

【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】	2020年7月9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】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)
【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】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

以下「当ファンド」といいます。また、「<2040>」という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D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

(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、「DC2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5)【申込手数料】

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7月10日から2021年1月7日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ 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。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への

記載・記録によって行われます。

- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、西暦2040年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

以下、上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆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、円短期金融資産）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、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

商品分類表

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

資産配分固定型 資産配分変更型				
--------------------	--	--	--	--

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

2008年3月31日 信託契約締結、設定、運用開始。
2017年1月13日 「スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040」から「三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

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

（ハ）販売会社

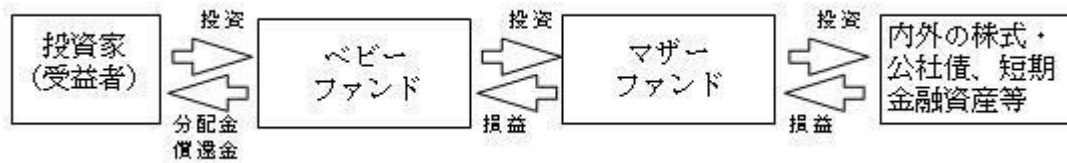
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020年4月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

（2020年4月30日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

「(1)投資方針」には、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率の異なるファンドの情報を合わせて説明している部分があります。

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

ロ 投資態度

- (イ) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とする5つのマザーファンドに分散投資を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

- (ロ) 長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

- (ハ) 基本資産配分は、西暦2040年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年1回決算時に変更します。

なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

- (ニ) 組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要なに応じて調整を行うものとします。

[2020年4月現在の基本資産配分]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
29.5%	21.5%	20.0%	27.0%	2.0%

- (ホ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

ファンドの特色

- 1** 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。
 - 実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。
 - ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。
- 2** 基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。
基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。
- 3** 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

※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。

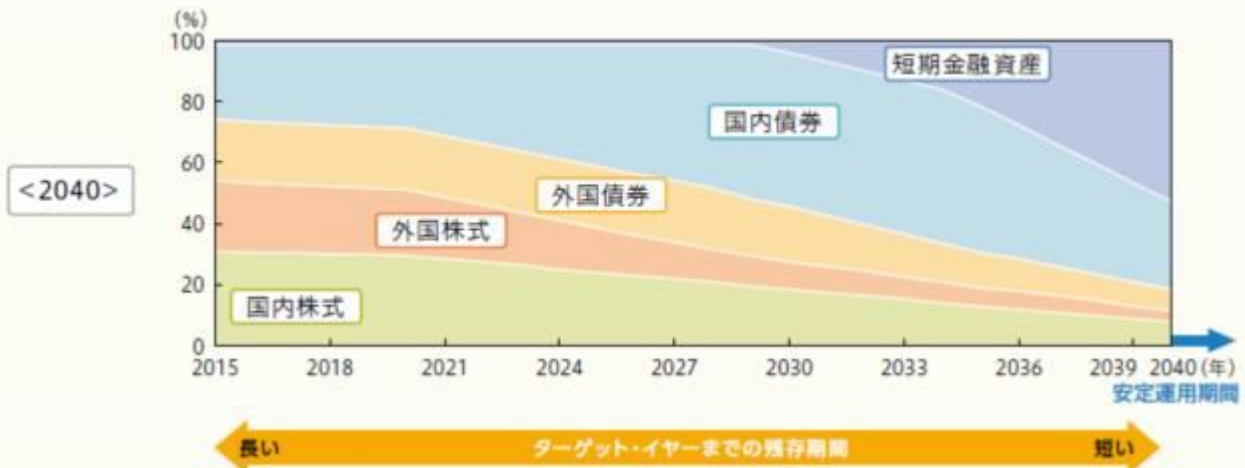
ファンドのしくみ

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



※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。

▶ ターゲットイヤーまでの基本資産配分のイメージ



※上記は、各決算時点での基本資産配分を表しています。各ターゲットイヤーの前年の決算日から翌年の決算日までは、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージであり、将来、実際上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

