,482.25
ABBOTT LABORATORIES	78,355	83.36	6,531,672.80
ABIOMED INC	1,839	190.54	350,403.06
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,272	179.37	586,898.64
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	83.79	591,389.82
ANTHEM INC	11,534	258.58	2,982,461.72
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,943	86.92	1,907,285.56
BECTON DICKINSON & CO	12,080	258.73	3,125,458.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,503	41.94	2,621,375.82
CARDINAL HEALTH INC	12,873	48.91	629,618.43
CENTENE CORP	18,086	46.12	834,126.32
CERNER CORP	13,967	67.76	946,403.92
CIGNA CORPORATION	16,724	165.50	2,767,822.00
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	303.09	622,849.95

CVS HEALTH CORPORATION	58,043	63.43	3,681,667.49
DANAHER CORP	28,398	140.65	3,994,178.70
DAVITA INC	5,115	63.28	323,677.20
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	51.42	511,320.48
DEXCOM INC	3,778	148.68	561,713.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,953	215.09	1,925,700.77
HCA HEALTHCARE INC	11,901	128.95	1,534,633.95
HENRY SCHEIN INC	6,050	65.12	393,976.00
HOLOGIC INC	12,110	49.45	598,839.50
HUMANA INC.	5,930	278.28	1,650,200.40
IDEXX LABORATORIES INC	3,978	265.64	1,056,715.92
INTUITIVE SURGICAL INC	5,088	523.64	2,664,280.32
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	172.75	760,963.75
MCKESSON CORP	8,396	144.16	1,210,367.36
MEDTRONIC PLC	59,090	109.05	6,443,764.50
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	105.67	624,509.70
RESMED INC	5,931	130.71	775,241.01
STERIS PLC	3,642	144.33	525,649.86
STRYKER CORP	14,994	215.29	3,228,058.26
TELEFLEX INC	1,951	329.13	642,132.63
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,100	234.43	9,869,503.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	153.89	578,626.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	117.21	482,905.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,388	146.15	787,456.20
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,153	269.00	579,157.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,965	137.66	1,234,121.90
ABBVIE INC	65,890	70.58	4,650,516.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,676	77.15	1,055,103.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,529	108.54	1,034,277.66
ALKERMES PLC	6,413	22.83	146,408.79
ALLERGAN PLC	14,447	165.56	2,391,845.32
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,715	84.77	399,690.55
AMGEN INC	26,882	194.08	5,217,258.56
BEIGENE LTD-ADR	1,977	132.01	260,983.77
BIOGEN INC	8,367	236.12	1,975,616.04
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	74.21	557,762.36
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,092	49.47	3,566,391.24
CELGENE CORP	31,083	98.38	3,057,945.54
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,090	28.32	427,348.80
ELI LILLY & CO	38,509	110.13	4,240,996.17
EXACT SCIENCES CORP	5,415	104.41	565,380.15
GILEAD SCIENCES INC	56,788	65.88	3,741,193.44

ILLUMINA INC	6,253	300.89	1,881,465.17
INCYTE CORP	7,576	78.34	593,503.84
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,661	65.13	368,700.93
IQVIA HOLDINGS INC	7,239	150.84	1,091,930.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	134.01	348,962.04
JOHNSON & JOHNSON	117,405	129.54	15,208,643.70
MERCK & CO. INC.	114,087	82.03	9,358,556.61
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	711.65	791,354.80
MYLAN NV	22,501	21.80	490,521.80
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	21.22	149,261.48
PERKINELMER INC	4,774	86.23	411,662.02
PERRIGO CO PLC	5,561	56.70	315,308.70
PFIZER INC	246,027	36.83	9,061,174.41
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,737	285.89	1,068,370.93
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,159	87.02	274,896.18
SEATTLE GENETICS INC	4,290	71.11	305,061.90
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	52,347	8.04	420,869.88
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,629	295.33	5,206,372.57
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,111	177.55	1,972,758.05
WATERS CORP	3,079	231.52	712,850.08
ZOETIS INC	21,503	119.64	2,572,618.92
BANK OF AMERICA CORP	398,108	30.13	11,994,994.04
BB & T CORPORATION	33,757	52.92	1,786,420.44
CIT GROUP INC	4,770	46.83	223,379.10
CITIGROUP INC	101,919	69.83	7,117,003.77
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	36.96	744,448.32
COMERICA INC	7,145	66.50	475,142.50
EAST WEST BANCORP INC	6,233	45.95	286,406.35
FIFTH THIRD BANCORP	32,637	28.51	930,480.87
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,925	96.21	762,464.25
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	14.62	669,990.74
JPMORGAN CHASE & CO	142,974	119.16	17,036,781.84
KEYCORP	45,615	18.34	836,579.10
M & T BANK CORP	5,767	159.61	920,470.87
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	16.30	228,770.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,897	140.50	2,795,528.50
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,782	16.44	785,536.08
SIGNATURE BANK	2,508	121.91	305,750.28
SUNTRUST BANKS INC	19,640	68.34	1,342,197.60
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	221.36	516,432.88
US BANCORP	66,660	55.86	3,723,627.60
WELLS FARGO & COMPANY	188,178	48.98	9,216,958.44

ZIONS BANCORPORATION	8,874	45.18	400,927.32
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	88.40	199,076.80
ALLY FINANCIAL INC	17,783	34.77	618,314.91
AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,617	117.64	3,719,423.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,902	147.43	870,131.86
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	11,742	21.82	256,210.44
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	37,981	46.75	1,775,611.75
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	57,288	210.33	12,049,385.04
BLACKROCK INC	5,108	435.71	2,225,606.68
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,562	94.34	1,939,819.08
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	111.00	546,453.00
CME GROUP INC.	15,777	207.00	3,265,839.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,268	83.59	1,192,662.12
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	45.86	502,946.62
EATON VANCE CORP	5,530	46.35	256,315.50
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,596	277.41	442,746.36
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	29.73	400,433.37
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,511	217.22	3,152,079.42
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,852	91.88	2,283,401.76
INVESCO LIMITED	18,328	17.23	315,791.44
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	20.21	260,405.85
KKR & CO INC -A	22,146	28.25	625,624.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,661	334.35	555,355.35
MOODY'S CORP	7,497	213.33	1,599,335.01
MORGAN STANLEY	55,607	44.75	2,488,413.25
MSCI INC-A	3,805	230.00	875,150.00
NASDAQ INC	5,459	99.28	541,969.52
NORTHERN TRUST CORP	9,144	98.01	896,203.44
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	87.35	479,551.50
S&P GLOBAL INC	10,851	249.50	2,707,324.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,955	43.60	2,308,838.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	60.59	355,178.58
STATE STREET CORP	16,881	60.51	1,021,469.31
SYNCHRONY FINANCIAL	27,831	33.89	943,192.59
T ROWE PRICE GROUP INC	10,303	116.85	1,203,905.55
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	49.89	588,203.10
VOYA FINANCIAL INC	5,382	54.49	293,265.18
AFLAC INC	32,856	51.91	1,705,554.96
ALLEGHANY CORPORATION	635	764.27	485,311.45
ALLSTATE CORP	14,681	106.38	1,561,764.78
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	108.08	382,495.12
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,333	56.32	2,158,914.56

AON PLC	10,438	191.12	1,994,910.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	40.56	722,900.88
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	87.56	664,317.72
ASSURANT INC	3,114	125.60	391,118.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	42.83	260,534.89
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	39.82	169,553.56
CHUBB LTD	20,180	158.55	3,199,539.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,830	112.78	770,287.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	866	206.20	178,569.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	254.95	420,667.50
FNF GROUP	10,851	43.37	470,607.87
GLOBE LIFE INC	4,615	93.72	432,517.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	60.03	913,356.45
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	61.25	563,071.25
LOEWS CORPORATION	12,615	51.01	643,491.15
MARKEL CORP	577	1,175.58	678,309.66
MARSH & MCLENNAN COS	22,537	100.03	2,254,376.11
METLIFE INC	35,603	47.55	1,692,922.65
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	56.92	677,348.00
PROGRESSIVE CORP	25,738	73.40	1,889,169.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,894	89.10	1,594,355.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	158.70	479,591.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,757	185.48	325,888.36
TRAVELERS COS INC(THE)	11,489	146.34	1,681,300.26
UNUM GROUP	9,769	29.73	290,432.37
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,809	70.90	411,858.10
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	195.01	1,064,754.60
CBRE GROUP INC-A	14,101	54.12	763,146.12
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,682	137.96	2,577,368.72
EQUINIX INC	3,799	549.93	2,089,184.07
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.70	298,110.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	140.52	282,023.64
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	246.29	1,178,743.94
ACCENTURE PLC-CL A	28,376	194.16	5,509,484.16
ADOBE INC	21,687	282.93	6,135,902.91
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	89.43	661,245.42
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	132.95	295,414.90
ANSYS INC	3,662	212.13	776,820.06
AUTODESK INC	9,505	153.87	1,462,534.35
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,182	158.17	3,034,016.94
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	124.86	611,814.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	65.73	769,961.22

CDK GLOBAL INC	5,003	46.86	234,440.58
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,314	111.01	589,907.14
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	96.64	546,112.64
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,863	63.99	1,654,973.37
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,747	101.35	177,058.45
DOCUSIGN INC	5,401	61.88	334,213.88
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	20.40	215,526.00
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	33.25	393,480.50
EPAM SYSTEMS INC	2,408	180.95	435,727.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,045	133.06	3,598,607.70
FISERV INC	25,341	103.62	2,625,834.42
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	297.86	1,139,016.64
FORTINET INC	5,937	79.67	473,000.79
GARTNER INC	4,011	138.67	556,205.37
GLOBAL PAYMENTS INC	7,209	166.08	1,197,270.72
GODADDY INC - CLASS A	7,108	66.62	473,534.96
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,078	142.48	5,567,833.44
INTUIT INC	11,426	265.82	3,037,259.32
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	146.11	469,305.32
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	86.30	524,186.20
MASTERCARD INC-CL A	40,100	274.08	10,990,608.00
MICROSOFT CORP	321,210	136.33	43,790,559.30
MONGODB INC	1,890	132.00	249,480.00
OKTA INC	4,307	103.79	447,023.53
ORACLE CORPORATION	105,440	53.14	5,603,081.60
PALO ALTO NETWORKS INC	4,472	215.80	965,057.60
PAYCHEX INC	14,050	81.06	1,138,893.00
PAYCOM SOFTWARE INC	2,114	211.29	446,667.06
PAYPAL HOLDINGS INC	49,194	106.52	5,240,144.88
PTC INC	5,462	67.25	367,319.50
SABRE CORP	9,850	23.06	227,141.00
SALESFORCE.COM, INC.	36,647	153.01	5,607,357.47
SERVICENOW INC	8,338	261.15	2,177,468.70
SPLUNK INC	6,247	114.82	717,280.54
SQUARE INC-A	13,915	59.25	824,463.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	52.53	474,976.26
SYMANTEC CORPORATION	27,227	24.26	660,527.02
SYNOPSYS INC	6,366	133.24	848,205.84
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	134.56	966,006.24
TWILIO INC-A	4,977	110.65	550,705.05
VERISIGN INC	4,603	189.55	872,498.65
VISA INC	76,927	176.11	13,547,613.97

VMWARE INC	3,612	155.87	563,002.44
WESTERN UNION COMPANY	19,054	22.76	433,669.04
WIX.COM LTD	2,419	123.96	299,859.24
WORKDAY INC-CLASS A	7,428	173.00	1,285,044.00
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,101	95.05	1,245,250.05
APPLE INC	203,018	219.90	44,643,658.20
ARISTA NETWORKS INC	2,260	244.19	551,869.40
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	76.09	314,251.70
CDW CORP/DE	6,306	113.00	712,578.00
CISCO SYSTEMS INC	188,668	49.96	9,425,853.28
COGNEX CORP	7,187	49.85	358,271.95
CORNING INC	34,504	30.05	1,036,845.20
DELL TECHNOLOGIES INC-C	6,212	54.10	336,069.20
F5 NETWORKS INC	2,620	140.61	368,398.20
FLEX LTD	23,204	10.80	250,603.20
FLIR SYSTEMS INC	5,286	52.74	278,783.64
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	57,041	15.12	862,459.92
HP INC	65,227	18.87	1,230,833.49
IPG PHOTONICS CORP	1,776	145.46	258,336.96
JUNIPER NETWORKS INC	15,026	24.38	366,333.88
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,986	98.98	790,454.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,567	166.03	1,256,349.01
NETAPP INC	11,136	56.84	632,970.24
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	55.70	631,192.40
TE CONNECTIVITY LTD	14,855	95.10	1,412,710.50
TRIMBLE INC	10,356	39.65	410,615.40
WESTERN DIGITAL CORP	12,583	62.99	792,603.17
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	31.06	301,188.82
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,069	202.78	419,551.82
AT&T INC	322,982	37.31	12,050,458.42
CENTURYLINK INC	40,608	12.88	523,031.04
SPRINT CORP	36,740	6.84	251,301.60
T-MOBILE US INC	15,128	79.56	1,203,583.68
VERIZON COMMUNICATIONS INC	183,114	59.50	10,895,283.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	33.84	312,715.44
AES CORPORATION	27,194	16.00	435,104.00
ALLIANT ENERGY CORP	11,027	51.93	572,632.11
AMEREN CORPORATION	10,336	77.17	797,629.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,297	91.71	2,044,857.87
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,956	120.98	962,516.88
ATMOS ENERGY CORP	4,697	110.11	517,186.67
CENTERPOINT ENERGY INC	22,526	30.34	683,438.84



CMS ENERGY CORPORATION	13,327	61.46	819,077.42
CONSOLIDATED EDISON INC	14,198	89.93	1,276,826.14
DOMINION ENERGY INC	36,013	78.49	2,826,660.37
DTE ENERGY COMPANY	8,162	130.05	1,061,468.10
DUKE ENERGY CORP	32,620	93.12	3,037,574.40
EDISON INTERNATIONAL	16,210	71.48	1,158,690.80
ENERGY CORP	8,240	113.53	935,487.20
EVERGY INC	10,060	64.14	645,248.40
EVERSOURCE ENERGY	13,730	82.44	1,131,901.20
EXELON CORP	42,258	47.38	2,002,184.04
FIRSTENERGY CORP	24,493	47.56	1,164,887.08
NEXTERA ENERGY INC	21,338	218.31	4,658,298.78
NISOURCE INC	15,794	29.04	458,657.76
NRG ENERGY INC	11,952	39.03	466,486.56
OGE ENERGY CORP	9,056	44.37	401,814.72
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	93.49	478,668.80
PPL CORPORATION	32,318	31.13	1,006,059.34
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,499	60.80	1,307,139.20
SEMPRA ENERGY	11,656	141.75	1,652,238.00
SOUTHERN CO	46,695	59.86	2,795,162.70
UGI CORPORATION	8,894	50.33	447,635.02
VISTRA ENERGY CORP	13,852	26.56	367,909.12
WEC ENERGY GROUP INC	13,718	91.31	1,252,590.58
XCEL ENERGY INC	22,653	62.83	1,423,287.99
ADVANCED MICRO DEVICES	43,767	30.83	1,349,336.61
ANALOG DEVICES INC	15,993	115.26	1,843,353.18
APPLIED MATERIALS INC	42,255	50.92	2,151,624.60
BROADCOM INC	17,616	288.66	5,085,034.56
INTEL CORP	198,284	52.20	10,350,424.80
KLA CORPORATION	7,123	151.19	1,076,926.37
LAM RESEARCH CORP	6,386	234.94	1,500,326.84
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	25.40	682,675.80
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	59.00	685,698.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	94.45	955,550.65
MICRON TECHNOLOGY INC	49,789	50.15	2,496,918.35
NVIDIA CORP	25,772	180.21	4,644,372.12
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,622	107.57	1,357,748.54
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	19.99	348,525.65
QORVO INC	4,855	77.22	374,903.10
QUALCOMM INC	53,580	78.04	4,181,383.20
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	81.98	650,757.24
TEXAS INSTRUMENTS INC	41,350	128.36	5,307,686.00

	XILINX INC	11,291	104.39	1,178,667.49
	米ドル 小計	13,298,431		1,128,232,339.23 (122,074,739,104)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	12.69	207,912.96
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	52,785	37.97	2,004,246.45
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	13.93	577,161.69
	ENBRIDGE INC	90,637	46.63	4,226,403.31
	ENCANA CORP	66,377	7.35	487,870.95
	HUSKY ENERGY INC	14,553	10.07	146,548.71
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	36.31	471,993.69
	INTER PIPELINE LTD	18,081	24.73	447,143.13
	KEYERA CORP	8,467	33.58	284,321.86
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	48.96	1,062,480.96
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	19.29	174,343.02
	SUNCOR ENERGY INC	70,676	42.99	3,038,361.24
	TC ENERGY CORP	40,856	66.17	2,703,441.52
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	14.92	192,274.04
	VERMILION ENERGY INC	5,586	24.21	135,237.06
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	73.99	717,481.03
	BARRICK GOLD CORP	78,294	22.60	1,769,444.40
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,326	56.38	356,659.88
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	10.55	334,139.60
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	120.39	971,788.08
	KINROSS GOLD CORP	49,641	6.51	323,162.91
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,601	58.68	504,706.68
	LUNDIN MINING CORP	28,209	6.78	191,257.02
	METHANEX CORPORATION	2,452	52.24	128,092.48
	NUTRIEN LTD	25,633	68.64	1,759,449.12
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	24.84	616,379.76
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	51.33	147,471.09
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	35.41	693,256.98
	BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.86	141,084.72
	CAE INC	12,891	33.32	429,528.12
	SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	20.22	166,815.00
	WSP GLOBAL INC	4,524	75.67	342,331.08
	THOMSON REUTERS CORP	8,224	87.70	721,244.80
	AIR CANADA	5,737	41.81	239,863.97
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,333	121.01	3,912,616.33
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,320	306.64	1,937,964.80
	MAGNA INTERNATIONAL INC	13,220	71.32	942,850.40
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	48.08	435,893.28
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,165	94.66	962,218.90

STARS GROUP INC/THE	9,061	21.84	197,892.24
QUEBECOR INC -CL B	9,953	29.95	298,092.35
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.46	512,768.34
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	141.61	342,271.37
DOLLARAMA INC	14,542	46.73	679,547.66
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,017	79.98	1,520,979.66
EMPIRE CO LTD A	7,235	35.32	255,540.20
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	71.92	614,124.88
METRO INC	11,418	56.22	641,919.96
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	108.86	338,772.32
SAPUTO INC	10,333	39.96	412,906.68
AURORA CANNABIS INC	28,563	7.26	207,367.38
BAUSCH HEALTH COS INC	14,796	30.93	457,640.28
CANOPY GROWTH CORP	8,388	36.91	309,601.08
CRONOS GROUP INC	8,026	15.15	121,593.90
BANK OF MONTREAL	28,531	96.42	2,750,959.02
BANK OF NOVA SCOTIA	53,865	74.47	4,011,326.55
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,597	109.35	2,142,931.95
NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	64.63	951,030.45
ROYAL BANK OF CANADA	63,240	105.39	6,664,863.60
TORONTO-DOMINION BANK	80,584	75.27	6,065,557.68
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	37,259	69.93	2,605,521.87
CI FINANCIAL CORP	11,041	19.36	213,753.76
IGM FINANCIAL INC	3,023	38.03	114,964.69
ONEX CORPORATION	4,217	83.37	351,571.29
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	587.49	677,375.97
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	30.86	438,212.00
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	59.55	288,877.05
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	130.00	814,320.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	84,843	24.15	2,048,958.45
POWER CORP OF CANADA	14,595	29.32	427,925.40
POWER FINANCIAL CORP	11,076	30.37	336,378.12
SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	58.28	1,505,022.72
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.86	143,095.56
BLACKBERRY LIMITED	25,993	10.07	261,749.51
CGI INC-CL A	11,175	102.46	1,144,990.50
CONSTELLATION SOFTWARE	848	1,292.00	1,095,616.00
OPEN TEXT CORPORATION	11,689	54.13	632,725.57
SHOPIFY INC-CLASS A	4,334	447.48	1,939,378.32
BCE INC	6,928	62.95	436,117.60
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,858	66.83	1,126,620.14
TELUS CORPORATION	7,611	48.10	366,089.10

	ALTAGAS LTD	9,753	19.72	192,329.16
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	47.33	143,409.90
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	38.50	282,744.00
	EMERA INC	10,551	56.49	596,025.99
	FORTIS INC	17,754	55.35	982,683.90
	HYDRO ONE LTD	15,052	24.14	363,355.28
	カナダドル 小計	1,774,027		83,932,940.42 (6,859,839,220)
ユーロ	ENI SPA	111,408	14.31	1,594,694.11
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	13.59	328,387.22
	NESTE OYJ	17,995	28.22	507,818.90
	OMV AG	6,314	46.62	294,358.68
	REPSOL SA	61,510	14.13	869,443.85
	TENARIS S.A.	17,320	10.52	182,206.40
	TOTAL SA	106,337	47.81	5,084,503.65
	VOPAK	3,130	43.58	136,405.40
	AIR LIQUIDE SA	18,664	126.05	2,352,597.20
	AKZO NOBEL	9,650	80.78	779,527.00
	ARCELORMITTAL	29,275	15.23	446,033.90
	ARKEMA	3,250	86.80	282,100.00
	BASF SE	41,193	65.67	2,705,144.31
	COVESTRO AG	8,053	45.02	362,546.06
	CRH PLC	35,595	31.17	1,109,496.15
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,267	23.95	150,094.65
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	34.96	117,815.20
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	67.88	446,243.12
	IMERYS SA	1,384	38.78	53,671.52
	KONINKLIJKE DSM NV	8,398	108.35	909,923.30
	LANXESS	3,160	57.30	181,068.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,732	29.38	285,926.16
	SOLVAY SA	3,263	99.12	323,428.56
	STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	11.63	287,365.67
	SYMRISE AG	5,581	87.50	488,337.50
	THYSSENKRUPP AG	19,367	12.89	249,640.63
	UMICORE	8,730	33.71	294,288.30
	UPM-KYMMENE OYJ	24,603	27.08	666,249.24
	VOESTALPINE AG	5,079	23.41	118,899.39
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	35.87	403,429.89
	AIRBUS SE	26,091	121.24	3,163,272.84
	ALSTOM RGPT	6,452	37.72	243,369.44
	ANDRITZ AG	3,728	39.16	145,988.48
	BOUYGUES SA	11,049	35.46	391,797.54

BRENNTAG AG	6,629	47.31	313,617.99
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	10.15	438,289.80
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	35.47	754,305.02
DASSAULT AVIATION SA	89	1,340.00	119,260.00
EIFFAGE SA	3,580	94.10	336,878.00
FERROVIAL SA	23,114	25.51	589,638.14
GEA GROUP AG	8,178	26.77	218,925.06
HOCHTIEF AG	825	105.70	87,202.50
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	44.00	335,808.00
KION GROUP AG	3,179	49.40	157,042.60
KNORR-BREMSE AG	2,138	90.05	192,526.90
KONE OYJ-B	15,270	52.00	794,040.00
LEGRAND SA	11,488	66.00	758,208.00
LEONARDO SPA	18,310	11.67	213,677.70
METSO OYJ	3,963	38.46	152,416.98
MTU AERO ENGINES AG	2,065	238.20	491,883.00
PRYSMIAN SPA	11,926	21.00	250,446.00
SAFRAN SA	14,750	140.20	2,067,950.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,404	80.56	1,965,986.24
SIEMENS AG-REG	34,188	96.70	3,305,979.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	13.81	158,566.42
THALES SA	4,530	106.65	483,124.50
VINCI S.A.	22,212	97.08	2,156,340.96
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	11.65	220,219.95
BIC	1,337	62.25	83,228.25
BUREAU VERITAS SA	12,626	21.89	276,383.14
EDENRED	9,724	41.85	406,949.40
RANDSTAD NV	4,694	46.41	217,848.54
TELEPERFORMANCE	2,489	190.90	475,150.10
WOLTERS KLUWER-CVA	12,979	62.38	809,630.02
AENA SME SA	2,881	161.30	464,705.30
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	160.10	215,494.60
ATLANTIA SPA	20,671	20.44	422,515.24
BOLLORE	39,433	3.83	151,028.39
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	14.52	134,455.20
DEUTSCHE POST AG-REG	43,007	30.87	1,327,841.12
FRAPORT AG	1,856	74.86	138,940.16
GETLINK	16,953	13.44	227,848.32
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,395	65.10	937,114.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	51.90	130,165.20
CONTINENTAL AG	4,655	124.84	581,130.20
DAIMLER AG	41,046	48.05	1,972,260.30

FAURECIA	3,127	46.44	145,217.88
FERRARI NV	5,569	137.20	764,066.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	50,256	12.58	632,320.99
MICHELIN (CGDE)-B	7,374	103.00	759,522.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	27.42	151,001.94
PIRELLI & C SPA	17,484	5.70	99,658.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	6,624	61.46	407,111.04
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	23.95	625,597.95
RENAULT SA	8,830	57.11	504,281.30
VALEO SA	9,959	30.97	308,430.23
VOLKSWAGEN AG	1,256	161.05	202,278.80
VOLKSWAGEN AG PFD	8,203	157.56	1,292,464.68
ADIDAS AG	8,117	268.50	2,179,414.50
ESSILORLUXOTTICA	12,097	130.60	1,579,868.20
HERMES INTERNATIONAL	1,396	625.00	872,500.00
HUGO BOSS AG	2,376	53.22	126,450.72
KERING	3,440	463.25	1,593,580.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,355	367.10	4,535,520.50
MONCLER SPA	7,711	34.30	264,487.30
PUMA SE	3,830	66.45	254,503.50
SEB SA	1,032	143.20	147,782.40
ACCOR SA	7,551	38.85	293,356.35
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,636	84.38	306,805.68
SODEXO	3,900	100.10	390,390.00
AXEL SPRINGER SE-TEND	2,343	62.50	146,437.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	17.24	150,479.87
JC DECAUX SA	2,828	24.64	69,681.92
PUBLICIS GROUPE	9,116	45.63	415,963.08
RTL GROUP	1,615	45.92	74,160.80
SES	17,687	15.12	267,427.44
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	41.90	91,383.90
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	72.62	255,840.26
VIVENDI SA	40,395	25.08	1,013,106.60
DELIVERY HERO SE	5,334	43.26	230,748.84
INDITEX	47,526	26.56	1,262,290.56
ZALANDO SE	5,372	45.47	244,264.84
CARREFOUR SA	26,320	16.87	444,150.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	45.98	84,281.34
COLRUYT NV	2,472	48.17	119,076.24
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	15.71	194,504.55
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	50,349	22.61	1,138,390.89
METRO AG	8,344	14.68	122,531.64

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,587	86.98	2,921,397.26
DANONE	27,594	79.54	2,194,826.76
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	8.15	187,107.70
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	89.10	471,517.20
HEINEKEN NV	11,026	96.10	1,059,598.60
KERRY GROUP PLC-A	6,680	105.90	707,412.00
PERNOD-RICARD SA	9,359	162.30	1,518,965.70
REMY COINTREAU	1,273	127.20	161,925.60
BEIERSDORF AG	3,896	107.90	420,378.40
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	83.85	392,501.85
HENKEL AG & CO KGAA	7,849	92.96	729,643.04
L'OREAL	11,137	242.10	2,696,267.70
UNILEVER NV	64,498	53.96	3,480,312.08
BIOMERIEUX	1,779	70.00	124,530.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	99.35	225,425.15
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	63.12	579,504.72
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,963	45.42	815,879.46
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,031	43.12	1,769,256.72
SARTORIUS AG-VORZUG	1,333	168.20	224,210.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	35.32	232,546.88
BAYER AG	41,757	67.87	2,834,047.59
EUROFINS SCIENTIFIC	484	436.80	211,411.20
GRIFOLS S.A.	11,605	26.71	309,969.55
IPSEN	1,498	92.15	138,040.70
MERCK KGAA	5,705	99.50	567,647.50
ORION OYJ	4,259	32.80	139,695.20
QIAGEN N.V.	10,011	30.72	307,537.92
RECORDATI SPA	4,578	38.25	175,108.50
SANOFI	49,952	79.09	3,950,703.68
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	127.80	198,729.00
UCB SA	5,244	64.86	340,125.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	18.65	352,877.98
AIB GROUP PLC	36,918	2.71	100,195.45
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,783	4.79	1,403,894.48
BANCO DE SABADELL SA	235,029	0.89	210,821.01
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	752,940	3.76	2,835,572.04
BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	3.89	146,536.30
BANKIA SA	48,396	1.73	83,749.27
BANKINTER,S.A.	36,405	5.92	215,590.41
BNP PARIBAS	48,776	44.59	2,174,921.84
CAIXABANK	149,132	2.38	355,679.82

COMMERZBANK AG	46,644	5.86	273,753.63
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	11.36	563,206.08
ERSTE GROUP BANK AG	13,217	31.88	421,357.96
FINECOBANK SPA	24,027	9.76	234,599.62
ING GROEP NV-CVA	176,464	9.67	1,707,995.05
INTESA SANPAOLO	677,299	2.14	1,451,790.40
KBC GROUPE SA	10,878	60.34	656,378.52
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.55	255,982.35
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	21.68	119,348.40
SOCIETE GENERALE	33,369	25.72	858,250.68
UNICREDIT SPA	88,548	11.26	997,050.48
AMUNDI SA	2,379	62.10	147,735.90
DEUTSCHE BANK AG -REG	85,363	7.49	639,881.04
DEUTSCHE BOERSE AG	8,181	138.15	1,130,205.15
EURAZEO	1,792	64.05	114,777.60
EXOR NV	4,683	63.26	296,246.58
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	86.46	291,802.50
NATIXIS	45,362	3.74	169,971.41
PROSUS NV	21,567	70.49	1,520,257.83
WENDEL	1,082	122.80	132,869.60
AEGON NV	74,580	3.84	286,387.20
AGEAS	8,765	50.06	438,775.90
ALLIANZ SE-REG	18,926	210.30	3,980,137.80
ASSICURAZIONI GENERALI	45,785	17.37	795,514.37
AXA SA	85,469	22.59	1,930,744.71
CNP ASSURANCES	8,978	17.64	158,371.92
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,264	148.20	335,524.80
MAPFRE SA	46,367	2.51	116,705.73
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,340	227.20	1,440,448.00
NN GROUP NV	12,995	32.68	424,676.60
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.06	267,213.72
SAMPO OYJ-A SHS	19,253	38.13	734,116.89
SCOR SE	7,100	36.75	260,925.00
AROUNDTOWN SA	45,883	6.86	314,849.14
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,188	31.22	505,389.36
VONOVIA SE	21,475	42.02	902,379.50
ADYEN NV	435	620.40	269,874.00
AMADEUS IT GROUP SA	18,879	66.18	1,249,412.22
ATOS SE	4,547	65.48	297,737.56
CAPGEMINI SA	7,100	107.40	762,540.00
DASSAULT SYSTEMES SA	5,841	128.70	751,736.70
SAP SE	43,676	106.48	4,650,620.48



	WIRECARD AG	5,104	153.65	784,229.60
	WORLDLINE SA	2,851	58.40	166,498.40
	INGENICO S.A.	2,691	88.04	236,915.64
	NOKIA OYJ	257,686	4.64	1,196,178.41
	1&1 DRILLISCH AG	2,188	30.88	67,565.44
	CELLNEX TELECOM SA	8,175	36.30	296,752.50
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	149,423	15.13	2,261,068.83
	ELISA OYJ	5,909	46.12	272,523.08
	ILIAD SA	1,016	81.08	82,377.28
	KONINKLIJKE KPN NV	151,952	2.76	420,451.18
	ORANGE S.A.	86,822	13.91	1,207,694.02
	PROXIMUS SA	6,313	25.65	161,928.45
	TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.51	254,207.09
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.49	124,934.86
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.53	102,560.36
	TELEFONICA S.A.	212,730	6.79	1,445,074.89
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,439	34.47	187,482.33
	E.ON SE	98,030	8.91	873,937.45
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,876	3.43	343,373.68
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	10.45	299,410.29
	ENAGAS	10,471	20.31	212,666.01
	ENDESA S.A.	12,944	23.28	301,336.32
	ENEL SPA	365,450	6.48	2,368,846.90
	ENGIE	78,100	13.61	1,063,331.50
	FORTUM OYJ	20,170	21.04	424,376.80
	IBERDROLA SA	268,073	9.15	2,454,476.38
	INNOGY SE	5,851	44.85	262,417.35
	NATURGY ENERGY GROUP SA	12,414	23.21	288,128.94
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	18.00	372,726.00
	RWE AG	23,265	25.90	602,563.50
	SNAM SPA	89,624	4.44	398,109.80
	SUEZ	14,536	13.90	202,050.40
	TERNA SPA	53,035	5.59	296,571.72
	UNIPER SE	8,953	29.26	261,964.78
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,549	21.88	559,012.12
	VERBUND AG	3,268	51.55	168,465.40
	ASML HOLDING NV	18,760	223.85	4,199,426.00
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	55,385	18.51	1,025,397.89
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	18.02	505,457.05
	ユーロ 小計	8,852,052		173,830,398.21 (20,708,415,338)
英債券	BP PLC	902,443	5.24	4,734,215.97

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	191,855	23.31	4,472,140.05
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	165,078	23.22	3,833,936.55
WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	4.51	147,427.24
ANGLO AMERICAN PLC	44,819	19.36	867,875.11
ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.49	184,476.11
BHP GROUP PLC	94,631	18.24	1,726,258.70
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,978	48.02	239,043.56
EVRAZ PLC	28,275	5.18	146,464.50
FRESNILLO PLC	8,512	7.22	61,456.64
GLENCORE PLC	477,908	2.56	1,224,639.25
JOHNSON MATTHEY PLC	8,093	31.60	255,738.80
MONDI PLC	21,400	16.76	358,664.00
RIO TINTO PLC	50,993	43.32	2,209,271.72
ASHTED GROUP PLC	19,216	22.90	440,046.40
BAE SYSTEMS PLC	133,650	5.76	770,625.90
BUNZL PLC	13,431	21.28	285,811.68
DCC PLC	4,734	71.20	337,060.80
FERGUSON PLC	9,945	61.08	607,440.60
MEGGITT PLC	36,960	6.18	228,560.64
MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	2.06	438,339.96
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	75,547	8.05	608,606.63
SMITHS GROUP PLC	18,742	16.60	311,117.20
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	79.90	294,431.50
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	15.96	147,229.23
EXPERIAN PLC	39,187	24.42	956,946.54
G4S PLC	74,291	1.96	146,316.12
INTERTEK GROUP PLC	6,794	53.62	364,294.28
RELX PLC	85,982	18.33	1,576,050.06
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	4.31	390,912.98
EASYJET PLC	7,630	10.36	79,046.80
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	6.51	258,999.24
BURBERRY GROUP PLC	17,470	21.38	373,508.60
PERSIMMON PLC	13,916	21.01	292,375.16
TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.62	240,673.89
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	41.52	221,550.72
CARNIVAL PLC	8,091	37.75	305,435.25
COMPASS GROUP PLC	69,382	19.55	1,356,765.01
GVC HOLDINGS PLC	23,842	7.21	171,900.82
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,220	50.14	362,010.80
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	4.51	147,059.96
TUI AG-DI	17,636	8.82	155,620.06
WHITBREAD PLC	6,801	44.24	300,876.24

AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.15	216,657.05
INFORMA PLC	54,642	8.40	458,992.80
ITV PLC	151,064	1.25	189,132.12
PEARSON PLC	30,241	8.71	263,520.07
WPP PLC	57,596	10.16	585,463.34
KINGFISHER PLC	109,678	2.04	224,291.51
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.05	146,624.25
NEXT PLC	5,182	61.50	318,693.00
OCADO GROUP PLC	22,177	13.49	299,278.61
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.20	141,163.33
TESCO PLC	426,993	2.37	1,014,108.37
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.08	210,085.95
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	23.33	391,267.43
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	102,242	29.04	2,969,107.68
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	26.17	227,783.68
DIAGEO PLC	105,926	32.36	3,428,294.99
IMPERIAL BRANDS PLC	39,951	21.57	861,942.82
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	31,202	62.20	1,940,764.40
UNILEVER PLC	49,733	48.49	2,411,801.83
NMC HEALTH PLC	3,733	29.34	109,526.22
SMITH & NEPHEW PLC	37,643	18.82	708,441.26
ASTRAZENECA PLC	58,367	67.93	3,964,870.31
GLAXOSMITHKLINE PLC	219,831	16.27	3,577,090.03
BARCLAYS PLC	752,904	1.53	1,155,557.05
HSBC HOLDINGS PLC	898,530	6.18	5,558,306.58
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,204,167	0.54	1,734,095.18
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.07	433,578.31
STANDARD CHARTERED PLC	125,623	6.90	867,803.68
3I GROUP PLC	37,819	11.25	425,463.75
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	20.14	222,305.32
INVESTEC PLC	33,008	4.96	164,016.75
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,462	74.04	1,070,766.48
SCHRODERS PLC	6,213	31.47	195,523.11
ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	10.02	218,845.75
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.72	279,651.54
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	21.04	164,995.68
AVIVA PLC	183,084	3.94	722,266.38
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.99	189,740.42
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.52	630,073.66
PRUDENTIAL PLC	110,954	14.80	1,642,119.20
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.37	217,689.99
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	11.47	173,413.83

	SAGE GROUP PLC/THE	47,890	6.60	316,361.34
	HALMA PLC	16,787	19.46	326,758.95
	BT GROUP PLC	365,274	1.77	647,338.58
	VODAFONE GROUP PLC	1,196,001	1.59	1,902,359.19
	CENTRICA PLC	254,915	0.74	191,084.28
	NATIONAL GRID PLC	150,371	8.32	1,252,440.05
	SEVERN TRENT PLC	9,868	20.48	202,096.64
	SSE PLC	44,560	12.00	534,720.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	7.85	260,674.95
	英ポンド 小計	13,299,063		78,990,168.96 (10,612,329,199)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	20.33	205,353.33
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	620.00	199,020.00
	GIVAUDAN-REG	398	2,750.00	1,094,500.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	22,417	49.40	1,107,399.80
	SIKA AG	5,689	149.45	850,221.05
	ABB LTD	81,000	20.18	1,634,580.00
	GEBERIT AG-REG	1,593	475.80	757,949.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	674	223.60	150,706.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	225.70	383,915.70
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	56.70	397,977.30
	SGS SA	256	2,450.00	627,200.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	151.10	356,898.20
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,006	79.32	1,824,835.92
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	278.80	370,804.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	52.70	132,593.20
	DUFREY AG-REG	1,465	85.48	125,228.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,968.00	214,512.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	7,270.00	327,150.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	81,000.00	324,000.00
	NESTLE SA-REGISTERED	135,453	105.26	14,257,782.78
	ALCON INC	17,384	58.75	1,021,310.00
	SONOVA HOLDING AG	2,643	217.60	575,116.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	807.40	351,219.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	333.30	1,053,228.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	95,251	85.85	8,177,298.35
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	31,146	272.95	8,501,300.70
	VIFOR PHARMA AG	1,781	157.20	279,973.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	113,020	12.87	1,455,132.50
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	44.60	426,286.80
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	75.45	140,865.15
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	888	748.60	664,756.80

	UBS GROUP AG	166,641	11.51	1,918,871.11
	BALOISE HOLDING AG	1,987	174.00	345,738.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	483.80	712,153.60
	SWISS RE AG	13,742	102.20	1,404,432.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,803	380.10	2,585,820.30
	SWISS PRIME SITE-REG	3,252	95.20	309,590.40
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,827	164.00	463,628.00
	SWISSCOM AG-REG	1,115	489.00	545,235.00
	スイスフラン 小計	772,431		56,274,583.39 (6,137,306,064)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	326.70	2,232,667.80
	BOLIDEN AB	11,543	253.30	2,923,841.90
	ALFA LAVAL AB	13,939	198.00	2,759,922.00
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	215.30	9,350,479.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,698	316.10	9,387,537.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	17,203	281.40	4,840,924.20
	EPIROC AB-A	30,249	109.80	3,321,340.20
	EPIROC AB-B	16,107	105.10	1,692,845.70
	SANDVIK AB	51,127	161.00	8,231,447.00
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	187.25	2,941,884.75
	SKF AB-B SHARES	16,642	170.50	2,837,461.00
	VOLVO AB-B SHS	68,901	145.25	10,007,870.25
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	149.30	1,826,536.20
	ELECTROLUX AB-SER B	9,165	233.80	2,142,777.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	82.60	1,535,781.80
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	184.90	6,702,255.20
	ICA GRUPPEN AB	3,550	451.00	1,601,050.00
	SWEDISH MATCH AB	7,555	399.90	3,021,244.50
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,297	279.20	7,900,522.40
	NORDEA BANK ABP	149,513	70.40	10,525,715.20
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	70,758	90.86	6,429,071.88
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,140	95.12	6,576,596.80
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	141.30	5,514,939.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	217.60	1,363,481.60
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	467.30	9,296,933.50
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	271.30	3,054,024.10
LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	368.00	1,153,312.00	
ERICSSON LM-B SHS	135,412	77.08	10,437,556.96	
HEXAGON AB-B SHS	11,065	497.70	5,507,050.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	502.00	1,352,388.00	
TELE2 AB-B SHS	19,570	137.25	2,685,982.50	
TELIA CO AB	126,963	43.11	5,473,374.93	

	スウェーデンクローナ 小計	1,101,723		154,628,815.67 (1,731,842,735)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,392	274.50	1,480,104.00
	EQUINOR ASA	44,124	181.90	8,026,155.60
	NORSK HYDRO ASA	60,434	33.87	2,046,899.58
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	395.00	2,959,340.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,930	258.20	1,014,726.00
	MOWI ASA	19,167	206.00	3,948,402.00
	ORKLA ASA	33,915	78.40	2,658,936.00
	DNB ASA	41,449	160.55	6,654,636.95
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	180.05	1,992,433.30
	TELENOR ASA	31,294	182.15	5,700,202.10
	ノルウェークローネ 小計	258,263		36,481,835.53 (440,700,573)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,920	561.00	2,199,120.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	293.30	2,993,713.10
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,635	546.00	4,168,710.00
	ISS A/S	8,523	175.50	1,495,786.50
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	7,520.00	1,263,360.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	8,026.00	2,367,670.00
	DSV A/S	10,133	654.00	6,626,982.00
	PANDORA A/S	4,763	300.70	1,432,234.10
	CARLSBERG AS-B	4,678	980.00	4,584,440.00
	COLOPLAST-B	4,991	785.00	3,917,935.00
	DEMANT A/S	4,455	192.00	855,360.00
	GENMAB A/S	2,773	1,377.50	3,819,807.50
	H LUNDBECK A/S	2,896	235.10	680,849.60
	NOVO NORDISK A/S-B	78,260	334.00	26,138,840.00
	DANSKE BANK A/S	29,784	101.30	3,017,119.20
	TRYG A/S	5,005	195.70	979,478.50
ORSTED A/S	8,451	643.40	5,437,373.40	
	デンマーククローネ 小計	186,937		71,978,778.90 (1,148,061,523)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	25.32	338,933.52
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.73	470,509.64
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	7.92	590,729.04
	SANTOS LTD	79,098	7.75	613,009.50
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	22.21	99,478.59
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,965	32.70	1,339,555.50
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	13.91	186,171.44
	ALUMINA LTD	106,977	2.46	263,163.42
	BHP GROUP LTD	131,786	38.30	5,047,403.80

BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	12.63	291,614.07
BORAL LIMITED	42,214	4.86	205,160.04
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	9.01	631,610.01
INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.48	213,515.40
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	23.41	437,556.31
NEWCREST MINING LIMITED	32,675	34.60	1,130,555.00
ORICA LIMITED	17,981	22.62	406,730.22
RIO TINTO LIMITED	15,921	94.11	1,498,325.31
SOUTH32 LTD	223,474	2.81	627,961.94
CIMIC GROUP LTD	4,062	32.09	130,349.58
BRAMBLES LIMITED	67,439	11.19	754,642.41
SEEK LIMITED	18,186	20.97	381,360.42
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	5.81	504,796.04
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,311	30.55	712,151.05
CROWN RESORTS LTD	16,521	12.39	204,695.19
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	47.60	126,140.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	4.80	499,392.00
REA GROUP LTD	2,871	104.90	301,167.90
HARVEY NORMAN HOLDING-RIGHTS	1,208	1.80	2,174.40
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.49	92,238.07
WESFARMERS LIMITED	49,461	39.30	1,943,817.30
COLES GROUP LIMITED	46,407	14.75	684,503.25
WOOLWORTHS GROUP LTD	57,285	36.24	2,076,008.40
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	10.99	257,627.58
TREASURY WINE ESTATES LTD	30,285	18.38	556,638.30
COCHLEAR LIMITED	2,350	207.44	487,484.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	65.20	402,610.00
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	27.81	586,262.61
CSL LIMITED	19,992	230.38	4,605,756.96
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	121,522	27.60	3,354,007.20
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	9.88	176,367.88
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	11.39	225,988.99
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	78,929	81.69	6,447,710.01
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	126,447	29.13	3,683,401.11
WESTPAC BANKING CORPORATION	154,416	29.54	4,561,448.64
AMP LIMITED	129,763	1.83	237,466.29
ASX LTD	9,287	79.97	742,681.39
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	7.30	168,060.60
MACQUARIE GROUP LTD	14,246	129.43	1,843,859.78
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,442	50.68	225,120.56
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	7.94	801,955.88
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.37	433,799.88

	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	12.53	729,584.31	
	SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.78	721,699.94	
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,825	15.90	362,917.50	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.57	605,939.67	
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.91	122,707.78	
	AGL ENERGY LIMITED	28,043	18.87	529,171.41	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.75	149,561.10	
	オーストラリアドル 小計	2,998,893		55,825,248.13 (4,145,024,673)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,669	5.14	209,038.66	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	9.10	386,813.70	
	A2 MILK CO LTD	32,033	14.50	464,478.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,343	16.67	405,797.81	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,236	13.08	199,286.88	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.46	392,020.62	
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,184	5.08	295,574.72	
	ニュージーランドドル 小計	300,869		2,353,010.89 (161,487,137)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	114,924	71.50	8,217,066.00	
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	13.70	952,150.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	57.70	3,231,200.00	
	MTR CORPORATION	67,000	46.80	3,135,600.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	21.45	579,150.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	93,000	52.75	4,905,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	12.84	564,960.00	
	SANDS CHINA LTD	96,800	38.00	3,678,400.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	8.26	528,640.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.75	620,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	16.60	1,175,280.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	37.65	1,581,300.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	7.48	2,973,300.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	20.40	1,077,528.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	28.50	4,474,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	33,100	177.40	5,871,940.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,800	235.00	12,173,000.00	
	AIA GROUP LTD	536,400	79.65	42,724,260.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	118,924	56.50	6,719,206.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.18	1,781,640.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,384	38.35	2,430,776.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	31.50	913,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	25.40	698,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	10.20	2,665,596.60		



	SINO LAND CO	124,200	11.88	1,475,496.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	115.50	8,085,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	77.45	2,091,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	26.10	1,383,300.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	17.28	1,019,520.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	44.20	2,121,600.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	46.25	1,526,250.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.41	855,540.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	53.40	1,602,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	76,100	81.10	6,171,710.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.67	851,370.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	437,014	15.70	6,861,119.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	53.45	3,207,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	97.85	1,203,555.00	
	香港ドル 小計	3,986,399		152,127,853.80 (2,105,449,496)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	6.25	436,875.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.21	96,621.20	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.94	269,102.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.08	97,200.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.46	287,082.00	
	SATS LTD	26,800	4.85	129,980.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.15	229,353.90	
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	0.90	252,630.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	2.05	141,552.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	31.54	148,238.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.27	97,240.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.87	270,513.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	25.47	1,958,643.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	147,000	11.08	1,628,760.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,100	26.34	1,504,014.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	8.53	303,668.00	
	CAPITALAND LTD	104,500	3.60	376,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	9.87	158,907.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.51	162,967.00	
	VENTURE CORP LTD	11,900	15.93	189,567.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	350,615	3.21	1,125,474.15	
	シンガポールドル 小計	2,039,851		9,864,587.75 (776,047,118)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	17.24	494,977.64	
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	561.80	452,249.00	
	BANK HAPUALIM BM	44,062	26.45	1,165,439.90	

BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	24.45	1,603,284.30
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	14.55	795,506.70
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	81.46	443,305.32
AZRIELI GROUP	2,140	247.00	528,580.00
NICE LTD	2,768	520.10	1,439,636.80
イスラエルシュケル 小計	204,176		6,922,979.66 (211,220,109)
合 計	49,073,115		177,112,462,289 (177,112,462,289)

(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	65.6%	68.9%
カナダドル	株式 87銘柄	3.7%	3.9%
ユーロ	株式 241銘柄	11.1%	11.7%
英ポンド	株式 94銘柄	5.7%	6.0%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.3%	3.5%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	0.9%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシュケル	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	401,316.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,988	763,962.08	
		AMERICAN TOWER CORP	19,713	4,273,187.01	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	65,636	569,720.48	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,292,984.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,984	922,097.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	464,414.16	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,949	1,131,064.11	
		DUKE REALTY CORP	17,391	572,685.63	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,765	497,431.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,404	1,395,160.20	

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,824	915,823.20	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	633,033.60	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	434,014.88	
	HCP, INC.	20,162	687,524.20	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	558,303.88	
	INVITATION HOMES INC	19,405	547,026.95	
	IRON MOUNTAIN INC	12,165	392,686.20	
	KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	422,010.90	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	353,288.88	
	MACERICH COMPANY/THE	3,806	126,853.98	
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	609,437.54	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	344,346.72	
	PROLOGIS INC	28,402	2,420,418.44	
	PUBLIC STORAGE	6,909	1,708,941.15	
	REALTY INCOME CORPORATION	13,440	994,156.80	
	REGENCY CENTERS CORP	7,994	545,430.62	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,474	2,080,250.86	
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	323,411.10	
	SUN COMMUNITIES INC	3,889	571,916.34	
	UDR INC	12,978	625,150.26	
	VENTAS INC	16,491	1,168,552.26	
	VEREIT INC	44,740	435,767.60	
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	485,907.73	
	WELLTOWER INC	17,248	1,499,368.64	
	WEYERHAEUSER CO	34,656	956,159.04	
	WP CAREY INC	7,258	636,962.08	
	米ドル 小計	536,891	32,760,767.80 (3,544,715,075)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	85,680.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	193,466.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	114,648.30	
	カナダドル 小計	14,851	393,794.30 (32,184,808)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	224,472.00	
	GECINA SA	1,738	242,972.40	
	ICADE	1,265	100,188.00	
	KLEPIERRE	9,305	278,126.45	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	6,096	788,517.60	
	ユーロ 小計	20,792	1,634,276.45	

				(194,691,353)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC		44,962	249,449.17
	LAND SECURITIES GROUP PLC		32,703	268,360.81
	SEGRO PLC		40,873	312,351.46
英ポンド 小計			118,538	830,161.44 (111,532,189)
オーストラリアドル	APA GROUP		48,738	540,991.80
	DEXUS		44,028	537,141.60
	GOODMAN GROUP		75,399	1,021,656.45
	GPT GROUP		97,296	589,613.76
	LENLEASE GROUP		25,262	433,243.30
	MIRVAC GROUP		144,537	439,392.48
	SCENTRE GROUP		234,290	934,817.10
	STOCKLAND		103,417	456,068.97
	SYDNEY AIRPORT		49,760	393,601.60
	TRANSURBAN GROUP		115,217	1,633,777.06
	VICINITY CENTRES		146,656	378,372.48
オーストラリアドル 小計			1,084,600	7,358,676.60 (546,381,737)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD		170,000	2,196,400.00
	LINK REIT		92,500	8,223,250.00
香港ドル 小計			262,500	10,419,650.00 (144,207,956)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		118,300	367,913.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,400	277,752.00
	CAPITALAND MALL TRUST		102,800	269,336.00
	SUNTEC REIT		64,600	124,678.00
シンガポールドル 小計			416,100	1,039,679.00 (81,791,546)
合計				4,655,504,664 (4,655,504,664)

(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%	76.1%
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%	4.2%
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%	11.7%
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18日現在）	（令和 1年 9月17日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	16,839,875	142,188,706
コール・ローン	1,602,494,959	2,856,506,975
株式	1,925,299,382	3,474,980,355
投資信託受益証券	120,711,654	329,408,042
投資証券	10,288,784	113,784,531
派生商品評価勘定	12,146,017	178
未収入金	47,497	28,500,204
未収配当金	4,051,632	5,796,868
前払金	9,329,418	24,928,739
差入委託証拠金	386,304,953	630,230,016
流動資産合計	4,087,514,171	7,606,324,614
資産合計	4,087,514,171	7,606,324,614
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,329,516	27,241,957
未払金	28,716	36,904,761
未払解約金	2,000,000	23,370,000
未払利息	4,511	8,219
その他未払費用	5,880	47,671
流動負債合計	11,368,623	87,572,608
負債合計	11,368,623	87,572,608
純資産の部		
元本等		
元本	3,133,325,803	5,806,463,130
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	942,819,745	1,712,288,876
元本等合計	4,076,145,548	7,518,752,006
純資産合計	4,076,145,548	7,518,752,006
負債純資産合計	4,087,514,171	7,606,324,614

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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	(平成30年 9月18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,133,325,803口	5,806,463,130口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3009円 (10,000口当たりの純資産額 13,009円)	1口当たり純資産額 1.2949円 (10,000口当たりの純資産額 12,949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19日 至 令和 1年 9月17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17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18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,031,629,589	-	2,022,300,171	9,329,418
	MSCIE 1812	2,031,629,589	-	2,022,300,171	9,329,418
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,606,714,806	-	1,618,860,563	12,145,757
	米ドル	1,606,714,806	-	1,618,860,563	12,145,757
	売建	14,806	-	14,644	162
	ポーランドズロチ	5,477	-	5,463	14
	南アフリカランド	9,329	-	9,181	148
合計		3,638,359,201	-	3,641,175,378	2,816,501

(令和 1年 9月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		



市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,634,680,368	-	3,609,751,629	24,928,739
	MSCIE 1912	3,634,680,368	-	3,609,751,629	24,928,739
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,827,765,019	-	2,825,451,808	2,313,211
	米ドル	2,827,765,019	-	2,825,451,808	2,313,211
	売建	65,019	-	64,848	171
	メキシコペソ	47,560	-	47,389	171
	香港ドル	17,459	-	17,459	-
合計		6,462,510,406	-	6,435,268,285	27,241,779

## (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19日

至 令和 1年 9月17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18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,841,907,685円
同期中における追加設定元本額	3,769,857,080円
同期中における一部解約元本額	3,478,438,962円
平成30年 9月18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	787,579,596円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,177,336,085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)	449,200,392円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,442,121円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,894,371円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,156,052円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	13,440,044円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	15,067,718円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	60,808,108円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,302,914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>	20,129,825円
合計	3,133,325,803円

(令和 1年 9月17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	3,133,325,803円
同期中における追加設定元本額	4,472,595,666円
同期中における一部解約元本額	1,799,458,339円
令和 1年 9月17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	1,687,374,007円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,597,434,949円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	746,865,248円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	759,068,943円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	710,074,865円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,803,145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)	99,400,266円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,889,911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	5,806,463,130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	0.95	6,466.80	
	TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	406	8.30	3,369.80	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,176	8.97	10,548.72	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	1,413	14.50	20,488.50	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	557	35.14	19,572.98	
	51JOB INC-ADR	189	73.27	13,848.03	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,178	20.92	45,563.76	
	NIO INC-ADR	4,302	3.12	13,422.24	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	868	36.14	31,369.52	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	933	110.11	102,732.63	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	2,526	35.00	88,410.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,355	46.53	109,578.15	
	58.COM INC-ADR	619	56.55	35,004.45	
	AUTOHOME INC-ADR	388	93.87	36,421.56	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,822	110.98	202,205.56	
	IQIYI INC-ADR	796	18.84	14,996.64	
	MOMO INC-SPON ADR	934	35.50	33,157.00	
	NETEASE.COM INC -ADR	459	270.38	124,104.42	
	SINA CORP	401	45.05	18,065.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	483	13.91	6,718.53	
	WEIBO CORP-SPON ADR	349	49.79	17,376.71	
	YY INC-ADR	369	61.66	22,752.54	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	9,320	177.07	1,650,292.40	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	263	48.44	12,739.72	
	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	2,721	35.63	96,949.23	
	JD.COM INC-ADR	4,836	30.85	149,190.60	
	PINDUODUO INC-ADR	1,266	34.73	43,968.18	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	2,866	9.45	27,083.70	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	475	20.46	9,718.50	
	BANCO MACRO SA-ADR	320	25.25	8,080.00	
	BBVA ARGENTINA SA-ADR	373	4.35	1,622.55	
	CREDICORP LTD	444	216.61	96,174.84	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	709	11.83	8,387.47	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	231	31.38	7,248.78		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	1.18	8,368.56		
GDS HOLDINGS LTD-ADR	387	42.37	16,397.19		
GLOBANT SA	226	88.78	20,064.28		

	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	544	9.78	5,320.32
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	433	16.25	7,036.25
	米ドル 小計	62,817		3,144,816.16 (340,269,108)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	99,200	7.62	755,904.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	23,000	45.65	1,049,950.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	740	249.47	184,607.80
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	5,600	39.07	218,792.00
	ALFA S.A.B. -A	22,000	17.31	380,820.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	58.27	209,772.00
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,485	299.13	444,208.05
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	2,500	187.60	469,000.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,750	176.78	309,365.00
	ALSEA SAB DE CV	3,800	44.95	170,810.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	15,800	37.76	596,608.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	1,584	77.70	123,076.80
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	1,600	110.24	176,384.00
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	34,300	57.67	1,978,081.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,900	106.04	307,516.00
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	3,400	118.76	403,784.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	12,700	181.87	2,309,749.00
	GRUMA S.A.B. -B	1,130	204.51	231,096.30
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	10,700	36.73	393,011.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	38.79	387,900.00
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	17,000	107.13	1,821,210.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	15,000	25.72	385,800.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	220,600	14.28	3,150,168.00	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	2,900	82.23	238,467.00	
	メキシコペソ 小計	513,289		16,696,079.95 (92,997,165)
ブラジルリアル	COSAN SA	900	54.57	49,113.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	19,500	31.00	604,500.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	27,500	28.06	771,650.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	4,700	18.20	85,540.00
	BRASKEM SA-PREF A	900	29.63	26,667.00
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	3,300	14.38	47,454.00
	GERDAU S.A.-PREF	7,100	13.50	95,850.00
	SUZANO SA	3,615	34.28	123,922.20
	VALE SA	20,800	48.59	1,010,672.00
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	5,000	19.43	97,150.00
	WEG SA	5,830	23.24	135,489.20
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	8,400	16.66	139,944.00

LOCALIZA RENT A CAR SA	4,000	44.24	176,960.00	
RUMO SA	7,500	23.02	172,650.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	10,400	11.22	116,688.00	
B2W CIA DIGITAL	1,561	42.78	66,779.58	
LOJAS AMERICANAS SA	5,300	18.68	99,004.00	
LOJAS RENNER S.A.	5,380	48.70	262,006.00	
MAGAZINE LUIZA SA	4,100	34.87	142,967.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	4,800	27.53	132,144.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	2,100	21.14	44,394.00	
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	1,000	86.90	86,900.00	
RAIA DROGASIL SA	1,500	92.63	138,945.00	
AMBEV SA	30,900	19.15	591,735.00	
BRF-BRASIL FOODS SA	3,700	38.10	140,970.00	
JBS SA	7,200	29.74	214,128.00	
M DIAS BRANCO SA	400	35.60	14,240.00	
NATURA COSMETICOS SA	1,300	71.50	92,950.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	2,400	54.55	130,920.00	
HYPERMARCAS SA	2,700	32.60	88,020.00	
BANCO BRADESCO S.A.-PREF	26,384	33.02	871,199.68	
BANCO BRADESCO SA	7,908	30.70	242,775.60	
BANCO DO BRASIL S.A.	5,600	46.65	261,240.00	
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	31,800	35.23	1,120,314.00	
ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	28,980	13.12	380,217.60	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,400	54.45	76,230.00	
BM&F BOVESPA SA	13,500	43.07	581,445.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	4,600	33.43	153,778.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,500	107.00	160,500.00	
PORTO SEGURO SA	600	56.39	33,834.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	4,400	13.34	58,696.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	1,500	26.33	39,495.00	
CIELO SA	6,500	8.10	52,650.00	
TELEFONICA BRASIL SA	2,900	52.50	152,250.00	
TIM PARTICIPACOES SA	5,600	11.96	66,976.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	1,200	43.88	52,656.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	1,600	45.42	72,672.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	6,000	14.11	84,660.00	
COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	2,200	50.65	111,430.00	
ENERGISA SA-UNITS	1,100	48.59	53,449.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,350	44.42	59,967.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,100	100.50	110,550.00	
ブラジルリアル 小計	361,508		10,697,336.86	(283,586,400)

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,630	7,200.00	18,936,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	5,931	1,809.00	10,729,179.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	661	19,969.00	13,199,509.00	
	LATAM AIRLINES GROUP	1,729	6,530.00	11,290,370.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	5,234	4,170.00	21,825,780.00	
	CENCOSUD SA	8,340	1,221.90	10,190,646.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	883	8,255.00	7,289,165.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,886	2,270.00	4,281,220.00	
	BANCO DE CHILE	297,936	104.99	31,280,300.64	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	353	46,800.00	16,520,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	432,287	52.21	22,569,704.27	
	ITAU CORPBANCA	1,230,978	5.72	7,041,194.16	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,200	6,650.00	7,980,000.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	20,335	403.00	8,195,005.00	
	COLBUN SA	61,705	139.00	8,576,995.00	
ENEL AMERICAS SA	260,174	129.00	33,562,446.00		
ENEL CHILE SA	161,886	65.10	10,538,778.60		
チリペソ 小計		2,494,148		244,006,692.67	(37,211,020)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	34,192	3,000.00	102,576,000.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	3,792	7,570.00	28,705,440.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,250	17,980.00	40,455,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,342	39,900.00	53,545,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,101	43,000.00	133,343,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	20,785	1,285.00	26,708,725.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,345	34,100.00	45,864,500.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	414	31,460.00	13,024,440.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,245	20,100.00	65,224,500.00	
コロンビアペソ 小計		70,466		509,447,405.00	(16,404,206)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	344	21.52	7,402.88	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	334	19.00	6,346.00	
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	
	OPAP SA	1,325	9.95	13,183.75	
	JUMBO S.A.	663	17.60	11,668.80	
	ALPHA BANK AE	9,474	1.71	16,285.80	
	EUROBANK ERGASIAS SA	19,175	0.83	16,011.12	
	NATIONAL BANK OF GREECE	4,254	2.61	11,115.70	
	PROSUS NV-NEW	2,883	70.49	203,222.67	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,414	12.58	17,788.12	
ユーロ 小計		39,989		303,615.24	(36,169,683)

トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	717	136.90	98,157.30
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,241	7.00	57,687.00
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,111	20.10	42,431.10
	KOC HOLDING AS	4,446	18.72	83,229.12
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	2,885	4.56	13,155.60
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	599	23.28	13,944.72
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	11.86	53,049.78
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	62.00	15,934.00
	ARCELIK AS	866	18.01	15,596.66
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,989	49.46	147,835.94
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	23.90	18,140.10
	AKBANK T.A.S.	20,175	7.50	151,312.50
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,240	9.47	153,792.80
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	6.28	60,796.68
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,157	9.33	66,774.81
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	6,378	13.24	84,444.72	
トルコリラ 小計		87,974		1,076,282.83 (20,341,745)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	547	846.50	463,035.50
	MONETA MONEY BANK AS	2,580	74.85	193,113.00
	CEZ AS	1,135	525.00	595,875.00
チェココルナ 小計		4,262		1,252,023.50 (5,771,828)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	2,859	2,976.00	8,508,384.00
	RICHTER GEDEON NYRT	743	4,920.00	3,655,560.00
	OTP BANK PLC	1,495	12,760.00	19,076,200.00
ハンガリーフォリント 小計		5,097		31,240,144.00 (11,205,839)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	546	85.06	46,442.76
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,037	94.00	191,478.00
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	9,982	5.09	50,858.29
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	194	28.86	5,598.84
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	797	83.14	66,262.58
	CCC SA	106	132.70	14,066.20
	LPP SA	9	8,270.00	74,430.00
	CD PROJEKT SA	469	250.60	117,531.40
	CYFROWY POLSAT SA	1,573	27.98	44,012.54
	DINO POLSKA SA	366	155.00	56,730.00
	ALIOR BANK SA	331	43.34	14,345.54
	BANK MILLENNIUM SA	4,887	6.58	32,156.46
	BANK PEKAO SA	1,187	107.00	127,009.00
MBANK SA	79	329.00	25,991.00	

	PKO BANK POLSKI SA	5,905	41.75	246,533.75	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	253	318.40	80,555.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,138	38.22	158,154.36	
	ORANGE POLSKA SA	4,301	5.91	25,418.91	
	PGE SA	4,933	8.50	41,940.36	
	ポーランドズロチ 小計	42,093		1,419,515.19	(39,050,862)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	11,000	3.31	36,410.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	10,000	9.83	98,300.00	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	170,000	5.04	856,800.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	23,000	16.70	384,100.00	
	CNOOC LTD	117,000	12.78	1,495,260.00	
	PETROCHINA CO LTD	138,000	4.32	596,160.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	10,000	8.69	86,900.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	20,000	2.76	55,200.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	5,200	3.20	16,640.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	8,500	47.90	407,150.00	
	BBMG CORPORATION - H	9,000	2.42	21,780.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	5.34	61,410.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	21,000	2.74	57,540.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	28,000	7.39	206,920.00	
	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	4,000	3.28	13,120.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	18,000	8.23	148,140.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	8,800	3.35	29,480.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	7,000	9.69	67,830.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	4.64	27,840.00	
	MAANSHAN IRON&STEEL-H	6,000	2.97	17,820.00	
	MMG LIMITED	12,000	2.15	25,800.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	9,000	6.95	62,550.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	2.48	44,640.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	5,500	9.35	51,425.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	42,000	2.93	123,060.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	13,000	4.26	55,380.00	
	BOC AVIATION LTD	1,300	75.60	98,280.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	31,000	6.48	200,880.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	12,000	4.77	57,240.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	11,000	28.80	316,800.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	28,000	5.26	147,280.00	
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	14,500	9.33	135,285.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	12,000	8.05	96,600.00	
	CITIC LIMITED	40,000	10.10	404,000.00	
	CRRC CORP LTD-H	31,000	5.81	180,110.00	



FOSUN INTERNATIONAL	18,000	10.54	189,720.00
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	16.96	67,840.00
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	1.86	20,460.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	10,000	2.62	26,200.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	16.06	32,120.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	7,500	5.25	39,375.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	3,500	11.78	41,230.00
WEICHAJ POWER CO	14,000	12.60	176,400.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	9.98	66,047.64
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	4,000	33.80	135,200.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	26,000	6.17	160,420.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	8,000	22.55	180,400.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	10,000	7.70	77,000.00
AIR CHINA/HONG KONG	10,000	7.23	72,300.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	10,000	7.02	70,200.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	22,000	3.06	67,320.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	6,000	4.02	24,120.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	10,140	12.68	128,575.20
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	4.30	34,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	4.94	39,520.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	10,000	6.56	65,600.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	10.66	106,600.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	5,500	14.88	81,840.00
SINOTRANS LIMITED	8,000	2.60	20,800.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	7.01	84,120.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	6,500	5.09	33,085.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	22,000	9.51	209,220.00
BYD CO LTD-H	4,500	42.35	190,575.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	18,000	2.62	47,160.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	20,000	8.40	168,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,800	23.35	65,380.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	34,000	13.68	465,120.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	16,500	5.68	93,720.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	21,200	8.46	179,352.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	5,000	6.86	34,300.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	7,000	62.25	435,750.00
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	26,000	3.24	84,240.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	9,000	20.90	188,100.00
LI NING COMPANY LIMITED	13,500	22.10	298,350.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	5,000	110.00	550,000.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	3,000	11.00	33,000.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	36.00	108,000.00

ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	1.34	147,400.00
CHINA LITERATURE LTD	1,400	26.90	37,660.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	37,500	346.60	12,997,500.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.73	28,470.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	120,000	0.13	15,720.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	6,800	72.30	491,640.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	3,000	25.70	77,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	17,500	8.20	143,500.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	11,000	2.30	25,300.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	18,000	30.15	542,700.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	10,000	42.75	427,500.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	11,000	5.31	58,410.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	11.24	157,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	49.15	98,300.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	8,000	8.60	68,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	33,000	6.44	212,520.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	48.30	144,900.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	4,500	52.80	237,600.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	24,000	7.13	171,120.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	12,000	8.55	102,600.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	4,600	15.00	69,000.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	8,400	27.45	230,580.00
3SBIO INC	7,000	12.88	90,160.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	10,000	8.93	89,300.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	32,000	15.50	496,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	7.97	95,640.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	12,000	3.92	47,040.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	17.22	103,320.00
LUYE PHARMA GROUP	9,500	6.18	58,710.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	3,000	23.40	70,200.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	14,000	1.37	19,180.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	47,000	10.78	506,660.00
SSY GROUP LIMITED	10,000	6.66	66,600.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	3,000	8.00	24,000.00
WUXI APPTTEC CO LTD	840	80.70	67,788.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,000	79.35	317,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	191,000	3.16	603,560.00
BANK OF CHINA LTD	521,000	3.18	1,656,780.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	57,000	5.37	306,090.00
CHINA CITIC BANK	59,000	4.35	256,650.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	632,000	6.12	3,867,840.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	21,000	3.55	74,550.00

CHINA MERCHANTS BANK- H	25,500	38.20	974,100.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	46,600	5.56	259,096.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	13,000	4.28	55,640.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	427,000	5.40	2,305,800.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	52,000	4.76	247,520.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	47,000	1.71	80,370.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	8,000	23.08	184,640.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	4,000	9.77	39,080.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	18,500	4.53	83,805.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	53,000	1.32	69,960.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	8,000	15.84	126,720.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	13,500	16.06	216,810.00
FAR EAST HORIZON LTD	12,000	7.49	89,880.00
GF SECURITIES CO LTD-H	7,600	8.91	67,716.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	5,000	13.20	66,000.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	18,800	9.07	170,516.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	10,800	13.02	140,616.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	49,000	19.46	953,540.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	17,200	32.05	551,260.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	1.35	40,500.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	10,600	18.62	197,372.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	5,400	33.85	182,790.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	54,000	3.32	179,280.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	46,000	9.40	432,400.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	36,500	94.55	3,451,075.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,200	20.25	24,300.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	8,000	9.75	78,000.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	9.30	83,700.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	13,000	17.70	230,100.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	36,000	4.69	168,840.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	26,000	26.25	682,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	18,000	33.25	598,500.00
CHINA VANKE CO LTD -H	10,300	28.70	295,610.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	14,000	4.66	65,240.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	51,000	10.42	531,420.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	10,000	6.78	67,800.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	6,000	13.00	78,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	3.28	68,880.00
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	8,000	7.15	57,200.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	10,000	11.76	117,600.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	12,000	30.10	361,200.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	16,000	3.21	51,360.00

SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	8,000	23.55	188,400.00
SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.64	22,140.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	2.85	54,150.00
SOHO CHINA LTD	7,500	2.44	18,300.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	16,000	34.55	552,800.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	44,000	1.79	78,760.00
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	6,000	3.51	21,060.00
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	17,000	8.20	139,400.00
KINGSOFT CORPORATION LTD.	4,000	18.14	72,560.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	5,000	16.74	83,700.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	5,000	41.20	206,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,500	11.86	65,230.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	5.03	50,300.00
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	3,500	21.05	73,675.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	7.40	51,800.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	2,000	17.82	35,640.00
LENOVO GROUP LTD	50,000	5.59	279,500.00
MEITU INC	11,500	1.90	21,850.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	4,700	117.90	554,130.00
XIAOMI CORP-CLASS B	52,800	9.34	493,152.00
ZTE CORPORATION	4,000	22.50	90,000.00
CHINA MOBILE LTD	40,500	67.05	2,715,525.00
CHINA TELECOM CORP LTD	90,000	3.68	331,200.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	276,000	1.86	513,360.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	40,000	8.45	338,000.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	3,500	38.70	135,450.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	36,000	4.38	157,680.00
CGN POWER CO LTD-H	70,000	2.06	144,200.00
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	12,400	30.05	372,620.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	17,000	4.64	78,880.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.75	64,750.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	6,000	38.45	230,700.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	12,000	10.80	129,600.00
DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	1.72	20,640.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,300	80.10	424,530.00
GUANGDONG INVESTMENT	20,000	16.34	326,800.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	12,000	3.22	38,640.00
HUANENG POWER INTL INC-H	22,000	4.33	95,260.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	30,000	2.70	81,000.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	24,000	6.93	166,320.00
TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	5.90	23,600.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	2,000	16.24	32,480.00

	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONA	20,000	10.56	211,200.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	24,000	5.04	120,960.00	
	香港ドル 小計	5,923,798		61,811,115.84 (855,465,843)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	21,300	3.49	74,337.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,900	23.30	44,270.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	16,800	7.41	124,488.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	8,700	4.90	42,630.00	
	GAMUDA BHD	13,300	3.63	48,279.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	3,900	9.90	38,610.00	
	IJM CORP BHD	18,500	2.25	41,625.00	
	SIME DARBY BERHAD	13,100	2.34	30,654.00	
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	1.81	9,955.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	5,600	8.51	47,656.00	
	MISC BHD	8,300	7.74	64,242.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	4.09	15,133.00	
	GENTING BHD	15,200	5.84	88,768.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	17,500	3.22	56,350.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	21.50	10,750.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	35.50	42,600.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	10.04	9,036.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	14,000	4.41	61,740.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	2,500	23.74	59,350.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	400	146.70	58,680.00	
	PPB GROUP BERHAD	4,140	18.56	76,838.40	
	QL RESOURCES BHD	5,300	6.97	36,941.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	15,000	4.86	72,900.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	8,000	5.27	42,160.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	15,600	5.66	88,296.00	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	8,700	4.79	41,673.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	3,700	3.03	11,211.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	10,100	4.17	42,117.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	33,300	5.02	167,166.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,700	16.40	77,080.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.70	31,730.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	26,200	8.90	233,180.00	
PUBLIC BANK BERHAD	20,700	20.14	416,898.00		
RHB BANK BHD	11,800	5.65	66,670.00		
SIME DARBY PROPERTY BHD	8,700	0.84	7,308.00		
SP SETIA BHD	5,500	1.46	8,030.00		
AXIATA GROUP BERHAD	15,900	4.27	67,893.00		
DIGI.COM BHD	21,800	4.71	102,678.00		

	MAXIS BERHAD	13,500	5.60	75,600.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,200	3.63	29,766.00	
	PETRONAS GAS BHD	4,300	16.24	69,832.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	21,000	13.78	289,380.00	
	YTL CORP BHD	16,000	0.97	15,600.00	
	マレーシアリングット 小計	456,840		3,040,100.40	(78,860,204)
タイバーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	22,900	12.40	283,960.00	
	IRPC PCL-NVDR	53,200	4.02	213,864.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	9,100	125.00	1,137,500.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	74,900	47.00	3,520,300.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	6,600	71.00	468,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	9,000	34.25	308,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	14,800	57.00	843,600.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	5,100	426.00	2,172,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	28,800	73.50	2,116,800.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	54,700	11.00	601,700.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	46,800	13.40	627,120.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	19,400	37.75	732,350.00	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	41,800	17.80	744,040.00	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	4,100	64.50	264,450.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	7,300	51.75	377,775.00	
	CP ALL PCL-NVDR	38,300	82.00	3,140,600.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	25,400	27.50	698,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	21,900	17.00	372,300.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	63,700	23.90	1,522,430.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	3,200	136.50	436,800.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	3,100	173.00	536,300.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	7,700	163.00	1,255,100.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	5,500	163.00	896,500.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	18,600	17.50	325,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	5,600	121.50	680,400.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	40,100	1.68	67,368.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,200	55.25	232,050.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	14,700	67.75	995,925.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	54,800	10.30	564,440.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	7,800	223.00	1,739,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,700	65.25	959,175.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	58.75	270,250.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	76,500	5.70	436,050.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	1,900	353.00	670,700.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	11,000	50.00	550,000.00	

	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	3,500	156.50	547,750.00
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	4,800	73.25	351,600.00
	タイパーツ 小計	830,100		31,662,047.00 (111,767,025)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	11,650	54.70	637,255.00
	ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	15,000	12.76	191,400.00
	AYALA CORPORATION	1,940	907.00	1,759,580.00
	DMCI HOLDINGS INC	14,600	9.12	133,152.00
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	600	919.00	551,400.00
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	20,070	74.50	1,495,215.00
	SM INVESTMENTS CORP	1,665	1,015.00	1,689,975.00
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	137.20	997,444.00
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	2,550	224.00	571,200.00
	UNIVERSAL ROBINA CORP	5,190	168.20	872,958.00
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	4,787	94.35	451,653.45
	BDO UNIBANK INC	13,500	142.40	1,922,400.00
	METROPOLITAN BANK & TRUST	8,460	69.60	588,816.00
	SECURITY BANK CORP	830	205.60	170,648.00
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	5.11	566,699.00
	ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW	146	5.19	757.74
	AYALA LAND INC	49,900	49.90	2,490,010.00
	MEGAWORLD CORP	92,000	5.18	476,560.00
	ROBINSONS LAND CO	17,200	25.30	435,160.00
	SM PRIME HOLDINGS INC	68,800	34.65	2,383,920.00
GLOBE TELECOM INC	220	1,949.00	428,780.00	
PLDT INC	530	1,175.00	622,750.00	
ABOITIZ POWER CORP	12,000	40.35	484,200.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	1,350	374.00	504,900.00	
	フィリピンペソ 小計	461,158		20,426,833.19 (42,283,544)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	1,430.00	165,737,000.00
	BUKIT ASAM TBK PT	10,400	2,580.00	26,832,000.00
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	12,200	23,075.00	281,515,000.00
	BARITO PACIFIC TBK PT	208,200	1,080.00	224,856,000.00
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	16,100	6,925.00	111,492,500.00
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	21,150.00	279,180,000.00
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	5,100	10,375.00	52,912,500.00
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	21,300	12,900.00	274,770,000.00
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	5,575.00	44,600,000.00
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	136,300	6,700.00	913,210,000.00
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	21,400	1,290.00	27,606,000.00
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	53,600	5,350.00	286,760,000.00

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	14,300	11,825.00	169,097,500.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	2,600	54,600.00	141,960,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	54,700	2,290.00	125,263,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	26,000	7,750.00	201,500,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	10,500	46,950.00	492,975,000.00	
	KALBE FARMA PT	153,100	1,680.00	257,208,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	52,100	7,675.00	399,867,500.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	2,150.00	33,325,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	64,600	30,025.00	1,939,615,000.00	
	PT BANK MANDIRI	125,800	7,000.00	880,600,000.00	
	PT BANK RAKYAT	369,700	4,190.00	1,549,043,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,370.00	38,634,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	670.00	53,198,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	328,700	4,220.00	1,387,114,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	65,600	2,050.00	134,480,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,012,500		10,493,351,000.00 (80,798,802)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	272	50,600.00	13,763,200.00	
	S-OIL CORPORATION	310	102,000.00	31,620,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	377	173,000.00	65,221,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	630	18,500.00	11,655,000.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	457	40,750.00	18,622,750.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	49	450,000.00	22,050,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	113	74,000.00	8,362,000.00	
	LG CHEM LTD	307	324,500.00	99,621,500.00	
	LG CHEM LTD	63	176,500.00	11,119,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	122	249,500.00	30,439,000.00	
	OCI COMPANY LTD	110	71,900.00	7,909,000.00	
	POSCO	524	238,000.00	124,712,000.00	
	POSCO CHEMUCAL CO LTD	201	51,700.00	10,391,700.00	
	CJ CORP	90	84,300.00	7,587,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	165	102,000.00	16,830,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	4,905.00	2,987,145.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	137	30,850.00	4,226,450.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	289	37,100.00	10,721,900.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	316	35,100.00	11,091,600.00	
	HANWHA CORPORATION	165	25,850.00	4,265,250.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	128	33,100.00	4,236,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	562	48,200.00	27,088,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	70	355,500.00	24,885,000.00	
	KCC CORP	36	234,500.00	8,442,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	431	40,950.00	17,649,450.00	



KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	274	125,000.00	34,250,000.00
LG CORP	652	70,800.00	46,161,600.00
LOTTE CORPORATION	108	36,550.00	3,947,400.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	441	19,650.00	8,665,650.00
SAMSUNG C&T CORPORATION	582	90,600.00	52,729,200.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	932	17,450.00	16,263,400.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	3,170	8,430.00	26,723,100.00
SK HOLDINGS CO LTD	241	217,000.00	52,297,000.00
S1 CORPORATION	106	98,200.00	10,409,200.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	140,500.00	10,397,000.00
GLOVIS CO LTD	111	153,500.00	17,038,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	295	24,100.00	7,109,500.00
PAN OCEAN CO LTD	2,212	4,820.00	10,661,840.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	395	31,000.00	12,245,000.00
HANON SYSTEMS	993	12,000.00	11,916,000.00
HYUNDAI MOBIS	446	244,500.00	109,047,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	997	128,000.00	127,616,000.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	265	84,300.00	22,339,500.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	180	75,400.00	13,572,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	1,776	43,850.00	77,877,600.00
FILA KOREA LTD	358	59,900.00	21,444,200.00
HLB INC	177	46,400.00	8,212,800.00
LG ELECTRONICS INC	732	66,200.00	48,458,400.00
WOONGJIN COWAY CO LTD	364	80,700.00	29,374,800.00
KANGWON LAND INC	845	30,100.00	25,434,500.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	24,450.00	13,031,850.00
KAKAO CORP	343	132,000.00	45,276,000.00
NAVER CORPORATION	933	154,500.00	144,148,500.00
NCSOFT CORP	108	528,000.00	57,024,000.00
NETMARBLE CORPORATION	149	99,000.00	14,751,000.00
PEARLABYSS CORP	54	192,000.00	10,368,000.00
CJ ENM CO LTD	57	164,000.00	9,348,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	167	86,700.00	14,478,900.00
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	51	78,200.00	3,988,200.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	139,000.00	8,340,000.00
SHINSEGAE CO LTD	39	257,000.00	10,023,000.00
BGF RETAIL CO LTD	61	204,500.00	12,474,500.00
E-MART INC	111	116,000.00	12,876,000.00
GS RETAIL CO LTD	99	40,650.00	4,024,350.00
CJ CHEILJEDANG CORP	44	242,000.00	10,648,000.00
KT&G CORPORATION	785	102,500.00	80,462,500.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	179	98,300.00	17,595,700.00

OTTOGI CORPORATION	4	582,000.00	2,328,000.00
AMOREPACIFIC CORP	228	143,500.00	32,718,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	75,800.00	2,501,400.00
AMOREPACIFIC GROUP	153	65,700.00	10,052,100.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	63	1,290,000.00	81,270,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	758,000.00	12,886,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	267	50,900.00	13,590,300.00
CELLTRION INC	603	170,500.00	102,811,500.00
CELLTRION PHARM INC	57	35,150.00	2,003,550.00
HANMI PHARM CO LTD	34	287,500.00	9,775,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	47	41,850.00	1,966,950.00
HELIXMITH CO LTD	137	199,200.00	27,290,400.00
MEDY-TOC INC	23	365,100.00	8,397,300.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	116	293,500.00	34,046,000.00
SILLAJEN INC	315	11,700.00	3,685,500.00
YUHAN CORPORATION	48	219,000.00	10,512,000.00
BS FINANCIAL GROUP INC	1,386	7,230.00	10,020,780.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	1,968	35,900.00	70,651,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,867	13,400.00	25,017,800.00
KB FINANCIAL GROUP INC	2,603	44,650.00	116,223,950.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	3,004	43,050.00	129,322,200.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,300	12,600.00	41,580,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	303	79,500.00	24,088,500.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	5,100.00	8,058,000.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,873	7,790.00	22,380,670.00
SAMSUNG CARD CO LTD	106	34,250.00	3,630,500.00
SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD.	332	36,750.00	12,201,000.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	13,100.00	9,798,800.00
DB INSURANCE CO LTD	263	52,100.00	13,702,300.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	2,670.00	2,547,180.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	333	25,000.00	8,325,000.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	120	27,200.00	3,264,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	202	233,500.00	47,167,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	490	73,800.00	36,162,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	239	196,000.00	46,844,000.00
LG DISPLAY CO LTD	1,311	14,950.00	19,599,450.00
LG INNOTEK CO LTD	115	104,000.00	11,960,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	391	96,400.00	37,692,400.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	31,349	47,100.00	1,476,537,900.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,450	39,100.00	213,095,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	369	233,500.00	86,161,500.00
LG UPLUS CORP	649	13,500.00	8,761,500.00

	SK TELECOM CO LTD	141	239,000.00	33,699,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	1,765	25,450.00	44,919,250.00	
	KOREA GAS CORPORATION	101	41,950.00	4,236,950.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	3,607	79,500.00	286,756,500.00	
	韓国ウォン 小計	97,096		5,078,785,665.00 (463,693,131)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	8,000	104.00	832,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	16,000	44.25	708,000.00	
	CHINA STEEL CORP	80,000	23.55	1,884,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	24,000	91.50	2,196,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	30,000	98.00	2,940,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	35,000	70.60	2,471,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	34,073	40.10	1,366,327.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	369.00	369,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	18,000	29.50	531,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,030	273.50	555,205.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP-NEW	30	273.50	8,205.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	9.12	91,200.00	
	EVA AIRWAYS CORP	18,350	13.85	254,147.50	
	EVA AIRWAYS CORP-NEW	547	13.85	7,575.95	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	7,350	13.00	95,550.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	12,000	36.75	441,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	14,000	44.25	619,500.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	1,000	396.00	396,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,200	213.00	468,600.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,000	34.95	104,850.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	2,000	221.50	443,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	267.50	267,500.00	
	POU CHEN	12,000	39.15	469,800.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	1,200	71.50	85,800.00	
	TATUNG CO LTD	10,000	17.75	177,500.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	445.00	890,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	295.00	1,180,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	63.90	127,800.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	32,000	78.00	2,496,000.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	151.00	151,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	36,253	21.20	768,563.60	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	83,000	9.44	783,520.00	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	121,000	21.05	2,547,050.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	68,785	26.35	1,812,484.75	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	64,340	22.10	1,421,914.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO-NEW	523	22.10	11,558.30	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	51,359	20.95	1,075,971.05
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	71,000	29.20	2,073,200.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	69,760	12.45	868,512.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	62,643	13.85	867,605.55
TAIWAN BUSINESS BANK	25,560	12.30	314,388.00
TAIWAN BUSINESS BANK NEW	728	12.30	8,954.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	57,870	20.60	1,192,122.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING-NEW	1,406	20.60	28,963.60
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	20,000	56.00	1,120,000.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	8,262	132.50	1,094,715.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	65,000	19.10	1,241,500.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	49,000	41.55	2,035,950.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,540	25.40	343,916.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	44,000	45.30	1,993,200.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	68,432	9.82	672,002.24
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	50.00	300,000.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	43.45	78,210.00
ACER INC	18,000	17.50	315,000.00
ADVANTECH CO LTD	2,000	274.50	549,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	209.00	1,045,000.00
AU OPTRONICS CORP	46,000	8.48	390,080.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	226.50	906,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	4,010	90.60	363,306.00
COMPAL ELECTRONICS	22,000	18.35	403,700.00
DELTA ELECTRONICS INC	13,000	147.00	1,911,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	5,000	64.70	323,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	82,800	76.00	6,292,800.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	48,000	7.28	349,440.00
INVENTEC CORPORATION	13,000	21.85	284,050.00
LARGAN PRECISION CO LTD	380	4,005.00	1,521,900.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	15,000	48.15	722,250.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	4,000	88.50	354,000.00
PEGATRON CORP	14,000	53.50	749,000.00
QUANTA COMPUTER INC	18,000	56.70	1,020,600.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	36.90	369,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	2,000	159.00	318,000.00
WISTRON CORPORATION	15,293	24.50	374,678.50
WPG HOLDINGS CO LTD	9,520	39.80	378,896.00
YAGEO CORPORATION	2,198	231.50	508,837.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	4,000	112.00	448,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	25,000	111.50	2,787,500.00
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	11,000	73.50	808,500.00

	TAIWAN MOBILE CO LTD	11,000	114.00	1,254,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	23,000	72.10	1,658,300.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	299.00	598,000.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	10,000	382.00	3,820,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	78.10	624,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	4,000	185.50	742,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	295.50	295,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	84.50	507,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	211.00	633,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	161,000	265.50	42,745,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	80,000	13.60	1,088,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	5,000	66.00	330,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	264.00	528,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	20,000	18.55	371,000.00	
	新台湾ドル 小計	2,103,242		123,970,998.74 (433,898,495)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	3,661	380.00	1,391,180.00	
	COAL INDIA LTD	8,717	200.55	1,748,194.35	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,473	255.65	1,143,522.45	
	INDIAN OIL CORP LTD	13,301	128.55	1,709,843.55	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	17,465	130.70	2,282,675.50	
	PETRONET LNG LTD	4,423	267.95	1,185,142.85	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	18,773	1,210.75	22,729,409.75	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	201.45	906,323.55	
	ASIAN PAINTS LTD	1,962	1,521.30	2,984,790.60	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	2,103	716.70	1,507,220.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	6,713	200.40	1,345,285.20	
	JSW STEEL LTD	4,845	225.65	1,093,274.25	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	886	1,359.15	1,204,206.90	
	SHREE CEMENT LTD	61	18,897.05	1,152,720.05	
	TATA STEEL LTD	2,053	361.10	741,338.30	
	ULTRATECH CEMENT LTD	660	3,992.85	2,635,281.00	
	UPL LTD	3,725	564.10	2,101,272.50	
	VEDANTA LTD	13,075	148.65	1,943,598.75	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	4,350	62.45	271,657.50	
	HAVELLS INDIA LTD	1,471	671.80	988,217.80	
	LARSEN & TOUBRO LTD	3,216	1,343.60	4,321,017.60	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,400	370.60	1,630,640.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	1,604	530.90	851,563.60	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	676	1,671.50	1,129,934.00	
	BAJAJ AUTO LTD	480	2,874.45	1,379,736.00	
	BHARAT FORGE LTD	778	411.10	319,835.80	

BOSCH LIMITED	55	14,243.25	783,378.75
EICHER MOTORS LTD	76	16,764.30	1,274,086.80
HERO MOTOCORP LTD	688	2,738.65	1,884,191.20
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,110	536.95	2,743,814.50
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	712	6,412.75	4,565,878.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,442	107.05	796,666.10
TATA MOTORS LTD	8,995	128.60	1,156,757.00
PAGE INDUSTRIES LTD	24	19,352.35	464,456.40
TITAN CO LTD	2,146	1,148.55	2,464,788.30
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	2,766	344.95	954,131.70
AVENUE SUPERMARTS LTD	731	1,596.25	1,166,858.75
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	426	2,715.05	1,156,611.30
ITC LIMITED	22,994	239.40	5,504,763.60
NESTLE INDIA LTD	132	12,840.95	1,695,005.40
UNITED SPIRITS LTD	2,109	609.80	1,286,068.20
DABUR INDIA LIMITED	3,045	454.75	1,384,713.75
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,052	638.25	1,309,689.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	4,321	1,816.30	7,848,232.30
MARICO LTD	3,281	380.90	1,249,732.90
AUROBINDO PHARMA LIMITED	1,539	636.60	979,727.40
CIPLA LTD	2,022	470.50	951,351.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	596	1,644.80	980,300.80
DR.REDDY'S LABORATORIES	798	2,725.30	2,174,789.40
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	514	374.05	192,261.70
LUPIN LTD	1,307	769.15	1,005,279.05
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	481	1,900.30	914,044.30
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	5,791	426.80	2,471,598.80
AXIS BANK LIMITED	12,656	670.90	8,490,910.40
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	10,722	2,046.75	21,945,253.50
ICICI BANK LIMITED	15,933	412.15	6,566,785.95
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,624	435.25	706,846.00
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,397	401.40	560,755.80
STATE BANK OF INDIA	12,129	284.70	3,453,126.30
YES BANK LTD	9,092	67.05	609,618.60
BAJAJ FINANCE LIMITED	1,173	3,418.85	4,010,311.05
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,348	330.85	776,835.80
REC LTD	5,374	143.25	769,825.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	871	1,053.55	917,642.05
BAJAJ FINSERV LTD	219	7,280.25	1,594,374.75
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,535	537.65	1,900,592.75
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	993	1,129.15	1,121,245.95
HCL TECHNOLOGIES LTD	3,666	1,069.90	3,922,253.40

	INFOSYS LIMITED	22,750	827.70	18,830,175.00
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	5,955	2,150.00	12,803,250.00
	TECH MAHINDRA LTD	3,203	719.45	2,304,398.35
	WIPRO LTD	8,396	247.10	2,074,651.60
	BHARTI AIRTEL LIMITED	13,452	344.00	4,627,488.00
	BHARTI INFRATEL LTD	1,237	251.95	311,662.15
	VODAFONE IDEA LTD	32,755	5.25	171,963.75
	GAIL INDIA LIMITED	8,986	129.70	1,165,484.20
	NTPC LTD	13,459	123.25	1,658,821.75
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	12,595	202.15	2,546,079.25
	TATA POWER CO LTD	4,120	64.40	265,328.00
	インドルピー 小計	417,163		214,162,738.20 (325,527,362)
エジプトbond	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	14.13	77,079.15
	EASTERN TOBACCO	5,913	17.02	100,639.26
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	9,082	81.74	742,362.68
	エジプトbond 小計	20,450		920,081.09 (6,090,936)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	1,848	135.00	249,480.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	313	911.20	285,205.60
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	2,790	281.47	785,301.30
	GOLD FIELDS LIMITED	5,712	67.96	388,187.52
	KUMBA IRON ORE LTD	490	415.87	203,776.30
	SAPPI LIMITED	2,041	47.10	96,131.10
	SASOL LTD.	3,783	306.00	1,157,598.00
	BIDVEST GROUP LTD	1,887	207.30	391,175.10
	MULTICHOICE GROUP LTD	3,068	124.46	381,843.28
	MR PRICE GROUP LTD	1,454	168.00	244,272.00
	NASPERS LIMITED-N SHS	2,883	2,544.94	7,337,062.02
	THE FOSCHINI GROUP	1,308	173.00	226,284.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	3,407	58.51	199,343.57
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	5,717	59.47	339,989.99
	BID CORP LTD	2,285	321.42	734,444.70
	CLICKS GROUP LTD	1,455	221.06	321,642.30
	PICK N PAY STORES LTD	1,342	64.50	86,559.00
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	3,329	131.16	436,631.64
	SPAR GROUP LIMITED	1,121	196.74	220,545.54
	TIGER BRANDS LTD	929	228.76	212,518.04
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	10,359	24.96	258,560.64
	NETCARE LTD	7,009	17.98	126,021.82
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	2,200	99.99	219,978.00
	ABSA GROUP LTD	4,896	172.06	842,405.76

CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	327	1,289.88	421,790.76
NEDBANK GROUP LTD	2,194	251.24	551,220.56
STANDARD BANK GROUP LIMITED	8,590	193.30	1,660,447.00
FIRSTRAND LIMITED	22,508	67.75	1,524,917.00
INVESTEC LTD	2,223	92.44	205,494.12
PSG GROUP LTD	877	223.66	196,149.82
REINET INVESTMENTS SCA	1,066	270.61	288,470.26
REMGRO LTD	3,624	185.00	670,440.00
RMB HOLDINGS LTD	5,468	82.95	453,570.60
DISCOVERY LTD	2,052	133.62	274,188.24
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	119.85	56,569.20
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	3,464	19.45	67,374.80
OLD MUTUAL LTD	33,107	20.45	677,038.15
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	5,957	33.10	197,176.70
SANLAM LTD	12,656	80.25	1,015,644.00
NEPI ROCKCASTLE PLC	2,150	138.77	298,355.50
MTN GROUP LIMITED	11,373	105.07	1,194,961.11
TELKOM SA SOC LTD	2,170	76.95	166,981.50
VODACOM GROUP LIMITED	4,446	127.21	565,575.66
南アフリカランド 小計	196,350		26,231,322.20 (193,587,157)
合 計	16,200,340		3,474,980,355 (3,474,980,355)

(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 39銘柄	4.5%	9.8%
メキシコペソ	株式 24銘柄	1.2%	2.7%
ブラジルレアル	株式 52銘柄	3.8%	8.2%
チリペソ	株式 17銘柄	0.5%	1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	0.2%	0.5%
ユーロ	株式 10銘柄	0.5%	1.0%
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	0.1%	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%	24.6%
マレーシアリングット	株式 43銘柄	1.0%	2.3%
タイバーツ	株式 37銘柄	1.5%	3.2%
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%	2.3%
韓国ウォン	株式 113銘柄	6.2%	13.3%



新台湾ドル	株式	92銘柄	5.8%	12.5%
インドルピー	株式	79銘柄	4.3%	9.4%
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	2.6%	5.6%

## (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	9,313.92		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	19,885	358,128.85		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	35,892	1,462,957.92		
		ISHARES MSCI UAE ETF	19,009	271,258.43		
	米ドル 小計		76,298	2,101,659.12	(227,399,516)	
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	163,600	6,658,520.00		
	中国元(オフショア) 小計		163,600	6,658,520.00	(102,008,526)	
投資信託受益証券合計				329,408,042	(329,408,042)	
投資証券	米ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	30,522	893,378.94		
		米ドル 小計		30,522	893,378.94	(96,663,601)
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	20,400	579,564.00		
		メキシコペソ 小計		20,400	579,564.00	(3,228,171)
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	2,700	120,096.00		
		KLABIN SA-UNIT	4,600	70,702.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	1,500	68,955.00		
	ブラジルリアル 小計		8,800	259,753.00	(6,886,052)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	9,022	196,499.16		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	20,610	496,082.70		
REDEFINE PROPERTIES LTD		31,094	256,836.44			
南アフリカランド 小計		60,726	949,418.30	(7,006,707)		
投資証券合計				113,784,531	(113,784,531)	
合計				443,192,573	(443,192,573)	

(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%	-	51.3%
	投資証券 1銘柄	-	1.3%	21.8%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.7%
ブラジルレアル	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%	1.6%
中国元(オフショア)	投資信託受益証券 1銘柄	1.4%	-	23.0%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### Jリート・インデックス・マザーファンド

#### 貸借対照表

	(平成30年 9月18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,059,292	164,570,845
投資証券	10,100,613,900	7,490,628,280
未収入金	-	30,000,000
未収配当金	115,555,396	100,741,035
流動資産合計	10,280,228,588	7,785,940,160
資産合計	10,280,228,588	7,785,940,160
負債の部		
流動負債		
未払金	-	63,928,246
未払解約金	17,120,000	75,551,855
未払利息	180	473
その他未払費用	516	5,575
流動負債合計	17,120,696	139,486,149
負債合計	17,120,696	139,486,149
純資産の部		
元本等		
元本	5,029,327,804	3,000,687,352
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	5,233,780,088	4,645,766,659
元本等合計	10,263,107,892	7,646,454,011
純資産合計	10,263,107,892	7,646,454,011
負債純資産合計	10,280,228,588	7,785,940,160

#### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至令和 1年 9月17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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,029,327,804口	3,000,687,352口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.0407円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 20,407円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.5482円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 25,482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19日 至 令和 1年 9月17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

<p>リスク</p>	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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>
<p>4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

<p>項目</p>	<p>（令和 1年 9月17日現在）</p>
-----------	------------------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(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19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,505,317,391円
同期中における追加設定元本額	2,438,945,799円
同期中における一部解約元本額	2,914,935,386円
平成30年 9月18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)	246,270,150円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	362,434,015円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	315,117,221円
イオン・バランス戦略ファンド	83,519,245円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	342,372,018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)	1,753,162円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,259,560円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	5,488,414円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	4,478,450円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	9,108,096円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,883,947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)	1,758,790,990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>	276,580,907円
合計	5,029,327,804円

(令和1年9月17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	5,029,327,804円
同期中における追加設定元本額	4,131,965,379円
同期中における一部解約元本額	6,160,605,831円
令和1年9月17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)	346,197,141円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	478,947,509円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	444,283,887円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	942,363,260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)	12,197,848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	5,795,101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)	252,399,862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)	47,728,431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>	29,000,676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	3,000,687,352円

附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	71	8,292,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	103	12,370,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人	233	154,246,000	
	MCUBS MidCity投資法人	831	95,149,500	
	森ヒルズリート投資法人	807	135,172,500	
	産業ファンド投資法人	861	131,560,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	659	228,014,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	436	88,638,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	351	185,679,000	
	GLP投資法人	1,746	235,710,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	292	100,594,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,006	285,502,800	
	星野リゾート・リート投資法人	106	60,314,000	
	Oneリート投資法人	109	32,809,000	
	イオンリート投資法人	756	103,194,000	
	ヒューリックリート投資法人	590	112,572,000	
	日本リート投資法人	228	100,434,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,486	91,200,380	
	日本ヘルスケア投資法人	35	6,594,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,045	184,868,000	
	トーセイ・リート投資法人	129	16,460,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	256	72,371,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	147	19,712,700	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	137	16,207,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,185	422,142,000	
	いちごホテルリート投資法人	118	14,809,000	
ラサールロジポート投資法人	617	95,018,000		
スターアジア不動産投資法人	230	26,266,000		
マリモ地方創生リート投資法人	62	7,545,400		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	172	74,390,000		
大江戸温泉リート投資法人	115	10,327,000		
さくら総合リート投資法人	149	14,095,400		

投資法人みらい	760	44,992,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	162	22,599,000	
三菱地所物流リート投資法人	112	34,832,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	98	12,553,800	
ザイマックス・リート投資法人	104	13,582,400	
タカラレーベン不動産投資法人	199	22,666,100	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	109	11,804,700	
日本ビルファンド投資法人	678	538,332,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	700	501,900,000	
日本リートファンド投資法人	1,325	286,730,000	
オリックス不動産投資法人	1,395	318,339,000	
日本プライムリアルティ投資法人	444	219,558,000	
プレミア投資法人	631	97,994,300	
東急リアル・エステート投資法人	469	95,863,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	484	72,406,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,573	317,274,100	
森トラスト総合リート投資法人	500	98,300,000	
インヴィンシブル投資法人	3,072	193,843,200	
フロンティア不動産投資法人	248	111,848,000	
平和不動産リート投資法人	436	58,598,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	457	122,476,000	
福岡リート投資法人	363	65,267,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	217	177,072,000	
いちごオフィスリート投資法人	542	56,693,200	
大和証券オフィス投資法人	162	132,516,000	
阪急阪神リート投資法人	317	50,307,900	
スターツプロシード投資法人	110	21,714,000	
大和ハウスリート投資法人	944	276,214,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,260	185,094,000	
日本賃貸住宅投資法人	790	78,368,000	
ジャパンエクセレント投資法人	629	108,628,300	
合計	40,358	7,490,628,280	

### 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18日現在）

（令和 1年 9月17日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	82,372,047	74,413,349
コール・ローン	12,465,039	135,003,231
投資証券	5,940,761,304	5,548,467,438
派生商品評価勘定	1,610	74,628
未収入金	290,563	22,175,142
未収配当金	12,144,608	8,921,123
流動資産合計	6,048,035,171	5,789,054,911
資産合計	6,048,035,171	5,789,054,911
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	59,246
未払金	11,243,619	160,897,501
未払解約金	9,000,000	13,340,000
未払利息	35	388
その他未払費用	279	395
流動負債合計	20,243,933	174,297,530
負債合計	20,243,933	174,297,530
純資産の部		
元本等		
元本	2,888,731,950	2,518,654,861
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,139,059,288	3,096,102,520
元本等合計	6,027,791,238	5,614,757,381
純資産合計	6,027,791,238	5,614,757,381
負債純資産合計	6,048,035,171	5,789,054,911

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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	為替予約取引

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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,888,731,950口	2,518,654,861口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0867円 (10,000口当たりの純資産額 20,867円)	1口当たり純資産額 2.2293円 (10,000口当たりの純資産額 22,293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19日 至 令和 1年 9月17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 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17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）

（平成30年 9月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	6,000,000	-	6,001,610	1,610
	米ドル	6,000,000	-	6,001,610	1,610
合計		6,000,000	-	6,001,610	1,610

（令和 1年 9月17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	143,400,000	-	143,415,382	15,382
	米ドル	110,450,000	-	110,483,972	33,972
	カナダドル	3,000,000	-	2,994,503	5,497
	ユーロ	9,500,000	-	9,455,551	44,449
	英ポンド	5,900,000	-	5,939,793	39,793
	オーストラリアドル	8,250,000	-	8,242,228	7,772
	香港ドル	3,500,000	-	3,500,759	759
	シンガポールドル	2,800,000	-	2,798,576	1,424
合計		143,400,000	-	143,415,382	15,382

（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19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,898,629,446円
同期中における追加設定元本額	2,122,842,478円
同期中における一部解約元本額	1,132,739,974円
平成30年 9月18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)	240,255,482円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	158,910,182円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	116,161,687円
イオン・バランス戦略ファンド	136,939,660円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	969,320,479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)	2,581,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,649,949円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,739,312円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	5,275,024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	8,660,003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
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>	108,163,847円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,720,964円
合計	2,888,731,950円

(令和 1年 9月17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	2,888,731,950円
同期中における追加設定元本額	1,944,773,625円

同期中における一部解約元本額	2,314,850,714円
令和 1年 9月17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）	49,413,167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
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,179,660,112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）	13,918,944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	20,448,351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）	54,879,069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>	20,100,484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	2,518,654,861円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,108	88,298.28	
		AGREE REALTY CORP	1,879	135,288.00	
		ALEXANDER'S INC	136	48,278.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,452	681,868.32	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,052	95,951.52	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,299	248,576.09	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,086	28,369.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,355	281,376.90	
		AMERICOLD REALTY TRUST	8,080	292,092.00	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	5,984	308,594.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,088	164,837.92	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	18,937.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,774	1,211,962.60	

BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	6,978.00	
BOSTON PROPERTIES INC	6,459	852,781.77	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	5,785.22	
BRANDYWINE REALTY TRUST	5,718	85,255.38	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,502	225,899.28	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	2,361	47,739.42	
BRT APARTMENTS CORP	500	7,370.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,155	454,889.40	
CARETRUST REIT INC	4,198	96,428.06	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	7,561.05	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	6,070.50	
CHATHAM LODGING TRUST	706	12,792.72	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	62,928.00	
CITY OFFICE REIT INC	600	8,340.00	
CLIPPER REALTY INC	800	8,600.00	
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	123,756.60	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	96,300.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	12,762.00	
CORECIVIC INC	5,301	94,887.90	
CORESITE REALTY CORPORATION	1,265	144,096.15	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	127,297.88	
COUSINS PROPERTIES INC	6,111	221,095.98	
CUBESMART	8,369	293,835.59	
CYRUSONE INC	4,761	356,027.58	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,330	104,642.90	
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,644	1,092,515.16	
DOUGLAS EMMETT INC	5,975	251,009.75	
DUKE REALTY CORP	15,371	506,167.03	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	4,370	91,857.40	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,502	188,921.56	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	70,550.00	
EPR PROPERTIES	2,875	219,966.25	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,608	155,750.40	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,616	477,745.92	
EQUITY RESIDENTIAL	15,133	1,287,061.65	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	4,017	90,020.97	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,610	846,423.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,032	589,347.84	
FARMLAND PARTNERS INC	300	2,061.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,168	426,476.16	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,467	175,061.73	

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	94,794.21
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	30,636.00
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	23,200.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,880	300,385.60
GEO GROUP INC	5,536	100,810.56
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	46,424.28
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	33,724.80
GLADSTONE LAND CORP	600	7,206.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	11,340.00
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	67,664.43
HCP, INC.	18,590	633,919.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,720	187,959.20
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	8,986	253,045.76
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	15,331.08
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,629	208,073.55
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,445	188,135.15
HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,423	512,254.43
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,905	202,128.15
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	65,206.05
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,254	49,520.38
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	200	18,214.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	323	23,310.91
INVITATION HOMES INC	17,952	506,066.88
IRON MOUNTAIN INC	11,379	367,314.12
JBG SMITH PROPERTIES	4,364	171,374.28
KILROY REALTY CORP	3,892	299,567.24
KIMCO REALTY CORPORATION	16,855	337,268.55
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	51,719.46
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	72,909.21
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,652	290,399.76
LIFE STORAGE INC	2,099	216,301.95
LTC PROPERTIES INC	1,576	78,232.64
MACERICH COMPANY/THE	4,415	147,151.95
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,669	101,083.85
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	57,694.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,607	331,187.67
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,525	579,471.50
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	51,201.28
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	140,307.36
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,109	327,870.03



NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,600	52,352.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	18,172.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	23,315.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	37,716.32
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,919	58,625.45
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	8,098	332,179.96
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	28,290.00
PARAMOUNT GROUP INC	8,400	111,720.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	7,345	191,777.95
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,931	169,152.12
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	12,377.61
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,507	147,681.52
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	111,078.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	42,079.00
PROLOGIS INC	25,293	2,155,469.46
PS BUSINESS PARKS INC/CA	938	168,896.28
PUBLIC STORAGE	6,188	1,530,601.80
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,764	136,873.28
REALTY INCOME CORPORATION	12,401	917,301.97
REGENCY CENTERS CORP	6,656	454,138.88
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	74,538.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,355	123,845.80
RETAIL VALUE INC	594	22,286.88
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,197	186,724.53
RLJ LODGING TRUST	7,377	129,835.20
RPT REALTY	2,740	36,907.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,074	170,669.46
SABRA HEALTH CARE REIT	7,500	169,050.00
SAFEHOLD INC	600	18,012.00
SAUL CENTERS INC	703	38,130.72
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,696	94,873.52
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	64,875.00
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,294	1,898,070.66
SITE CENTERS CORP	5,797	85,041.99
SL GREEN REALTY CORP	3,727	305,539.46
SPIRIT MTA REIT	1,580	13,414.20
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,332	157,437.00
STAG INDUSTRIAL INC	4,981	148,284.37
STORE CAPITAL CORP	8,902	326,525.36
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	51,514.00

	SUN COMMUNITIES INC	3,834	563,828.04
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	134,453.28
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	60,523.20
	TAUBMAN CENTERS INC	2,883	122,700.48
	TERRENO REALTY CORP	2,200	112,508.00
	UDR INC	10,951	527,509.67
	UMH PROPERTIES INC	800	11,064.00
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	775	76,771.50
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	75,108.06
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	10,687.56
	VENTAS INC	15,336	1,086,708.96
	VEREIT INC	41,304	402,300.96
	VICI PROPERTIES INC	15,411	340,583.10
	VORNADO REALTY TRUST	6,610	422,445.10
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	24,703.90
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,270	91,102.20
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,598	157,695.66
	WELLTOWER INC	16,710	1,452,600.30
	WHITESTONE REIT	200	2,748.00
	WP CAREY INC	6,706	588,518.56
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	86,680.00
	米ドル 小計	940,723	37,906,510.10 (4,101,484,392)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,306	120,511.56
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,233	27,644.54
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	32,229.75
	CAN APARTMENT PROP	3,810	203,225.40
	CHOICE PROPERTIES REIT	5,671	80,074.52
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	39,963.84
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	23,535.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	45,376.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,714	61,540.98
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	46,176.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	40,767.12
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	63,380.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,256	117,734.40

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2,479	38,176.60
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	19,670.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	6,708.42
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,929.00
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	30,308.12
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	17,430.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,629	172,354.00
	SLATE OFFICE REIT	1,000	6,050.00
	SLATE RETAIL REIT	500	6,315.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,256	104,126.88
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	18,585.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	1,000	6,700.00
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>58,112</b>	<b>1,330,512.13</b> <b>(108,742,756)</b>
<b>ユーロ</b>	AEDIFICA	1,035	105,984.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,573	98,266.35
	ALTAREA	80	14,864.00
	BEFIMMO SCA	835	45,006.50
	COFINIMMO	838	106,090.80
	COVIVIO	2,501	235,094.00
	EUROCOMMERCIAL	2,563	62,434.68
	GECINA SA	2,344	327,691.20
	GREEN REIT PLC	27,000	51,354.00
	HAMBORNER REIT AG	2,840	26,650.56
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	36,894.20
	ICADE	1,612	127,670.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	18,812.16
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	8,358	86,003.82
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,302	33,201.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	16,281.20
	KLEPIERRE	8,892	265,781.88
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	19,728.60
	MERCIALYS	2,280	27,474.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	14,605	174,237.65
	MONTEA	611	44,847.40
	NSI NV	727	28,462.05
	RETAIL ESTATES	588	49,333.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,477	708,449.95
	VASTNED RETAIL	925	26,038.75
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	714	115,810.80

	WERELDHAVE NV	631	12,657.86
	ユーロ 小計	134,729	2,865,121.01 (341,321,865)
英債券	ASSURA PLC	116,800	80,825.60
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	68,976.64
	BRITISH LAND CO PLC	37,600	208,604.80
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	3,996.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19,661	16,672.52
	DERWENT LONDON PLC	5,084	156,383.84
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	18,520.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13,270	92,836.92
	HAMMERSON PLC	27,400	73,541.60
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	11,220.30
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	12,255.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,983	270,658.49
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	29,495	61,998.49
	LXI REIT PLC	36,635	48,138.39
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	33,413.94
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	15,000	13,020.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	35,984	48,434.46
	RDI REIT PLC	8,020	8,998.44
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,090.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,700	49,511.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	8,310.00
	SEGRE PLC	44,637	341,115.95
	SHAFTESBURY PLC	7,700	66,566.50
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	8,820.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	64,900	93,391.10
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	28,945.00
	UNITE GROUP PLC	11,494	119,422.66
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	60,124.50
	英債券 小計	690,406	2,009,792.14 (270,015,574)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	8,942	34,963.22
	APN INDUSTRIA REIT	1,000	2,900.00
	ARENA REIT	24,763	69,336.40
	BWP TRUST	26,090	100,707.40
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	7,100	25,560.00
	CHARTER HALL GROUP	17,258	190,873.48
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	16,958	94,964.80
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	49,846.26
	CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	102,090.00

	DEXUS	42,764	521,720.80
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	27,720.00
	GOODMAN GROUP	63,649	862,443.95
	GPT GROUP	75,100	455,106.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	18,930	82,534.80
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	343.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	31,929.06
	MIRVAC GROUP	160,906	489,154.24
	NATIONAL STORAGE REIT	43,936	78,645.44
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	20,000.00
	SCENTRE GROUP	223,480	891,685.20
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	108,468.36
	STOCKLAND	95,730	422,169.30
	VICINITY CENTRES	124,829	322,058.82
	VIVA ENERGY REIT	18,000	49,500.00
	オーストラリアドル 小計	1,141,444	5,034,720.53 (373,827,999)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	43,200.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	36,319	78,449.04
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	74,096.55
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44,000	79,200.00
	STRIDE STAPLED GROUP	23,000	52,900.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	50,255.00
	ニュージーランドドル 小計	197,226	378,100.59 (25,949,043)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	376,560.00
	FORTUNE REIT	58,000	531,280.00
	LINK REIT	87,600	7,787,640.00
	PROSPERITY REIT	60,000	178,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	206,460.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,000	207,200.00
	香港ドル 小計	354,600	9,287,340.00 (128,536,785)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	34,545.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	26,750.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	103,100	320,641.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	52,400.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	19,575.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	106,700	227,271.00
	CAPITALAND MALL TRUST	99,400	260,428.00

	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	30,800.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	55,990.50	
	ESR REIT	57,552	29,927.04	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	31,280.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	30,520.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	36,800	98,992.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	73,024.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	7,100.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	59,000	72,570.00	
	KEPPEL DC REIT	58,300	104,940.00	
	KEPPEL REIT	98,900	123,625.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	7,755.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	82,000	178,760.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	49,800	116,034.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	87,250	137,855.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	109,560.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	13,000	39,520.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	13,950.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	14,040.00	
	SPH REIT	16,000	17,600.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	40,770.00	
	SUNTEC REIT	96,000	185,280.00	
	シンガポールドル 小計	1,489,452	2,461,502.54 (193,646,404)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	162,000.00	
	イスラエルシュケル 小計	8,000	162,000.00 (4,942,620)	
	合計		5,548,467,438 (5,548,467,438)	

(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	73.0%	73.9%
カナダドル	投資証券 25銘柄	1.9%	2.0%
ユーロ	投資証券 27銘柄	6.1%	6.2%
英ポンド	投資証券 28銘柄	4.8%	4.9%
オーストラリアドル	投資証券 24銘柄	6.7%	6.7%
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	29銘柄	3.4%	3.5%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	0.1%	0.1%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成30年 9月18日現在）	（令和 1年 9月17日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	488,666,663	891,778,173
国債証券	144,258,851,560	109,243,806,970
地方債証券	18,228,632,639	10,650,022,025
特殊債券	24,961,077,531	17,168,362,877
社債券	7,687,895,000	7,076,175,000
未収利息	713,818,011	529,452,321
前払費用	13,470,772	5,120,251
流動資産合計	196,352,412,176	145,564,717,617
<b>資産合計</b>		
196,352,412,176		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	386,206,000
未払解約金	142,582,056	524,830,601
未払利息	1,375	2,566
その他未払費用	2,160	17,207
流動負債合計	142,585,591	911,056,374
<b>負債合計</b>		
142,585,591		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	156,243,981,253	111,291,274,213
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	39,965,845,332	33,362,387,030
元本等合計	196,209,826,585	144,653,661,243
<b>純資産合計</b>		
196,209,826,585		
<b>負債純資産合計</b>		
196,352,412,176		

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	156,243,981,253口	111,291,274,213口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2558円 (10,000口当たりの純資産額 12,558円)	1口当たり純資産額 1.2998円 (10,000口当たりの純資産額 12,998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19日 至 令和 1年 9月17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、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せん。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月17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、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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	176,819,822,513円
同期中における追加設定元本額	19,201,712,901円
同期中における一部解約元本額	39,777,554,161円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,127,386,803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)	1,614,086,451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)	435,164,469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)	271,629,507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)	186,323,704円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	72,886,153円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,686,378,534円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	434,988,432円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	396,913,769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)	7,392,488円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,950,441円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,202,839円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,542,455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	14,353,833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>	20,606,650,976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>	8,000,634,181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>	19,588,603,267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>	3,064,205,195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>	11,858,000,050円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	6,060,549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)	5,671,602,197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)	16,989,743,969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>	567,882,547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>	903,895,355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)	16,349,197,203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>	46,468,709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>	2,198,767,299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>	2,694,675,722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>	2,574,471,716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>	378,750,836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>	6,840,008,717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	156,243,981,253円

(令和1年9月17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	156,243,981,253円
同期中における追加設定元本額	19,908,749,719円

同期中における一部解約元本額	64,861,456,759円
令和 1年 9月17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)	4,649,896,261円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,054,625,797円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,736,914,763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)	715,543,539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)	48,668,648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)	171,775,380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)	307,055,675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)	116,538,307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)	219,479,815円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	94,055,681円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,713,845,928円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,119,290,171円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	487,725,326円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,413,280円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	664,371,830円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	230,357,700円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	284,527,456円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	57,074,810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N I S A・世界分散ファンド	35,272,862円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	416,763円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	262,454円
三井住友D S・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>	2,210,584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)	1,453,176,408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)	3,017,276,991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)	866,603,573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>	831,331,979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>	1,883,155,908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 >	2,384,149,886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 >	1,104,109,581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 >	289,520,953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	111,291,274,213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	221,423,400	
	第404回利付国債（2年）	200,000,000	201,374,000	
	第129回利付国債（5年）	250,000,000	251,762,500	
	第130回利付国債（5年）	660,000,000	665,313,000	
	第131回利付国債（5年）	140,000,000	141,250,200	
	第132回利付国債（5年）	95,000,000	95,934,800	
	第133回利付国債（5年）	108,000,000	109,177,200	
	第134回利付国債（5年）	110,000,000	111,299,100	
	第135回利付国債（5年）	190,000,000	192,449,100	
	第136回利付国債（5年）	400,000,000	405,608,000	

第137回利付国債(5年)	500,000,000	507,285,000	
第138回利付国債(5年)	650,000,000	660,062,000	
第140回利付国債(5年)	500,000,000	508,660,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	62,382,800	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	367,114,000	
第3回利付国債(40年)	195,000,000	298,950,600	
第4回利付国債(40年)	262,000,000	405,272,080	
第5回利付国債(40年)	270,000,000	405,326,700	
第6回利付国債(40年)	260,000,000	385,463,000	
第7回利付国債(40年)	290,000,000	414,343,300	
第8回利付国債(40年)	350,000,000	469,007,000	
第9回利付国債(40年)	481,000,000	484,857,620	
第10回利付国債(40年)	490,000,000	578,376,400	
第11回利付国債(40年)	400,000,000	459,512,000	
第12回利付国債(40年)	160,000,000	166,593,600	
第313回利付国債(10年)	35,000,000	35,812,000	
第317回利付国債(10年)	55,000,000	56,490,500	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	917,455,550	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,009,997,800	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	987,206,400	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	990,201,600	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,095,821,100	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	319,882,800	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	401,352,900	
第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,305,416,750	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	79,413,180	
第327回利付国債(10年)	275,000,000	284,520,500	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	133,949,400	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,111,545,100	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,339,856,650	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	822,158,610	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	846,727,950	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	328,037,850	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,927,000	
第336回利付国債(10年)	470,000,000	489,157,200	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	123,612,000	

第338回利付国債(10年)	805,000,000	835,115,050	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	815,732,750	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	801,485,300	
第341回利付国債(10年)	1,057,000,000	1,095,326,820	
第342回利付国債(10年)	950,000,000	972,933,000	
第343回利付国債(10年)	910,000,000	932,831,900	
第344回利付国債(10年)	1,021,000,000	1,047,597,050	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	963,316,620	
第346回利付国債(10年)	840,000,000	863,461,200	
第347回利付国債(10年)	630,000,000	647,942,400	
第348回利付国債(10年)	595,000,000	612,260,950	
第349回利付国債(10年)	970,000,000	998,188,200	
第350回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,110,898,800	
第351回利付国債(10年)	870,000,000	894,447,000	
第352回利付国債(10年)	920,000,000	945,309,200	
第353回利付国債(10年)	800,000,000	821,464,000	
第354回利付国債(10年)	495,000,000	507,904,650	
第355回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,086,765,000	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	645,333,600	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	401,235,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	367,444,500	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	614,446,200	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	118,714,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	637,423,050	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	529,807,300	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	761,395,000	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	995,185,240	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	634,673,850	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	604,345,500	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	660,255,400	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	467,147,250	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	438,079,950	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	459,103,050	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	434,040,300	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	410,904,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	504,435,690	

第27回利付国債(30年)	440,000,000	622,371,200	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	548,799,360	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	249,667,350	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	660,516,800	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	437,446,800	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	552,380,400	
第33回利付国債(30年)	518,000,000	705,956,300	
第34回利付国債(30年)	477,000,000	672,970,680	
第35回利付国債(30年)	395,000,000	543,144,750	
第36回利付国債(30年)	210,000,000	290,142,300	
第37回利付国債(30年)	450,000,000	614,866,500	
第38回利付国債(30年)	335,000,000	452,266,750	
第39回利付国債(30年)	220,000,000	302,748,600	
第40回利付国債(30年)	310,000,000	420,242,200	
第41回利付国債(30年)	325,000,000	433,758,000	
第42回利付国債(30年)	245,000,000	327,393,500	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	421,961,400	
第44回利付国債(30年)	370,000,000	496,258,800	
第45回利付国債(30年)	375,000,000	485,771,250	
第46回利付国債(30年)	375,000,000	486,206,250	
第47回利付国債(30年)	270,000,000	357,326,100	
第48回利付国債(30年)	385,000,000	491,310,050	
第49回利付国債(30年)	395,000,000	504,430,800	
第50回利付国債(30年)	385,000,000	433,321,350	
第51回利付国債(30年)	430,000,000	428,933,600	
第52回利付国債(30年)	433,000,000	454,065,450	
第53回利付国債(30年)	177,000,000	190,138,710	
第54回利付国債(30年)	125,000,000	140,698,750	
第55回利付国債(30年)	325,000,000	366,161,250	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	484,291,800	
第57回利付国債(30年)	475,000,000	534,769,250	
第58回利付国債(30年)	440,000,000	495,162,800	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	439,444,000	
第60回利付国債(30年)	420,000,000	484,012,200	
第61回利付国債(30年)	335,000,000	367,575,400	
第62回利付国債(30年)	145,000,000	151,017,500	



第63回利付国債(30年)	370,000,000	374,983,900	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	754,070,400	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,018,605,750	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	869,026,840	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,548,352,800	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,269,091,800	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,114,154,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,114,309,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,129,119,600	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	879,645,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	842,689,830	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	747,285,520	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	554,537,900	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	664,434,400	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	709,261,400	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	972,136,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	745,168,500	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	871,968,720	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,366,000	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	681,320,200	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	861,444,420	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	740,704,000	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	366,347,700	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	811,831,320	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	828,862,650	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	250,289,910	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	435,386,200	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	562,859,480	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	471,611,400	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	450,811,700	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	458,680,320	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	465,905,700	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	407,571,600	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	475,548,140	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	523,792,360	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	446,900,190	

第116回利付国債(20年)	210,000,000	261,674,700	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	245,922,000	
第119回利付国債(20年)	315,000,000	380,469,600	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	237,216,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	311,750,250	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	399,771,900	
第123回利付国債(20年)	230,000,000	287,270,000	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	235,149,700	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	259,255,300	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	223,461,000	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	178,326,800	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	265,193,900	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	232,105,900	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	165,364,200	
第131回利付国債(20年)	560,000,000	679,179,200	
第132回利付国債(20年)	680,000,000	826,730,400	
第133回利付国債(20年)	160,000,000	196,497,600	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	61,559,000	
第135回利付国債(20年)	145,000,000	176,698,450	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	144,726,000	
第137回利付国債(20年)	45,000,000	54,966,600	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,896,750	
第139回利付国債(20年)	160,000,000	193,387,200	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	648,863,100	
第141回利付国債(20年)	270,000,000	331,276,500	
第142回利付国債(20年)	230,000,000	285,252,900	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	206,723,400	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	216,453,600	
第145回利付国債(20年)	215,000,000	264,903,650	
第146回利付国債(20年)	235,000,000	290,138,050	
第147回利付国債(20年)	520,000,000	636,329,200	
第148回利付国債(20年)	344,000,000	416,711,280	
第149回利付国債(20年)	625,000,000	758,275,000	
第150回利付国債(20年)	401,000,000	481,625,060	
第151回利付国債(20年)	595,000,000	697,530,400	
第152回利付国債(20年)	395,000,000	463,445,600	

	第153回利付国債(20年)	377,000,000	448,901,440	
	第154回利付国債(20年)	560,000,000	658,593,600	
	第155回利付国債(20年)	400,000,000	457,944,000	
	第156回利付国債(20年)	440,000,000	461,049,600	
	第157回利付国債(20年)	415,000,000	420,797,550	
	第158回利付国債(20年)	460,000,000	489,127,200	
	第159回利付国債(20年)	453,000,000	488,927,430	
	第160回利付国債(20年)	425,000,000	465,655,500	
	第161回利付国債(20年)	440,000,000	474,650,000	
	第162回利付国債(20年)	340,000,000	366,499,600	
	第163回利付国債(20年)	450,000,000	484,686,000	
	第164回利付国債(20年)	455,000,000	481,499,200	
	第165回利付国債(20年)	610,000,000	644,824,900	
	第166回利付国債(20年)	375,000,000	410,077,500	
	第167回利付国債(20年)	390,000,000	411,691,800	
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	196,946,400	
	第169回利付国債(20年)	700,000,000	711,942,000	
国債証券合計		95,843,000,000	109,243,806,970	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,766,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,450,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,972,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	548,664,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	667,630,000	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	100,951,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	100,852,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	195,313,095	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	202,156,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	102,636,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	102,218,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,528,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,688,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,888,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,252,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,913,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,105,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,113,000	

第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,479,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,470,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,086,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,394,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,979,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	111,739,100	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,152,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,366,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	333,423,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	135,463,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	226,116,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,300,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	200,024,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	400,184,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,060,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,438,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,539,000	
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	102,376,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,896,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,571,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,247,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,456,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	614,802,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,802,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,532,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,030,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	216,894,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	111,653,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	141,692,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	121,068,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,123,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,474,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,139,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,714,000	

	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,462,000	
	第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,117,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,544,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	104,751,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,324,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	150,732,330	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,366,000	
地方債証券合計		9,900,500,000	10,650,022,025	
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	218,220,000	
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,034,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,620,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,647,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,210,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,342,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,617,000	
	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	307,050,000	
	第7回道路債券	100,000,000	107,430,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,951,000	
	第9回道路債券	100,000,000	135,545,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	161,731,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	470,568,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,470,000	
	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	240,640,000	
	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	139,998,000	
	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	51,023,460	
	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	362,997,000	
	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	159,793,410	
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	122,758,000		

第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,675,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,946,000	
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	101,050,000	
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	1,022,130,000	
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	102,201,000	
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	307,800,000	
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	205,788,000	
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	308,202,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,192,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,579,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,414,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	129,590,820	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,452,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,360,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,892,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	301,000,000	304,112,340	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,308,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	505,485,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,880,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,526,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	238,076,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,252,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,964,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,528,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,250,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,386,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,222,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,952,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,771,000	

第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,602,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,200,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,587,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	100,519,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	106,489,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	106,327,000	
第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,046,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,876,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,032,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,325,000	12,657,898	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,720,000	15,475,136	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,819,000	13,170,753	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,570,000	19,588,200	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,298,000	17,225,030	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,960,000	9,967,768	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,836,000	29,144,570	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,425,000	17,508,393	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,197,000	45,241,945	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,120,000	17,031,747	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,382,000	18,556,154	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,117,000	11,285,311	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,619,000	14,909,040	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,512,000	35,437,956	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,229,000	22,750,270	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,722,000	47,306,766	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,124,000	73,421,322	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,887,000	26,871,987	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,036,000	29,167,788	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,576,000	14,023,057	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,776,000	32,280,757	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,157,000	31,567,700	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,193,000	15,790,388	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,800,000	62,091,072	

第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,971,000	16,704,068	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,005,000	34,292,077	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,964,000	34,097,597	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,367,000	14,953,029	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,695,000	16,574,704	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,446,000	31,045,801	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,911,000	44,784,418	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,556,000	37,046,105	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,944,000	69,537,489	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,090,000	34,259,925	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,009,000	14,715,894	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,744,000	75,377,024	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,778,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,748,000	15,473,011	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,898,000	98,865,767	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,204,000	47,065,766	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,777,000	49,824,989	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,524,000	96,409,870	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,444,000	150,353,557	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,577,000	48,269,689	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,433,000	54,136,318	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,712,000	111,353,882	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,956,000	97,210,365	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,832,000	55,040,400	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,649,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,381,000	78,844,756	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,614,000	93,500,332	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,628,000	93,389,090	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,005,000	93,818,418	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,041,000	94,827,387	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,737,000	94,651,091	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,578,000	95,840,716	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	243,834,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,503,000	98,958,036	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,244,000	29,417,820	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,686,000	32,223,368	



	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,272,000	16,109,058
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,653,000	15,353,266
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,542,000	33,277,756
	い第810号農林債	300,000,000	300,477,000
	第301回信中金債(5年)	300,000,000	300,159,000
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	102,469,000
	第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,058,000
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,284,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,689,000
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,918,000
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,667,000
特殊債券合計		16,158,091,000	17,168,362,877
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	200,954,000
	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	200,498,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,219,000
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディング ス無担保社債	100,000,000	101,864,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	101,037,000
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,023,000
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	202,098,000
	第24回株式会社三菱ケミカルホールディング ス無担保社債	100,000,000	100,691,000
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,255,000
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,181,000
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,185,000
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,831,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,348,000
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,166,000
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,152,000
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,943,000
	第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,921,000
	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	119,057,000
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社 債	300,000,000	304,179,000

第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,112,000	
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	102,541,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,492,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	117,010,000	
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	102,819,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,491,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	117,156,000	
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	99,800,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
野村ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	99,839,000	
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	100,917,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	130,979,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,879,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	102,461,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	130,043,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,462,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,702,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,755,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,534,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,668,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,334,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,530,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,433,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,957,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,227,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,427,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,854,000	

第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,336,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,867,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,091,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	201,252,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	209,236,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,706,000	
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	103,320,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,967,000	
社債券合計	6,800,000,000	7,076,175,000	
合計		144,138,366,872	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成30年 9月18日現在) (令和 1年 9月17日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	362,350,430	338,148,531
コール・ローン	203,326,798	651,932,489
国債証券	173,429,049,559	151,155,670,509
派生商品評価勘定	1,008,385	-
未収入金	-	26,000,000
未収利息	1,318,741,743	1,012,969,416
前払費用	27,818,582	26,958,862
流動資産合計	175,342,295,497	153,211,679,807
資産合計	175,342,295,497	153,211,679,807
負債の部		
流動負債		
未払解約金	266,814,079	145,056,642
未払利息	572	1,875
その他未払費用	1,458	13,325
流動負債合計	266,816,109	145,071,842
負債合計	266,816,109	145,071,842
純資産の部		
元本等		
元本	100,496,412,078	85,315,961,664
剰余金		

	(平成30年 9月18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
剰余金又は欠損金( )	74,579,067,310	67,750,646,301
元本等合計	175,075,479,388	153,066,607,965
純資産合計	175,075,479,388	153,066,607,965
負債純資産合計	175,342,295,497	153,211,679,807

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,496,412,078口	85,315,961,664口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7421円 (10,000口当たりの純資産額 17,421円)	1口当たり純資産額 1.7941円 (10,000口当たりの純資産額 17,941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19日 至 令和 1年 9月17日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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17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18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	510,252,358	-	509,243,973	1,008,385
	米ドル	249,364,121	-	249,136,287	227,834
	カナダドル	16,739,618	-	16,720,713	18,905
	ユーロ	167,195,602	-	166,920,331	275,271
	英ポンド	37,558,837	-	37,521,642	37,195
	ポーランドズロチ 南アフリカランド	9,119,700 30,274,480	- -	9,105,000 29,840,000	14,700 434,480
合計		510,252,358	-	509,243,973	1,008,385

（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。

(令和 1年 9月17日現在)

該当事項はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 平成30年 9月19日 至 令和 1年 9月17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18日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	114,015,594,906円
同期中における追加設定元本額	6,281,494,378円
同期中における一部解約元本額	19,800,677,206円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC 外国債券インデックスファンドS	10,218,996,721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)	783,399,484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)	84,101,069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)	14,146,960円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	68,325,211円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	199,277,777円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	305,680,456円
イオン・バランス戦略ファンド	51,712,487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)	11,784,259円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,659,258円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	23,249,844円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,296,695円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	10,677,614円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,924,920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>	1,816,267,350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>	286,524,890円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	13,099,715,465円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,312,976,811円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,266,614,664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>	2,222,016,314円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,404,839,356円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	4,400,331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)	981,199,918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)	2,047,111,618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>	655,451,101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>	14,415,303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>	1,501,116,734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>	890,871,263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>	14,193,917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>	40,524,456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>	422,899,795円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	202,618,815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>	498,813,319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>	35,016円
合計	100,496,412,078円

(令和1年9月17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	100,496,412,078円
同期中における追加設定元本額	8,493,475,530円
同期中における一部解約元本額	23,673,925,944円
令和1年9月17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	11,766,161,785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)	827,320,378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)	61,620,932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)	18,278,864円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	165,747,647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
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)	40,579,240円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	73,254,793円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	31,130,869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	33,737,486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
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>	1,738,760,543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>	68,956,145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 >	10,935,470,259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 >	5,568,184,963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 >	12,480,294,022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 >	41,825,379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 >	103,984,328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 >	550,315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 >	719,907,039円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	122,817,278円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,249,804,938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 >	1,538,130,778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 >	1,918,853,792円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	6,314,850,187円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,615,274円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	10,692,672,052円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	390,565,358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 )	357,363,976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 >	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 )	137,965,039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 >	139,134,239円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	40,602,622円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	13,631,242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 >	139,249,864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 >	530,490,832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 >	80,961,044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 >	166,962,548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 >	51,587,486円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,611,476円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,318,967,309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 >	21,829,928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 >	662,480,428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 >	23,319,737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2 0 1 6 - 0 4 < 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	85,315,961,664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	3,759,328.14	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,962,968.75	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,442,695.33	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,664,984.37	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,071,781.25	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,566,531.26	
		US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,461,171.87	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,946,093.75	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,978,437.52	
		US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,283,500.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,983,359.39	
		US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,677,453.12	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,978,671.89	
		US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,381,812.51	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,968,750.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,454,882.83	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,466,796.87	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,958,984.39	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,981,484.39	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,976,796.89	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,977,031.25	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,472,812.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,488,242.20	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,994,687.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,388,312.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,488,789.08	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,988,046.89	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,990,390.64	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,989,218.75	
		US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,378,437.51	
		US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	5,991,863.30	
		US TREASURY N/B 1.625	1,900,000.00	1,862,148.44	
		US TREASURY N/B 1.75	3,700,000.00	3,692,484.37	
		US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,995,937.50	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,997,656.25	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,000,234.39	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,800,281.25			

US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,400,187.51	
US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,100,960.95	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,000,000.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,001,171.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,001,171.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,000,703.14	
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,702,671.87	
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	851,261.72	
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,406,000.00	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,006,093.76	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,008,906.25	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,010,312.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,705,976.57	
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	4,016,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,012,656.25	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,812,796.88	
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,220,500.00	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,301,796.87	
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,304,968.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,003,984.39	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,005,156.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,007,734.39	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,011,718.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,012,187.50	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,321,164.08	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,516,953.12	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,116,468.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,022,500.00	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	503,906.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,023,906.25	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,548,984.37	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,023,750.00	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,342,023.45	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,531,835.95	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,545,937.50	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,359,125.00	
US TREASURY N/B 2	3,900,000.00	3,956,976.58	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,004,687.50	
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,707,593.75	
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,708,632.82	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,024,062.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,019,453.14	

US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,023,203.14
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,875.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,049,687.52
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,149,648.45
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,033,593.76
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,068,750.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,564,257.83
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,076,250.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,835,718.75
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,000,679.71
US TREASURY N/B 2.125	6,300,000.00	6,438,304.71
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,022,187.52
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,017,578.14
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,528,476.58
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,821,656.26
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,352,742.20
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,063,750.00
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,313,343.77
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,537,968.75
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,459,468.75
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,180,890.62
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,113,125.00
US TREASURY N/B 2.25	7,600,000.00	7,822,062.49
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,366,156.27
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,371,437.50
US TREASURY N/B 2.25	5,600,000.00	5,786,812.52
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,818,605.48
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,012,343.76
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	5,037,109.40
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,015,937.50
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,655,968.76
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,224,843.75
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,233,375.00
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,768,875.00
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,105,953.12
US TREASURY N/B 2.375	6,200,000.00	6,488,687.50
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,931,320.32
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,560,703.12
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,144,921.90
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,895,046.87
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,780,765.64
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,461,578.13
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,785,437.50

US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,013,507.82
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	5,092,171.87
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,544,257.84
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	506,328.12
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,054,062.52
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,057,500.00
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,057,187.50
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,118,437.52
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,498,875.00
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	6,094,531.25
US TREASURY N/B 2.625	6,900,000.00	7,363,593.75
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,070,312.52
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,426,468.75
US TREASURY N/B 2.75	4,900,000.00	5,073,031.25
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,075,625.00
US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,334,945.34
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,449,453.15
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,319,937.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,106,093.76
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,272,656.25
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	633,609.37
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,147,625.02
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,180,781.26
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,050,906.26
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,621,625.00
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,638,046.87
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,091,875.00
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,092,187.50
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,332,000.00
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,166,859.37
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,662,304.70
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,875,117.21
US TREASURY N/B 2.875	3,400,000.00	3,690,062.50
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,337,500.00
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,456,562.52
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,023,843.76
US TREASURY N/B 2.875	300,000.00	336,726.56
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,282,812.52
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,321,117.20
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	2,045,109.38
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,549,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,556,250.00

US TREASURY N/B 3	4,200,000.00	4,790,953.14
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,862,695.32
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,517,281.25
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,549,015.62
US TREASURY N/B 3	1,900,000.00	2,179,804.69
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,364,359.39
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,063,750.00
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	6,314,976.59
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,273,679.69
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,316,562.50
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,664,406.25
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	4,411,562.50
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,815,125.00
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,831,875.00
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,810,820.32
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	977,687.50
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,119,921.90
US TREASURY N/B 3.625	3,400,000.00	4,260,093.75
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,519,687.50
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,903,007.82
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	5,111,250.00
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,932,304.69
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,344,687.50
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	811,500.00
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	677,929.69
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	958,125.00
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,921,171.88
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,479,500.00
US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,012,792.97
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	275,625.00
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,388,437.50
US TREASURY N/B 4.625	1,200,000.00	1,695,375.00
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,163,164.07
US TREASURY N/B 5	500,000.00	721,718.75
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	644,218.75
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	434,950.00
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	651,093.75
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,256,562.50
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,328,046.88
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	936,687.50
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	658,554.69
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,470,015.62
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,060,937.50

米ドル 小計		636,120,000.00	664,701,099.62 (71,920,658,978)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,947,500.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,900,000.00	1,881,038.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,973,300.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,965,640.00
	CANADA-GOV'T 1	700,000.00	688,562.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	965,860.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,997,580.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,000,400.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,001,050.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,107,722.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	938,493.00
	CANADA-GOV'T 2.25	400,000.00	412,500.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,458,520.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,497,160.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,194,542.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,300,000.00	1,340,950.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,373,900.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	673,345.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,026,670.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,100,000.00	2,125,515.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,075,475.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,129,580.00
	CANADA-GOV'T 5	950,000.00	1,438,461.50
CANADA-GOV'T 5.75	450,000.00	621,418.50	
CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	907,500.00	
CANADA-GOV'T 8	500,000.00	736,815.00	
カナダドル 小計		32,400,000.00	35,479,497.00 (2,899,739,289)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,182,400.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,613,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	34,000,000.00	33,602,200.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,479,000.00
	MEXICAN BONOS 8	22,000,000.00	22,813,340.00
	MEXICAN BONOS 8.5	31,000,000.00	33,780,080.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,765,600.00
メキシコペソ 小計		204,000,000.00	214,236,220.00 (1,193,295,745)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,049,664.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,395,316.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	760,900.00



BELGIAN 0.8	500,000.00	545,540.00
BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,995,780.00
BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,767,408.00
BELGIAN 0308 4	700,000.00	783,545.00
BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,652,765.00
BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,430,819.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,325,540.00
BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,956,802.00
BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,665,195.00
BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	575,700.00
BELGIAN 0333 3	500,000.00	706,870.00
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,051,550.00
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	709,505.00
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	474,928.00
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,532,958.00
BELGIAN 1	1,300,000.00	1,454,674.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	461,928.00
BELGIAN 1.6	800,000.00	987,904.00
BELGIAN 1.9	500,000.00	636,075.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	709,905.00
BELGIAN 3.75	800,000.00	1,405,944.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	1,005,030.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,517,955.00
BTPS 0.45	1,500,000.00	1,518,135.00
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,616,496.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,047,420.00
BTPS 0.9	2,250,000.00	2,311,830.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,064,120.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,033,600.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	2,102,660.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,074,120.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,089,760.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,906,992.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,059,340.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,867,427.00
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,288,644.00
BTPS 1.65	2,400,000.00	2,555,736.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,075,220.00
BTPS 2	2,300,000.00	2,520,225.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,776,800.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,664,250.00
BTPS 2.15	500,000.00	526,130.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,119,290.00

BTPS 2.25	1,200,000.00	1,354,452.00	
BTPS 2.3	600,000.00	630,936.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,272,392.00	
BTPS 2.5	600,000.00	667,188.00	
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,235,762.00	
BTPS 2.7	550,000.00	658,735.00	
BTPS 2.8	300,000.00	354,516.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,071,864.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,226,610.00	
BTPS 3.1	1,700,000.00	2,118,812.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,959,690.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,079,993.00	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,889,832.00	
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,383,645.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,646,825.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,130,620.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,439,008.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,339,060.00	
BTPS 3.85	200,000.00	286,394.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,601,000.00	
BTPS 4	2,100,000.00	2,895,900.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,668,920.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,569,070.00	
BTPS 4.5	2,600,000.00	3,268,798.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,851,966.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,948,250.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,380,550.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,530,576.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,252,500.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,250,870.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,091,110.30	
BTPS 5	1,800,000.00	2,824,092.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,673,675.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,397,256.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,342,760.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,640,474.00	
BTPS 6	2,700,000.00	4,155,219.00	
BTPS 6.5	1,200,000.00	1,755,792.00	
BTPS 7.25	400,000.00	586,120.00	
BTPS 9	300,000.00	408,882.00	
BUNDESÖBL-172 0.25	2,000,000.00	2,020,700.00	
BUNDESÖBL-173 0	2,500,000.00	2,528,575.00	

BUNDESUBL-174 0	3,000,000.00	3,047,040.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,300,000.00	3,458,730.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,923,552.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,113,179.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,500,000.00	1,611,180.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,669,925.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	970,956.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,636,755.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,188,860.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,413,724.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,263,056.50
DEUTSCHLAND REP 1.25	550,000.00	738,765.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,200,000.00	1,295,400.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,410,422.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,213,900.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,358,268.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,224,780.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,665,990.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,483,048.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,565,280.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,578,168.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,497,466.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,120,004.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,146,742.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,793,448.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,371,216.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,364,368.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,456,576.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,524,915.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,530,560.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,568,124.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	858,860.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,569,770.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	407,020.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	429,528.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	551,825.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	233,114.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,078,960.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,069,770.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,121,300.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	771,860.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	764,628.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,066,270.00

FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,268,630.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,249,854.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,057,180.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,048,640.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,027,590.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,262,106.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,324,725.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	2,095,780.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,071,187.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,500,000.00	1,595,730.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,100,000.00	1,175,559.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,603,699.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,857,811.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,241,716.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,767,200.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,977,508.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,796,648.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,319,629.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,362,840.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,100,000.00	3,476,774.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,772,078.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,065,584.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,720,340.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,075,921.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,861,720.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,300,000.00	3,415,236.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	2,000,000.00	2,567,780.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,050,000.00	5,090,971.50	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,487,500.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,709,750.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,000,000.00	3,309,300.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,169,450.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,644,596.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,381,280.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	2,354,519.70	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	3,152,085.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,614,820.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,382,748.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,765,652.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,285,820.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,922,092.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,208,280.00	

FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	801,624.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	406,564.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	723,338.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	758,331.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,083,190.00
IRISH GOVT 1.1	1,100,000.00	1,212,486.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	358,299.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,284,580.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	745,290.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,174,290.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	577,980.00
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,060,540.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,975,395.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,831,122.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,784,847.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	300,000.00	318,036.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,609,440.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,536,668.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,200,000.00	1,326,036.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,754,608.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,130,390.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,628,850.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,368,550.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	2,245,685.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	858,528.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	806,869.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,393,729.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,889,261.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,055,565.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,126,488.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,135,960.00
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	909,644.50
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	975,897.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	218,428.00
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	442,160.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	275,088.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	642,190.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,224,685.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,098,350.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	807,774.00
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	1,006,056.00
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	678,282.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,083,640.00

REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,112,780.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	1,108,315.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,203,162.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,351,920.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,529,540.00	
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,107,755.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,043,600.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,045,360.00	
SPANISH GOV'T 1.15	900,000.00	912,699.00	
SPANISH GOV'T 1.3	1,200,000.00	1,309,980.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,219,340.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,775,424.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	666,330.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,238,662.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,665,180.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,412,520.00	
SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	469,260.00	
SPANISH GOV'T 1.95	400,000.00	452,324.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,997,704.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,272,220.00	
SPANISH GOV'T 2.35	600,000.00	744,084.00	
SPANISH GOV'T 2.7	650,000.00	890,870.50	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,415,756.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,970,626.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,808,851.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,255,775.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,589,196.50	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,387,940.00	
SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,301,552.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	3,133,548.00	
SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,444,760.00	
SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,119,920.00	
SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,644,980.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,176,815.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,282,820.00	
SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,688,210.00	
SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,961,441.00	
SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,505,195.00	
SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,529,560.00	
SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	702,820.00	
SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,392,444.00	
ユーロ 小計	394,240,000.00	484,999,389.00	

英bond	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,801,296.00
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	757,545.00
	UK TSY GILT 1.25	1,500,000.00	1,581,930.00
	UK TSY GILT 1.5	1,050,000.00	1,062,946.50
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,068,750.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,846,064.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	559,246.50
	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,525,230.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,112,080.00
	UK TSY GILT 1.75	1,050,000.00	1,174,110.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	345,936.00
	UK TSY GILT 2	400,000.00	404,604.00
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,200,958.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,887,461.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,443,744.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,889,414.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,319,264.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,510,508.00
	UK TSY GILT 3.5	1,700,000.00	3,286,882.00
	UK TSY GILT 3.75	1,550,000.00	1,597,244.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	531,755.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,763,632.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,629,840.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,341,792.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,430,209.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,987,258.00
	UK TSY GILT 4.25	1,350,000.00	2,030,872.50
	UK TSY GILT 4.25	850,000.00	1,342,481.50
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,084,147.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,595,165.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,516,024.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,311,362.00
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,659,262.00
UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,289,681.00	
UK TSY GILT 4.75	1,000,000.00	1,438,170.00	
UK TSY GILT 4.75	1,100,000.00	1,820,731.00	
UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,989,856.00	
UK TSY GILT 6	950,000.00	1,412,137.00	
UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,827,878.40	
	英bond 小計	52,620,000.00	71,377,466.40 (9,589,562,610)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	7,400,000.00	8,116,098.00

	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,595,210.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,842,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,889,120.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,365,520.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	7,800,000.00	8,326,500.00	
スウェーデンクローナ 小計		39,800,000.00	46,135,348.00	(516,715,897)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,536,750.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,111,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,142,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,206,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,292,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,254,316.00	
ノルウェークローネ 小計		28,500,000.00	29,544,366.00	(356,895,941)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,540,950.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	3,200,000.00	3,490,880.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,474,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,922,800.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,576,800.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	11,500,000.00	22,674,550.00	
デンマーククローネ 小計		36,200,000.00	49,679,980.00	(792,395,681)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,011,100.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,011,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,631,850.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,092,790.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,900,000.00	6,295,890.00	
	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	2,687,088.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,849,974.00	
ポーランドズロチ 小計		30,100,000.00	32,091,692.00	(882,842,446)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1,200,000.00	1,211,172.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,021,900.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	416,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,900,000.00	2,072,900.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	800,000.00	905,440.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,705,392.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,478,960.00	



	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,045,152.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,496,170.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	952,720.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,396,456.60
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,135,220.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,497,740.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,150,000.00	1,476,485.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,619,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,350,000.00	2,829,870.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,961,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,909,270.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,200,000.00	2,556,290.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,021,928.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,837,125.00
	オーストラリアドル 小計	34,900,000.00	40,548,211.90 (3,010,704,733)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,111,880.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,039,500.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	448,800.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	790,097.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	442,600.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	744,103.50
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	834,400.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	812,320.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	590,877.50
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,100,000.00	1,236,400.00
	シンガポールドル 小計	7,500,000.00	8,050,978.00 (633,370,439)
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	8,065,555.20
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	7,955,910.67
	MALAYSIA GOVT 3.955	2,500,000.00	2,582,906.75
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,443,139.00
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,454,111.50
	マレーシアリングット 小計	26,400,000.00	27,501,623.12 (713,392,103)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	42,486,000.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	16,000,960.00
	REP SOUTH AFRICA 7	54,000,000.00	46,002,600.00
	REP SOUTH AFRICA 8	14,000,000.00	13,141,800.00
	南アフリカランド 小計	144,000,000.00	117,631,360.00 (868,119,436)
	合計		151,155,670,509 (151,155,670,509)

（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 207銘柄	47.0%	47.6%
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	37.7%	38.2%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.3%	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git	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.6%	0.6%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 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18日現在） （令和 1年 9月17日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	145,018,374	142,514,938
コール・ローン	367,165,339	386,701,962
国債証券	45,346,270,292	26,515,704,965
派生商品評価勘定	1,209,686	-
未収入金	-	440,682
未収利息	330,160,269	161,984,250
前払費用	14,349,343	15,334,057
流動資産合計	46,204,173,303	27,222,680,854
資産合計		
46,204,173,303		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	542,809,917	620,253,880
未払金	-	298,768
未払解約金	77,000,000	176,200,000
未払利息	1,033	1,112
その他未払費用	348	6,008
流動負債合計	619,811,298	796,759,768
負債合計		
619,811,298		
純資産の部		
元本等		

	(平成30年 9月18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
元本	33,296,978,321	17,958,175,971
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	12,287,383,684	8,467,745,115
元本等合計	45,584,362,005	26,425,921,086
純資産合計	45,584,362,005	26,425,921,086
負債純資産合計	46,204,173,303	27,222,680,854

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至令和 1年 9月17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18日現在)	(令和 1年 9月17日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	33,296,978,321口	17,958,175,971口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3690円 (10,000口当たりの純資産額 13,690円)	1口当たり純資産額 1.4715円 (10,000口当たりの純資産額 14,715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19日 至 令和 1年 9月17日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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17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18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	45,321,159,769	-	45,862,760,000	541,600,231
	米ドル	20,331,816,950	-	20,498,940,000	167,123,050
	カナダドル	941,213,464	-	949,605,000	8,391,536
	メキシコペソ	379,137,000	-	388,740,000	9,603,000
	ユーロ	18,197,393,360	-	18,452,700,000	255,306,640
	英ポンド	3,022,656,768	-	3,099,379,000	76,722,232
	スウェーデンクローナ	173,490,460	-	179,179,000	5,688,540
	ノルウェークローネ	104,318,710	-	107,835,000	3,516,290
	デンマーククローネ	277,937,520	-	281,589,000	3,651,480

	ポーランドズロチ	283,573,251	-	287,945,000	4,371,749
	オーストラリアドル	962,107,736	-	967,637,000	5,529,264
	シンガポールドル	403,360,000	-	406,250,000	2,890,000
	南アフリカランド	244,154,550	-	242,961,000	1,193,550
	合計	45,321,159,769	-	45,862,760,000	541,600,231

(令和 1年 9月17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	26,511,447,120	-	27,131,701,000	620,253,880
	米ドル	12,681,946,224	-	12,940,796,000	258,849,776
	カナダドル	509,000,736	-	522,368,000	13,367,264
	メキシコペソ	198,844,500	-	210,520,000	11,675,500
	ユーロ	10,147,384,106	-	10,364,310,000	216,925,894
	英ポンド	1,649,090,950	-	1,718,400,000	69,309,050
	スウェーデンクローナ	88,513,260	-	91,840,000	3,326,740
	ノルウェークローネ	60,357,440	-	62,712,000	2,354,560
	デンマーククローネ	140,785,200	-	143,550,000	2,764,800
	ポーランドズロチ	149,020,144	-	153,776,000	4,755,856
	オーストラリアドル	520,178,800	-	541,514,000	21,335,200
	シンガポールドル	228,570,000	-	235,650,000	7,080,000
	南アフリカランド	137,755,760	-	146,265,000	8,509,240
合計	26,511,447,120	-	27,131,701,000	620,253,880	

(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19日 至 令和 1年 9月17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18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	43,336,220,769円
同期中における追加設定元本額	7,168,523,113円
同期中における一部解約元本額	17,207,765,561円
平成30年 9月18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）	9,611,083,204円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	5,005,003,007円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,211,520,976円
イオン・バランス戦略ファンド	574,962,361円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	86,822,932円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	27,382,925円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	52,529,180円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	15,552,434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	4,362,660円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,323,704,828円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	5,542,001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）	4,987,196,406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＞	3,620,361,540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＞	74,594,874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＞	636,786,192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＞	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	33,296,978,321円

( 令和 1年 9月17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	33,296,978,321円
同期中における追加設定元本額	8,439,891,052円
同期中における一部解約元本額	23,778,693,402円
令和 1年 9月17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)	4,780,840,890円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,968,012,239円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	861,023,087円
イオン・バランス戦略ファンド	780,545,524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)	4,097,558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	10,069,312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>	5,255,064,175円
S M A M ・ バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	1,943,809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)	252,864,072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 >	3,017,845,382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>	76,378,386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>	370,161,329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 >	516,146,904円
合計	17,958,175,971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	1,385,015.63	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	691,359.37	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	987,265.63	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	987,031.25	



US TREASURY N/B 1.125	400,000.00	394,625.00
US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	495,351.56
US TREASURY N/B 1.25	200,000.00	197,781.25
US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,491,914.07
US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	198,781.25
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	992,890.63
US TREASURY N/B 1.375	2,750,000.00	2,729,160.16
US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,085,820.31
US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	197,343.75
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	986,328.13
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	596,296.87
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	496,171.87
US TREASURY N/B 1.5	850,000.00	834,593.75
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,195,968.75
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,196,812.49
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	996,015.63
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	996,796.88
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,195,687.50
US TREASURY N/B 1.625	1,400,000.00	1,387,421.88
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	792,312.50
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	698,578.12
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	200,015.62
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	600,140.62
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	300,000.00
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,000,390.63
US TREASURY N/B 1.75	1,100,000.00	1,100,515.62
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	601,312.50
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	701,750.00
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	501,328.12
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,003,046.88
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,002,968.75
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,004,218.75
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	302,132.81
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,006,406.25
US TREASURY N/B 2	400,000.00	400,375.00
US TREASURY N/B 2	800,000.00	802,062.50
US TREASURY N/B 2	800,000.00	803,125.00
US TREASURY N/B 2	250,000.00	251,015.62
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,004,921.88
US TREASURY N/B 2	600,000.00	603,187.50
US TREASURY N/B 2	700,000.00	705,250.00
US TREASURY N/B 2	800,000.00	806,250.00

US TREASURY N/B 2	1,400,000.00	1,412,468.74
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,011,875.00
US TREASURY N/B 2	500,000.00	506,367.19
US TREASURY N/B 2	600,000.00	607,640.62
US TREASURY N/B 2	200,000.00	202,921.87
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	501,406.25
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	804,062.50
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,006,015.63
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	402,593.75
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,031,875.00
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,012,421.88
US TREASURY N/B 2.125	4,600,000.00	4,677,265.64
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	510,976.56
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,815,531.26
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	603,515.62
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	503,164.06
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,021,250.00
US TREASURY N/B 2.25	3,550,000.00	3,627,378.92
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	820,250.00
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	922,781.25
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	513,046.87
US TREASURY N/B 2.25	950,000.00	976,867.18
US TREASURY N/B 2.25	650,000.00	670,769.53
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	929,671.87
US TREASURY N/B 2.25	1,100,000.00	1,136,695.31
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	791,187.50
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	296,156.25
US TREASURY N/B 2.375	900,000.00	905,554.69
US TREASURY N/B 2.375	100,000.00	100,742.18
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	503,984.37
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	406,218.75
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,030,156.25
US TREASURY N/B 2.375	900,000.00	937,828.12
US TREASURY N/B 2.375	1,300,000.00	1,360,531.25
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	308,695.31
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,034,218.75
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,039,296.88
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	939,585.94
US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	519,570.31
US TREASURY N/B 2.5	600,000.00	623,531.24
US TREASURY N/B 2.625	700,000.00	709,460.94
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	407,625.00
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	523,125.00

US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	420,312.50
US TREASURY N/B 2.625	1,100,000.00	1,173,906.25
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	934,031.25
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	624,140.62
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	526,523.44
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	949,078.12
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	739,210.94
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	536,210.94
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	435,843.75
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	655,406.25
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	655,218.75
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	716,078.12
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	941,484.37
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	848,000.00
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	636,468.75
US TREASURY N/B 2.875	1,750,000.00	1,895,878.90
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,085,312.50
US TREASURY N/B 2.875	400,000.00	445,000.00
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,559,796.88
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,005,960.94
US TREASURY N/B 3	400,000.00	428,281.25
US TREASURY N/B 3	400,000.00	454,468.75
US TREASURY N/B 3	900,000.00	1,023,609.37
US TREASURY N/B 3	200,000.00	227,812.50
US TREASURY N/B 3	900,000.00	1,026,632.81
US TREASURY N/B 3	250,000.00	286,269.53
US TREASURY N/B 3	800,000.00	915,375.00
US TREASURY N/B 3	800,000.00	915,875.00
US TREASURY N/B 3	100,000.00	114,726.56
US TREASURY N/B 3	850,000.00	976,238.28
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	817,000.00
US TREASURY N/B 3.125	550,000.00	609,339.83
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	347,367.18
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	347,484.37
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	463,375.00
US TREASURY N/B 3.125	500,000.00	580,468.75
US TREASURY N/B 3.375	1,050,000.00	1,290,761.72
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	366,632.81
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,228,781.25
US TREASURY N/B 3.625	500,000.00	627,734.37
US TREASURY N/B 3.75	250,000.00	317,167.97
US TREASURY N/B 3.75	100,000.00	127,781.25

	US TREASURY N/B 3.875	1,400,000.00	1,803,484.38
	US TREASURY N/B 4.25	450,000.00	605,109.37
	US TREASURY N/B 4.25	300,000.00	405,750.00
	US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	271,171.87
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	410,625.00
	US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	275,500.00
	US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	135,039.06
	US TREASURY N/B 4.625	300,000.00	423,843.75
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	257,687.50
	US TREASURY N/B 5.25	100,000.00	129,554.68
	US TREASURY N/B 5.375	100,000.00	135,921.87
	US TREASURY N/B 6.25	200,000.00	284,859.37
	US TREASURY N/B 6.5	300,000.00	395,132.81
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	339,234.37
	米ドル 小計	111,850,000.00	116,723,980.36 (12,629,534,674)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	400,000.00	389,500.00
	CANADA-GOV'T 0.75	100,000.00	99,002.00
	CANADA-GOV'T 0.75	600,000.00	591,990.00
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	294,846.00
	CANADA-GOV'T 1	200,000.00	193,172.00
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	399,516.00
	CANADA-GOV'T 1.5	750,000.00	750,787.50
	CANADA-GOV'T 2	300,000.00	312,831.00
	CANADA-GOV'T 2.25	550,000.00	572,990.00
	CANADA-GOV'T 2.25	200,000.00	213,880.00
	CANADA-GOV'T 2.75	450,000.00	464,175.00
	CANADA-GOV'T 2.75	250,000.00	312,250.00
	CANADA-GOV'T 3.25	500,000.00	513,335.00
	CANADA-GOV'T 3.5	200,000.00	276,730.00
	CANADA-GOV'T 4	350,000.00	496,902.00
	CANADA-GOV'T 5	250,000.00	378,542.50
	カナダドル 小計	5,800,000.00	6,260,449.00 (511,666,496)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	2,000,000.00	2,261,400.00
	MEXICAN BONOS 5.75	3,500,000.00	3,257,380.00
	MEXICAN BONOS 6.5	6,000,000.00	5,952,960.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,953,200.00
	MEXICAN BONOS 7.5	5,300,000.00	5,401,548.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,033,100.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,028,410.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,091,560.00
	MEXICAN BONOS 8	4,500,000.00	4,666,365.00

	MEXICAN BONOS 8.5	1,000,000.00	1,089,680.00
	MEXICAN BONOS 8.5	2,000,000.00	2,188,280.00
	メキシコペソ 小計	36,300,000.00	36,923,883.00 (205,666,028)
ユーロ	BELGIAN 0.8	100,000.00	107,332.00
	BELGIAN 0.8	300,000.00	326,100.00
	BELGIAN 0.8	200,000.00	218,216.00
	BELGIAN 0304 5	250,000.00	432,407.50
	BELGIAN 0308 4	300,000.00	335,805.00
	BELGIAN 0320 4.25	200,000.00	353,702.00
	BELGIAN 0321 4.25	100,000.00	110,063.00
	BELGIAN 0324 4.5	100,000.00	132,554.00
	BELGIAN 0328 2.25	400,000.00	444,052.00
	BELGIAN 0332 2.6	100,000.00	115,140.00
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	105,155.00
	BELGIAN 1	200,000.00	218,994.00
	BELGIAN 1	250,000.00	279,745.00
	BELGIAN 1.9	400,000.00	508,860.00
	BELGIAN 2.15	200,000.00	283,962.00
	BELGIAN 3.75	300,000.00	527,229.00
	BTPS 0.35	400,000.00	404,788.00
	BTPS 0.45	500,000.00	506,045.00
	BTPS 0.65	200,000.00	202,062.00
	BTPS 0.65	300,000.00	307,113.00
	BTPS 0.95	600,000.00	619,236.00
	BTPS 1.25	100,000.00	105,133.00
	BTPS 1.35	350,000.00	362,971.00
	BTPS 1.45	200,000.00	208,976.00
	BTPS 1.45	500,000.00	529,720.00
	BTPS 1.5	1,000,000.00	1,062,010.00
	BTPS 1.6	100,000.00	107,387.00
	BTPS 1.65	1,100,000.00	1,171,379.00
	BTPS 1.85	300,000.00	322,566.00
	BTPS 2.05	150,000.00	166,425.00
	BTPS 2.2	400,000.00	447,716.00
	BTPS 2.25	650,000.00	733,661.50
	BTPS 2.3	2,100,000.00	2,208,276.00
	BTPS 2.45	300,000.00	347,016.00
	BTPS 2.5	600,000.00	667,188.00
	BTPS 2.7	800,000.00	958,160.00
	BTPS 2.8	200,000.00	238,192.00
	BTPS 3.45	200,000.00	269,976.00
	BTPS 3.75	700,000.00	741,111.00

BTPS 3.75	400,000.00	426,124.00	
BTPS 3.75	400,000.00	467,812.00	
BTPS 4	450,000.00	620,550.00	
BTPS 4.5	200,000.00	251,446.00	
BTPS 4.75	300,000.00	329,073.00	
BTPS 4.75	500,000.00	676,110.00	
BTPS 4.75	200,000.00	316,322.00	
BTPS 5	200,000.00	225,250.00	
BTPS 5	400,000.00	597,316.00	
BTPS 5	250,000.00	392,235.00	
BTPS 5	200,000.00	314,550.00	
BTPS 5.25	200,000.00	284,262.00	
BTPS 5.5	100,000.00	117,138.00	
BTPS 5.75	200,000.00	310,644.00	
BTPS 6	400,000.00	615,588.00	
BTPS 6.5	700,000.00	1,024,212.00	
BTPS 9	550,000.00	749,617.00	
BUNDESUBL-173 0	500,000.00	505,715.00	
BUNDESUBL-174 0	200,000.00	203,136.00	
DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	157,354.50	
DEUTSCHLAND REP 0.25	100,000.00	106,864.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	429,404.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	250,000.00	269,710.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	350,000.00	381,909.50	
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	326,244.00	
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	220,786.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	100,000.00	134,321.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	427,548.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	300,000.00	325,482.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	664,170.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	107,194.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	111,239.00	
DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	266,175.00	
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	222,132.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	200,000.00	211,864.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	200,000.00	208,704.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	400,000.00	650,576.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	400,000.00	666,184.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	100,000.00	107,202.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	950,000.00	1,678,336.50	
DEUTSCHLAND REP 4	100,000.00	174,819.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	300,000.00	609,984.00	

DEUTSCHLAND REP 5.5	500,000.00	847,175.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	627,529.60
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	261,354.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	100,000.00	156,977.00
FINNISH GOV'T 0.75	100,000.00	110,365.00
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	108,372.00
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	116,557.00
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	323,688.00
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	106,977.00
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	224,260.00
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	154,372.00
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	127,438.00
FRANCE O.A.T. 0	500,000.00	504,965.00
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	708,309.00
FRANCE O.A.T. 0	500,000.00	508,570.00
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	203,812.00
FRANCE O.A.T. 0.25	500,000.00	505,375.00
FRANCE O.A.T. 0.25	100,000.00	104,789.00
FRANCE O.A.T. 0.5	500,000.00	529,515.00
FRANCE O.A.T. 0.5	1,800,000.00	1,923,642.00
FRANCE O.A.T. 0.75	100,000.00	109,203.00
FRANCE O.A.T. 0.75	300,000.00	327,849.00
FRANCE O.A.T. 1	1,600,000.00	1,749,632.00
FRANCE O.A.T. 1	450,000.00	498,096.00
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	348,972.00
FRANCE O.A.T. 1.25	700,000.00	815,689.00
FRANCE O.A.T. 1.5	650,000.00	769,249.00
FRANCE O.A.T. 1.75	650,000.00	708,961.50
FRANCE O.A.T. 1.75	500,000.00	632,885.00
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	266,396.00
FRANCE O.A.T. 2	100,000.00	136,017.00
FRANCE O.A.T. 2.25	700,000.00	764,813.00
FRANCE O.A.T. 2.25	200,000.00	227,160.00
FRANCE O.A.T. 2.5	150,000.00	155,238.00
FRANCE O.A.T. 2.5	400,000.00	513,556.00
FRANCE O.A.T. 2.75	800,000.00	1,005,624.00
FRANCE O.A.T. 3	250,000.00	274,375.00
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	433,560.00
FRANCE O.A.T. 3.25	400,000.00	661,860.00
FRANCE O.A.T. 3.5	950,000.00	1,204,391.00
FRANCE O.A.T. 3.75	200,000.00	214,388.00
FRANCE O.A.T. 4	100,000.00	201,241.00
FRANCE O.A.T. 4	300,000.00	630,417.00

FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	722,964.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	300,000.00	556,836.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	400,000.00	684,664.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	200,000.00	311,696.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	700,000.00	1,230,523.00	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	561,104.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	267,208.00	
IRISH GOVT 0.8	100,000.00	103,334.00	
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	119,433.00	
IRISH GOVT 2	300,000.00	385,374.00	
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	234,858.00	
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	231,192.00	
IRISH GOVT 5	600,000.00	636,324.00	
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	395,079.00	
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	305,187.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	419,964.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	321,888.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	700,000.00	768,334.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	110,503.00	
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	452,156.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	100,000.00	108,590.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	100,000.00	136,855.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	100,000.00	172,745.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	400,000.00	429,264.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	230,534.00	
NETHERLANDS GOVT 4	450,000.00	772,879.50	
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	603,180.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	700,000.00	747,586.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	400,000.00	436,856.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	221,080.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	100,000.00	128,438.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	300,000.00	334,005.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	300,000.00	329,505.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	150,000.00	201,943.50	
REP OF AUSTRIA 3.15	100,000.00	167,676.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	226,094.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	216,728.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	221,663.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	200,000.00	338,948.00	
SPANISH GOV'T 0.05	100,000.00	100,705.00	
SPANISH GOV'T 0.25	1,300,000.00	1,329,107.00	
SPANISH GOV'T 0.35	1,700,000.00	1,742,313.00	



	SPANISH GOV'T 0.4	500,000.00	510,900.00
	SPANISH GOV'T 0.45	300,000.00	307,830.00
	SPANISH GOV'T 0.75	1,600,000.00	1,636,288.00
	SPANISH GOV'T 1.3	200,000.00	218,330.00
	SPANISH GOV'T 1.4	100,000.00	110,964.00
	SPANISH GOV'T 1.45	200,000.00	222,110.00
	SPANISH GOV'T 1.45	100,000.00	111,678.00
	SPANISH GOV'T 1.5	300,000.00	333,036.00
	SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	328,980.00
	SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	678,486.00
	SPANISH GOV'T 2.35	500,000.00	620,070.00
	SPANISH GOV'T 2.7	150,000.00	205,585.50
	SPANISH GOV'T 2.75	500,000.00	575,180.00
	SPANISH GOV'T 2.9	300,000.00	422,277.00
	SPANISH GOV'T 3.45	100,000.00	164,441.00
	SPANISH GOV'T 3.8	200,000.00	237,450.00
	SPANISH GOV'T 4.2	170,000.00	266,765.70
	SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	319,660.00
	SPANISH GOV'T 4.7	200,000.00	348,172.00
	SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	611,190.00
	SPANISH GOV'T 4.85	200,000.00	211,992.00
	SPANISH GOV'T 4.9	100,000.00	176,332.00
	SPANISH GOV'T 5.15	700,000.00	1,015,847.00
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	380,470.00
	SPANISH GOV'T 5.5	200,000.00	219,366.00
	SPANISH GOV'T 5.75	300,000.00	501,039.00
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	689,880.00
	SPANISH GOV'T 6	500,000.00	771,010.00
	ユーロ 小計	70,030,000.00	85,085,985.80 (10,136,293,488)
英債券	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	500,360.00
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	202,012.00
	UK TSY GILT 1	250,000.00	255,860.00
	UK TSY GILT 1.25	150,000.00	158,193.00
	UK TSY GILT 1.5	150,000.00	151,849.50
	UK TSY GILT 1.5	400,000.00	427,500.00
	UK TSY GILT 1.5	200,000.00	217,184.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	490,252.50
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	311,208.00
	UK TSY GILT 1.75	200,000.00	223,640.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	363,648.00
	UK TSY GILT 2	150,000.00	163,767.00
	UK TSY GILT 2.25	250,000.00	267,357.50

	UK TSY GILT 2.5	200,000.00	305,468.00	
	UK TSY GILT 2.75	300,000.00	333,426.00	
	UK TSY GILT 3.25	1,200,000.00	1,739,448.00	
	UK TSY GILT 3.5	400,000.00	773,384.00	
	UK TSY GILT 3.75	200,000.00	206,096.00	
	UK TSY GILT 3.75	250,000.00	265,877.50	
	UK TSY GILT 3.75	50,000.00	86,363.50	
	UK TSY GILT 4	250,000.00	491,440.00	
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	390,057.00	
	UK TSY GILT 4.25	350,000.00	496,814.50	
	UK TSY GILT 4.25	450,000.00	676,957.50	
	UK TSY GILT 4.25	250,000.00	400,797.50	
	UK TSY GILT 4.25	100,000.00	173,011.00	
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	359,432.00	
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	389,572.00	
	UK TSY GILT 4.5	150,000.00	226,263.00	
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	339,212.00	
	UK TSY GILT 4.75	300,000.00	431,451.00	
	UK TSY GILT 4.75	130,000.00	215,177.30	
	UK TSY GILT 5	150,000.00	186,549.00	
	UK TSY GILT 8	300,000.00	338,496.00	
	英債券 小計	9,430,000.00	12,558,124.30 (1,687,183,999)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	700,000.00	760,711.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	800,000.00	877,416.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	600,000.00	651,018.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,100,000.00	1,285,438.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	2,000,000.00	2,222,280.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	700,000.00	1,120,840.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	1,000,000.00	1,067,500.00	
	スウェーデンクローナ 小計	6,900,000.00	7,985,203.00 (89,434,273)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,010,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,022,300.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	300,000.00	307,110.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	1,000,000.00	1,051,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	600,000.00	643,920.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	1,000,000.00	1,042,386.00	
	ノルウェークローネ 小計	4,900,000.00	5,077,916.00 (61,341,225)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	950,000.00	1,036,355.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	500,000.00	549,900.00	

	DENMARK - BULLET 1.5	800,000.00	875,840.00
	DENMARK - BULLET 1.75	400,000.00	461,520.00
	DENMARK - BULLET 3	1,500,000.00	1,623,600.00
	DENMARK - BULLET 4.5	1,700,000.00	3,351,890.00
	DENMARK - BULLET 7	520,000.00	730,236.00
	デンマーククローネ 小計	6,370,000.00	8,629,341.00 (137,637,988)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	700,000.00	702,590.00
	POLAND GOVT BOND 2	200,000.00	201,100.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	900,000.00	926,370.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,100,000.00	1,134,023.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	400,000.00	426,840.00
	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	783,734.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	100,000.00	132,141.00
	ポーランドズロチ 小計	5,200,000.00	5,499,198.00 (151,282,936)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2	300,000.00	306,570.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	600,000.00	654,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	432,862.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	281,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	454,478.40
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	100,000.00	119,090.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	253,901.20
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	250,000.00	280,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	450,000.00	535,230.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	256,780.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	404,850.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	600,000.00	722,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	350,000.00	490,455.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	500,000.00	580,975.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	600,000.00	647,556.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	600,000.00	680,910.00
	オーストラリアドル 小計	6,100,000.00	7,103,428.40 (527,429,558)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	400,000.00	396,984.00
	SINGAPORE GOV'T 2.125	200,000.00	205,100.00
	SINGAPORE GOV'T 2.25	200,000.00	202,160.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	311,850.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	112,200.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	225,742.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	300,000.00	329,455.50

	SINGAPORE GOV'T 3	100,000.00	106,300.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	300,000.00	312,900.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	295,438.75	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	400,000.00	449,600.00	
	シンガポールドル 小計	2,750,000.00	2,947,730.75	(231,897,978)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	10,000,000.00	7,081,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	10,800,000.00	9,200,520.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.75	3,500,000.00	3,547,250.00	
	南アフリカランド 小計	24,300,000.00	19,828,770.00	(146,336,322)
	合計		26,515,704,965	(26,515,704,965)

(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	47.8%	47.6%
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	38.4%	38.2%
英ポンド	国債証券 34銘柄	6.4%	6.4%
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	0.6%	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。

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

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

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

(純資産計算書)

区分	2018年10月31日現在
	金額(千米ドル)

債券	14,469,132
短期金融資産	62,171
投資総額	14,531,303
その他資産及び負債	213,427
純資産額	14,744,730

## (1口当たり情報)

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

**【中間財務諸表】**

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）】

## （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17日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		458,545
金銭信託		35,036,270
投資信託受益証券		16,217,202
親投資信託受益証券		1,961,855,990
未収入金		25,000,000
流動資産合計		2,038,568,007
資産合計		2,038,568,007
負債の部		
流動負債		
未払解約金		14,104,700
未払受託者報酬		289,659
未払委託者報酬		8,206,997
その他未払費用		58,698
流動負債合計		22,660,054
負債合計		22,660,054
純資産の部		
元本等		
元本		2,081,128,443
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		65,220,490
元本等合計		2,015,907,953
純資産合計		2,015,907,953
負債純資産合計		2,038,568,007

## （ 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18日 至 令和 2年 3月17日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	327,128
受取利息	178
有価証券売買等損益	130,069,217
為替差損益	313,571
営業収益合計	130,055,482
<b>営業費用</b>	
支払利息	8,891
受託者報酬	289,659
委託者報酬	8,206,997
その他費用	73,218
営業費用合計	8,578,765
営業利益又は営業損失（ ）	138,634,247
経常利益又は経常損失（ ）	138,634,247
中間純利益又は中間純損失（ ）	138,634,247
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（ ）	159,567
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	42,966,500
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,005,881
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	36,005,881
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,718,191
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,718,191
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（ ）	65,220,490



## (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18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 9月18日から令和 2年 3月17日までとなっております。</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17日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		2,081,128,443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	65,220,490円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9687円

項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 9,687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17日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月17日現在)
期首元本額	1,314,018,951円
期中追加設定元本額	931,929,330円
期中一部解約元本額	164,819,838円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）】

## （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17日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		460,382
金銭信託		4,844,676
投資信託受益証券		16,278,246
親投資信託受益証券		905,980,485
未収入金		25,000,000
流動資産合計		952,563,789
資産合計		952,563,789
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,153,937
未払受託者報酬		142,966
未払委託者報酬		4,050,591
その他未払費用		28,880
流動負債合計		6,376,374
負債合計		6,376,374
純資産の部		
元本等		
元本		1,018,462,661
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		72,275,246
元本等合計		946,187,415
純資産合計		946,187,415
負債純資産合計		952,563,789

## （ 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18日 至 令和 2年 3月17日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	326,697
受取利息	180
有価証券売買等損益	105,717,659
為替差損益	345,857
営業収益合計	105,736,639
<b>営業費用</b>	
支払利息	4,109
受託者報酬	142,966
委託者報酬	4,050,591
その他費用	44,520
営業費用合計	4,242,186
営業利益又は営業損失（ ）	109,978,825
経常利益又は経常損失（ ）	109,978,825
中間純利益又は中間純損失（ ）	109,978,825
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（ ）	724,013
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	20,483,351
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,118,630
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	20,118,630
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,174,389
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,174,389
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（ ）	72,275,246

## ( 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18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 9月18日から令和 2年 3月17日までとなっております。</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17日現在 )	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		1,018,462,661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	72,275,246円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9290円

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 9,290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17日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
期首元本額	660,039,772円
期中追加設定元本額	421,860,318円
期中一部解約元本額	63,437,429円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)】

## (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17日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	238,052
金銭信託	17,036,831
投資信託受益証券	52,354,909
親投資信託受益証券	1,817,681,268
未収入金	53,000,000
流動資産合計	1,940,311,060
資産合計	1,940,311,060
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,320,070
未払受託者報酬	295,413
未払委託者報酬	8,370,073
その他未払費用	59,784
流動負債合計	11,045,340
負債合計	11,045,340
純資産の部	
元本等	
元本	2,137,461,982
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	208,196,262
元本等合計	1,929,265,720
純資産合計	1,929,265,720
負債純資産合計	1,940,311,060

## （ 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18日 至 令和 2年 3月17日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	1,021,515
受取利息	410
有価証券売買等損益	312,064,765
為替差損益	1,061,179
営業収益合計	312,104,019
<b>営業費用</b>	
支払利息	9,174
受託者報酬	295,413
委託者報酬	8,370,073
その他費用	84,017
営業費用合計	8,758,677
営業利益又は営業損失（ ）	320,862,696
経常利益又は経常損失（ ）	320,862,696
中間純利益又は中間純損失（ ）	320,862,696
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（ ）	2,811,474
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	57,559,319
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,779,279
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	64,779,279
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,860,690
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,860,690
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（ ）	208,196,262



## ( 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18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 9月18日から令和 2年 3月17日までとなっております。</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17日現在 )	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		2,137,461,982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	208,196,262円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9026円

項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 9,026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17日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和 2年 3月17日現在)
期首元本額	1,298,077,460円
期中追加設定元本額	976,184,247円
期中一部解約元本額	136,799,725円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）】

## （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17日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		169,481
金銭信託		13,269,864
投資信託受益証券		28,985,452
親投資信託受益証券		723,768,059
未収入金		11,000,000
流動資産合計		777,192,856
資産合計		777,192,856
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,575,952
未払受託者報酬		129,577
未払委託者報酬		3,671,390
その他未払費用		26,184
流動負債合計		8,403,103
負債合計		8,403,103
純資産の部		
元本等		
元本		888,834,521
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		120,044,768
元本等合計		768,789,753
純資産合計		768,789,753
負債純資産合計		777,192,856

## （ 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18日 至 令和 2年 3月17日
営業収益	
受取配当金	596,471
受取利息	282
有価証券売買等損益	161,705,749
為替差損益	568,601
営業収益合計	161,677,597
営業費用	
支払利息	3,941
受託者報酬	129,577
委託者報酬	3,671,390
その他費用	44,215
営業費用合計	3,849,123
営業利益又は営業損失（ ）	165,526,720
経常利益又は経常損失（ ）	165,526,720
中間純利益又は中間純損失（ ）	165,526,720
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（ ）	1,635,648
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,670,078
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,367,488
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	23,367,488
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,919,966
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,919,966
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（ ）	120,044,768

## ( 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18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 9月18日から令和 2年 3月17日までとなっております。</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17日現在 )	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		888,834,521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	120,044,768円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.8649円

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 8,649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17日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
期首元本額	607,629,422円
期中追加設定元本額	356,949,717円
期中一部解約元本額	75,744,618円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

## (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17日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,607,954
金銭信託	11,910,057
投資信託受益証券	39,159,356
親投資信託受益証券	720,232,337
未収入金	3,000,000
流動資産合計	775,909,704
<b>資産合計</b>	<b>775,909,704</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	1,386,770
未払解約金	2,485,263
未払受託者報酬	138,393
未払委託者報酬	3,921,061
その他未払費用	28,010
流動負債合計	7,959,497
<b>負債合計</b>	<b>7,959,497</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	930,688,291
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	162,738,084
元本等合計	767,950,207
<b>純資産合計</b>	<b>767,950,207</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>775,909,704</b>

## （ 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18日 至 令和 2年 3月17日
<b>営業収益</b>	
受取配当金	799,808
受取利息	372
有価証券売買等損益	199,361,925
為替差損益	713,877
営業収益合計	199,275,622
<b>営業費用</b>	
支払利息	4,853
受託者報酬	138,393
委託者報酬	3,921,061
その他費用	49,077
営業費用合計	4,113,384
営業利益又は営業損失（ ）	203,389,006
経常利益又は経常損失（ ）	203,389,006
中間純利益又は中間純損失（ ）	203,389,006
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	5,281,321
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	29,069,980
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,802,188
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	24,802,188
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,939,925
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,939,925
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（ ）	162,738,084



## (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18日 至 令和 2年 3月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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> <p>(2) 計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、令和 1年 9月18日から令和 2年 3月17日までとなっております。</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17日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		930,688,291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	162,738,084円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.8251円

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 8,251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17日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第3期中間計算期間 (令和2年3月17日現在)
期首元本額	729,433,180円
期中追加設定元本額	379,799,066円
期中一部解約元本額	178,543,955円

## (参考)

「三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)」「三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)」

「三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)」は、「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」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 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17日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	5,871,055,916
株式	134,114,479,760
派生商品評価勘定	639,000
未収入金	22,977,800
未収配当金	297,957,827
前払金	185,260,000
差入委託証拠金	293,305,000
流動資産合計	140,785,675,303
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	186,132,200
未払金	3,781,810,318
未払解約金	330,297,594
その他未払費用	131,031
流動負債合計	4,298,371,143
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	67,307,459,074
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	69,179,845,086
元本等合計	136,487,304,160
純資産合計	
負債純資産合計	

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和1年 9月18日 至 令和2年 3月17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17日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: right;">株式 2,544,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,307,459,074口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.0278円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 20,278円)</p>

## (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17日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（令和 2年 3月17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	2,790,973,200	-	2,605,480,000	185,493,200
	東証株価指数先物	2,790,973,200	-	2,605,480,000	185,493,200
	合計	2,790,973,200	-	2,605,480,000	185,493,200

（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17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	66,708,868,107円
同期中における追加設定元本額	9,220,804,359円
同期中における一部解約元本額	8,622,213,392円
令和 2年 3月17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	9,869,589,202円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,065,413,730円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,690,717,833円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,250,468,501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)	8,324,099円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,195,535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)	73,482,737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)	123,816,251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)	84,250,646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)	178,570,815円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,818,600,182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	12,524,235,783円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	547,577,365円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	574,241,693円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	432,478,373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	14,790,979円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	80,559,004円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	71,084,064円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	206,496,995円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,423,501円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	124,415,427円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	15,994,398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 ・ 国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,033,170,805円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	25,772,819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 >	3,218,481,948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 >	2,526,445,602円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	9,063,598,186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 >	58,798,293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 >	222,634,874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 >	829,744円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	909,708,544円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	58,635,670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 >	378,883,544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 >	1,120,435,028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 >	965,639,461円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,053,861,963円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,271,854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 >	67,131,596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 >	78,822,813円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	47,573,665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 >	23,116,409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 >	198,197,206円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	378,808,119円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	120,734,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	66,425,939円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	10,229,623円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	71,339,651円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	965,537,852円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	202,593,349円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	17,198,789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>	1,050,498,263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>	214,191,985円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,560,597,946円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	111,570,862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>	10,043,124円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	57,000,228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>	63,528,961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>	116,598,821円
合計	67,307,459,074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17日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	3,222,314,236
金銭信託	594,426,848
株式	151,147,889,418
投資証券	4,056,600,185
派生商品評価勘定	9,105,666
未収入金	55,409,474
未収配当金	389,330,949
前払金	408,640,226
差入委託証拠金	1,465,412,324
流動資産合計	161,349,129,326
資産合計	
161,349,129,326	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	416,649,542
未払金	92,732,082
未払解約金	661,936,329
その他未払費用	45,417
流動負債合計	1,171,363,370
負債合計	
1,171,363,370	
純資産の部	
元本等	
元本	56,948,696,818
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	103,229,069,138
元本等合計	160,177,765,956
純資産合計	
160,177,765,956	

（令和 2年 3月17日現在）

負債純資産合計

161,349,129,326

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 2年 3月17日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	56,948,696,818口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8127円
	(10,000口当たりの純資産額 28,127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17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17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	6,006,652,939	-	5,598,012,713	408,640,226
	SPMINI 2006	4,588,545,832	-	4,192,221,423	396,324,409
	DJ EUR 2006	924,918,176	-	917,600,710	7,317,466
	FTSE 2006	289,124,083	-	292,130,572	3,006,489
	SPI200 2006	204,064,848	-	196,060,008	8,004,840
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	845,939,150	-	846,011,500	72,350
	米ドル	505,094,400	-	505,141,800	47,400
	ユーロ	285,744,000	-	285,768,000	24,000
	英ポンド	46,962,000	-	46,969,200	7,200
	オーストラリアドル	8,138,750	-	8,132,500	6,250
	売建	194,651,400	-	193,627,400	1,024,000
	米ドル	148,716,100	-	148,146,200	569,900
	カナダドル	24,729,600	-	24,355,200	374,400
	スイスフラン	12,377,200	-	12,366,200	11,000
	スウェーデンクローナ	5,505,000	-	5,450,000	55,000

ノルウェークローネ	630,000	-	622,200	7,800
デンマーククローネ	1,113,000	-	1,115,100	2,100
香港ドル	826,200	-	822,600	3,600
シンガポールドル	754,300	-	749,900	4,400
合計	7,047,243,489	-	6,637,651,613	407,543,876

## (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17日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,965,014,742円
同期中における追加設定元本額	16,404,043,095円
同期中における一部解約元本額	10,420,361,019円
令和 2年 3月17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	24,712,690,668円
三井住友・DC 年金バランス30 (債券重点型)	360,972,229円
三井住友・DC 年金バランス50 (標準型)	1,367,547,743円
三井住友・DC 年金バランス70 (株式重点型)	858,813,774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)	60,465,353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)	2,447,195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)	9,005,639円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	24,145,888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)	52,685,398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)	39,568,834円

(令和2年3月17日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	89,594,163円
外国株式指数ファンド	515,822,377円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,528,356,759円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	315,107,752円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	327,951,458円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	246,185,251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	8,267,139円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,033,254円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,976,671円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	134,891,975円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	68,608,744円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	83,162,680円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,225,729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	1,702,140円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,315,802,166円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	8,470,560円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	66,348,893円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,365,122,529円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,424,280,402円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,009,796,442円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	19,472,394円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	97,544,382円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	403,544円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	708,183,743円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	60,551,848円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	171,359,262円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	757,954,917円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	620,419,564円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,469,018,795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)	298,703,185円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	143,229,980円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	16,310,134円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	12,126,668円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,738,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	42,434,322円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	100,696,014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>	693,097,936円

（令和 2年 3月17日現在）	
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>	142,977,401円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,704,698,326円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	252,747,609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>	6,000,355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>	34,038,140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>	37,858,683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>	120,491,074円
合計	56,948,696,818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17日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	122,834,631
金銭信託	1,742,821,307
株式	3,426,601,024
投資信託受益証券	375,547,731
投資証券	103,968,608
派生商品評価勘定	52,535,214
未収入金	108,550,528
未収配当金	9,619,101
前払金	323,536,330
差入委託証拠金	446,726,758
流動資産合計	6,712,741,232

##### 資産合計

6,712,741,232

#### 負債の部

##### 流動負債

派生商品評価勘定	323,536,330
未払金	199,042,299
未払解約金	53,729,727
その他未払費用	57,198
流動負債合計	576,365,554

##### 負債合計

576,365,554

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	6,060,618,988
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	75,756,690
元本等合計	6,136,375,678

##### 純資産合計

6,136,375,678

##### 負債純資産合計

6,712,741,232

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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17日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		6,060,618,988口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0125円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,125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17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)

(令和 2年 3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,554,894,459	-	2,231,358,129	323,536,330
	MSCIE 2006	2,554,894,459	-	2,231,358,129	323,536,330
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,808,744,147	-	1,860,613,553	51,869,406
	米ドル	1,808,744,147	-	1,860,613,553	51,869,406
	売建	208,044,147	-	207,378,339	665,808
	米ドル	208,000,000	-	207,335,025	664,975
	メキシコペソ	44,147	-	43,314	833
	合計	4,571,682,753	-	4,299,350,021	271,001,116

(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17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	5,806,463,130円
同期中における追加設定元本額	1,900,204,243円
同期中における一部解約元本額	1,646,048,385円
令和 2年 3月17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	2,339,760,783円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,713,412,795円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	547,946,643円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	577,860,141円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	435,078,055円
イオン・バランス戦略ファンド	47,569,121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)	67,278,560円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	121,702,165円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,363,239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>	18,411,695円
合計	6,060,618,988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17日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託

89,713,216

投資証券

4,437,646,490

（令和 2年 3月17日現在）

未収入金	35,140,375
未収配当金	75,122,924
前払金	17,705,500
差入委託証拠金	8,970,000
流動資産合計	4,664,298,505
資産合計	4,664,298,505
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,718,700
未払金	56,923,391
未払解約金	31,651,892
その他未払費用	1,455
流動負債合計	106,295,438
負債合計	106,295,438
純資産の部	
元本等	
元本	2,415,356,232
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,142,646,835
元本等合計	4,558,003,067
純資産合計	4,558,003,067
負債純資産合計	4,664,298,505

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17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	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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 2年 3月17日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		2,415,356,232口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.8871円
	(10,000口当たりの純資産額)	18,871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17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)

(令和 2年 3月17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	108,768,700	-	91,050,000	17,718,700
	東証REIT指数先物	108,768,700	-	91,050,000	17,718,700
合計		108,768,700	-	91,050,000	17,718,700

## （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17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	3,000,687,352円
同期中における追加設定元本額	1,378,065,482円
同期中における一部解約元本額	1,963,396,602円
令和 2年 3月17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）	299,902,782円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	415,068,044円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	309,878,304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	1,099,212,657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）	15,302,563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>	385,925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>	14,049,600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>	59,639,759円
合計	2,415,356,232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17日現在）

資産の部  
流動資産

（令和 2年 3月17日現在）

預金	68,292,867
金銭信託	7,136,244
投資証券	4,710,729,905
派生商品評価勘定	39,834
未収入金	247,920
未収配当金	13,733,605
流動資産合計	4,800,180,375
資産合計	4,800,180,375
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,820
未払金	75,476,969
未払解約金	6,369,502
その他未払費用	310
流動負債合計	81,861,601
負債合計	81,861,601
純資産の部	
元本等	
元本	3,063,238,008
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,655,080,766
元本等合計	4,718,318,774
純資産合計	4,718,318,774
負債純資産合計	4,800,180,375

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17日
	受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 2年 3月17日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		3,063,238,008口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5403円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,403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17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)

(令和 2年 3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	99,200,000	-	99,188,014	11,986
	米ドル	76,000,000	-	76,002,139	2,139

カナダドル	3,000,000	-	2,998,699	1,301
ユーロ	3,000,000	-	3,000,175	175
英ポンド	4,000,000	-	4,000,520	520
オーストラリアドル	4,000,000	-	3,996,744	3,256
香港ドル	1,200,000	-	1,198,688	1,312
シンガポールドル	8,000,000	-	7,991,049	8,951
売建	5,774,200	-	5,737,200	37,000
ユーロ	1,190,800	-	1,190,700	100
英ポンド	1,317,400	-	1,304,800	12,600
オーストラリアドル	1,974,000	-	1,952,100	21,900
ニュージーランドドル	1,292,000	-	1,289,600	2,400
合計	104,974,200	-	104,925,214	25,014

## (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17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	2,518,654,861円
同期中における追加設定元本額	1,103,030,456円
同期中における一部解約元本額	558,447,309円
令和 2年 3月17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	2,782,237,308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

(令和 2年 3月17日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	13,567,883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)	16,693,757円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,332,137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>	441,353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>	11,147,167円
合計	3,063,238,008円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(令和 2年 3月17日現在)

## 資産の部

## 流動資産

金銭信託	2,626,381,937
国債証券	97,103,402,420
地方債証券	8,538,398,780
特殊債証券	13,105,529,991
社債証券	6,488,004,000
未収入金	6,942,911,870
未収利息	472,287,652
前払費用	11,149,369

流動資産合計 135,288,066,019

## 資産合計 135,288,066,019

## 負債の部

## 流動負債

未払解約金	3,068,590,000
その他未払費用	41,663

流動負債合計 3,068,631,663

## 負債合計 3,068,631,663

## 純資産の部

## 元本等

元本	102,595,681,017
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	29,623,753,339

元本等合計 132,219,434,356

## 純資産合計 132,219,434,356

## 負債純資産合計 135,288,066,019

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 2年 3月17日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		102,595,681,017口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2887円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,887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17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、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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（令和 2年 3月17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	111,291,274,213円
同期中における追加設定元本額	11,730,082,452円
同期中における一部解約元本額	20,425,675,648円
令和 2年 3月17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）	4,844,026,015円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,986,548,684円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,665,686,025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）	728,167,903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）	51,070,605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）	179,375,494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）	335,971,698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）	320,415,339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）	127,753,039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）	235,314,399円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	132,800,287円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,214,076,829円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	914,603,809円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	326,745,753円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	13,563,512円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,037,194,948円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	343,028,951円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	444,863,751円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	79,107,642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N I S A ・ 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	2,804,870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＞	5,908,244,271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＞	15,550,317,780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＞	6,517,490,925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＞	15,545,770,905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＞	316,003,775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＞	518,496,847円



（令和 2年 3月17日現在）	
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,518,027円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	228,035,914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>	103,554,378円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,860,931,348円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,971,673,161円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,450,097,326円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,189,109,742円
SMAM・バランスVA株40T<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・VAS（適格機関投資家専用）	1,339,496,695円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	437,591,506円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	618,265,744円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	167,780,424円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	40,951,163円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,729,692,496円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,250,269,949円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	899,153,910円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	225,141,877円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	17,318,813円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	306,314,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,550,073,937円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	259,339,737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>	301,217,635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>	698,440,687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>	791,450,901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>	4,759,536,160円
合計	102,595,681,017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17日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	544,515,436
金銭信託	766,592,830
国債証券	156,511,320,668
派生商品評価勘定	2,730,756
未収入金	4,079,303,604
未収利息	1,057,100,012
前払費用	29,956,550
流動資産合計	162,991,519,856
資産合計	162,991,519,856
負債の部	

（令和 2年 3月17日現在）

流動負債	
派生商品評価勘定	26,506,332
未払解約金	3,942,720,854
その他未払費用	18,536
流動負債合計	3,969,245,722
負債合計	3,969,245,722
純資産の部	
元本等	
元本	87,269,686,461
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,752,587,673
元本等合計	159,022,274,134
純資産合計	159,022,274,134
負債純資産合計	162,991,519,856

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17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17日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	87,269,686,461口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8222円

項目	(令和 2年 3月17日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 18,222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17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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(令和 2年 3月17日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	17,509,325	-	17,473,337	35,988
	米ドル	447,223	-	447,508	285
	ユーロ	14,970,003	-	14,986,883	16,880
	英ポンド	1,847,457	-	1,795,387	52,070
	スウェーデンクローナ	144,067	-	142,895	1,172
	デンマーククローネ	100,575	-	100,664	89
	売建	4,073,045,223	-	4,096,784,811	23,739,588
	米ドル	1,989,215,642	-	2,002,785,291	13,569,649
	カナダドル	70,247,914	-	69,842,703	405,211
	ユーロ	1,526,290,942	-	1,538,410,952	12,120,010
	英ポンド	265,360,518	-	263,476,921	1,883,597
	スウェーデンクローナ	35,707,240	-	35,671,699	35,541
	デンマーククローネ	32,085,807	-	32,276,059	190,252

オーストラリアドル	72,477,246	-	72,093,636	383,610
シンガポールドル	53,177,233	-	53,455,208	277,975
南アフリカランド	28,482,681	-	28,772,342	289,661
合計	4,090,554,548	-	4,114,258,148	23,775,576

## (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17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	85,315,961,664円
同期中における追加設定元本額	14,756,864,580円
同期中における一部解約元本額	12,803,139,783円
令和 2年 3月17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	21,776,430,413円
三井住友・DC 年金バランス30 (債券重点型)	610,028,024円
三井住友・DC 年金バランス50 (標準型)	1,615,667,460円
三井住友・DC 年金バランス70 (株式重点型)	797,777,413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)	9,205,938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)	32,202,823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)	88,259,689円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	122,589,601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)	68,058,856円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	140,056,346円
三井住友・DC 年金バランスゼロ (債券型)	25,266,351円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	129,275,910円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	150,107,013円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	117,187,526円
イオン・バランス戦略ファンド	26,141,038円

(令和 2年 3月17日現在)	
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	6,258,244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)	116,566,938円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	43,012,179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・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	44,535,678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3 0 (債券重点型)	53,592円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	112,044円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	51,364円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	1,230,393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>	2,020,954,927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>	9,653,133,256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>	4,978,114,269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>	10,984,114,021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>	37,598,004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>	92,617,967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>	502,724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>	629,960,681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>	109,773,191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>	1,147,878,661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>	1,385,896,832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>	1,719,503,254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>	5,534,476,186円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	1,555,075円
S M A M ・外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	9,785,373,472円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	385,119,524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>	150,947,915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>	102,843,371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>	35,912,561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>	12,525,068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>	128,196,997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>	486,454,418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>	151,049,828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>	49,817,259円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,538,995円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	1,250,004,591円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	19,121,083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>	1,991,282,156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>	1,249,044,146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>	5,009,414,541円

（令和 2年 3月17日現在）	
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 >	531,234,235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 >	89,286,115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 >	46,684,452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 >	342,450,340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 >	393,969,068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 >	535,445,697円
合計	87,269,686,461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17日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	46,166,854
金銭信託	203,449,589
国債証券	24,712,724,751
派生商品評価勘定	418,230,399
未収利息	129,147,253
前払費用	41,731,154
流動資産合計	25,551,450,000
資産合計	
	25,551,450,000
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,211,928
未払解約金	219,000,000
その他未払費用	9,498
流動負債合計	221,221,426
負債合計	
	221,221,426
純資産の部	
元本等	
元本	16,759,184,576
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,571,043,998
元本等合計	25,330,228,574
純資産合計	
	25,330,228,574
負債純資産合計	
	25,551,450,000

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年 9月18日 至 令和 2年 3月17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17日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		16,759,184,576口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5114円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,114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17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17日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(令和 2年 3月17日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,311,644,231	-	24,895,625,760	416,018,471
	米ドル	12,311,306,477	-	12,152,724,400	158,582,077
	カナダドル	484,007,147	-	455,760,000	28,247,147
	メキシコペソ	214,620,967	-	183,883,600	30,737,367
	ユーロ	9,444,627,583	-	9,408,140,000	36,487,583
	英ポンド	1,615,732,673	-	1,522,375,400	93,357,273
	スウェーデンクローナ	72,663,496	-	70,350,100	2,313,396
	ノルウェークローネ	61,477,813	-	55,372,500	6,105,313
	デンマーククローネ	125,212,850	-	124,763,760	449,090
	ポーランドズロチ	145,279,041	-	140,500,800	4,778,241
	オーストラリアドル	477,967,185	-	440,874,700	37,092,485
	シンガポールドル	221,854,204	-	214,071,000	7,783,204
	南アフリカランド	136,894,795	-	126,809,500	10,085,295
合計		25,311,644,231	-	24,895,625,760	416,018,471

(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17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	17,958,175,971円
同期中における追加設定元本額	4,713,341,906円
同期中における一部解約元本額	5,912,333,301円
令和 2年 3月17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)	3,844,685,429円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,587,783,261円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	569,333,402円
イオン・バランス戦略ファンド	637,026,320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>	3,884,814,794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>	163,261,939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>	388,462,996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>	436,256,025円
合計	16,759,184,576円

シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

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

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

(純資産計算書)

区分	2019年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	14,275,809

短期金融資産	98,438
投資総額	14,374,247
その他資産及び負債	108,059
純資産額	14,482,306

## (1口当たり情報)

(2019年10月31日現在)	
1口当たり純資産額	113.14米ドル

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

2020年 3月31日現在

資産総額	2,143,543,132円
負債総額	9,907,007円
純資産総額（ - ）	2,133,636,125円
発行済口数	2,149,413,005口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9927円
（1万口当たり純資産額）	（9,927円）

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

2020年 3月31日現在

資産総額	1,013,030,751円
負債総額	5,478,378円
純資産総額（ - ）	1,007,552,373円
発行済口数	1,037,386,693口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9712円
（1万口当たり純資産額）	（9,712円）

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

2020年 3月31日現在

資産総額	2,149,644,680円
負債総額	7,406,451円
純資産総額（ - ）	2,142,238,229円
発行済口数	2,232,108,901口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9597円
（1万口当たり純資産額）	（9,597円）

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

2020年 3月31日現在

資産総額	852,005,143円
負債総額	1,982,764円

純資産総額（ - ）	850,022,379円
発行済口数	911,318,767口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9327円
（1万口当たり純資産額）	（9,327円）

## 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

2020年 3月31日現在

資産総額	886,922,412円
負債総額	2,168,688円
純資産総額（ - ）	884,753,724円
発行済口数	982,099,882口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9009円
（1万口当たり純資産額）	（9,009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 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）	
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</p> <p>時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 2～30年 器具備品 4～15年</p> <p>（会計上の見積りの変更） 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社（以下「SMAM」）との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p> <p>これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

(追加情報)

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

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

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当た り配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（(注2)を参照ください）。

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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



## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位：千円)

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

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

## (1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

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

## 関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	3,987,525	未払 手数料 料	573,578
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,969,101	未払 手数料 料	273,241

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	4,328,153	未払 手数料 料	540,879
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,465,685	未払 手数料 料	228,197

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

## (1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

(注)潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

**(重要な後発事象)**

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

**4【利害関係人との取引制限】**

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

**5【その他】****イ 定款の変更、その他の重要事項****(イ) 定款の変更**

- a. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。
- b. 2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

**(ロ) その他の重要事項**

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

**第2【その他の関係法人の概況】****1【名称、資本金の額及び事業の内容】****イ 受託会社**

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2019年9月末現在)

- (八) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社\*
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2019年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

□ 販売会社

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

## 2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)  
該当ありません。

## 第3【その他】

### 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。



- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
  - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
  - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**強調事項**

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. 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29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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の令和1年9月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

## 独立監査人の監査報告書

令和1年10月29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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の令和1年9月17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。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年10月29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・資産最適化ファンド（3バランス型）の平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド（3バランス型）の令和1年9月17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。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年10月29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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の令和1年9月17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。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年10月29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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の平成30年9月19日から令和1年9月17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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の令和1年9月17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28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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の令和2年3月17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18日から令和2年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

令和2年4月28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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の令和2年3月17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18日から令和2年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

令和2年4月28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・資産最適化ファンド（3バランス型）の令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（3バランス型）の令和2年3月17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18日から令和2年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

令和2年4月28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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の令和2年3月17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18日から令和2年3月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

令和2年4月28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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の令和1年9月18日から令和2年3月17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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の令和2年3月17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18日から令和2年3月17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。