各マザーファンドの運用プロセス

▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

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



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

▶ マネーインカム・マザーファンド

- 主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

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

- ・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）お

よび新株予約権証券

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

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

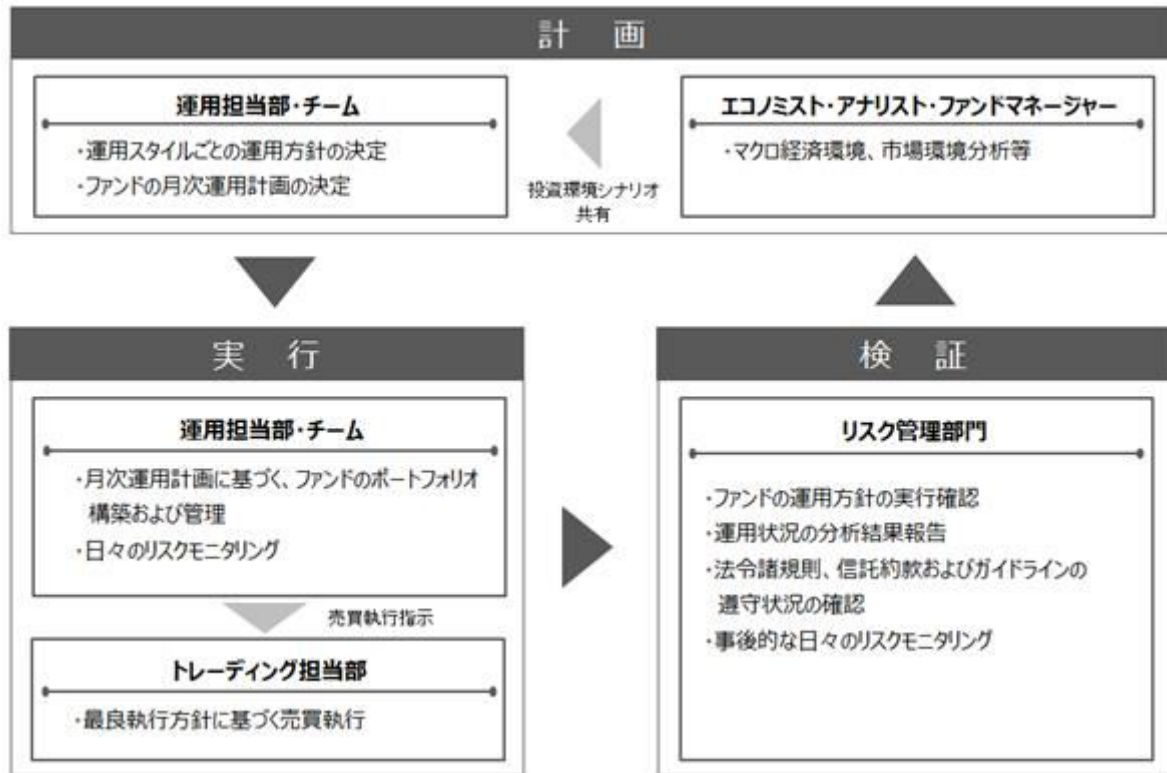
八 投資対象とする金融商品

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

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

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

（４）【分配方針】

毎年１回（原則として４月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計した

ものをいいます（以下同じ。）。

- 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ハ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
- ホ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ト デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- チ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式等の範囲

- （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ 信用取引の指図

- （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- （ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- （ニ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

- （イ）委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- （ロ）委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

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

ニ スワップ取引の指図

(イ) 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

(ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

(イ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

(ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

(ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替ス

ワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ヘ 有価証券の貸付けの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

チ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

- (二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

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

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第５号、第10号が

ら第21号に掲げるものに投資します(ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。)。

八 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

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

(ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第21号)に掲げるものに投資します(ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。)。

八 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（マネーインカム・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

円貨建の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指します。

ロ 投資態度

- （イ）主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
- （ロ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

産総額の10%以下とします。

- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ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。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 信用リスク

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

(ニ) 為替変動リスク

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

(ホ) カントリーリスク

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

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(チ) 換金制限等に関する留意点

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

(リ) 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

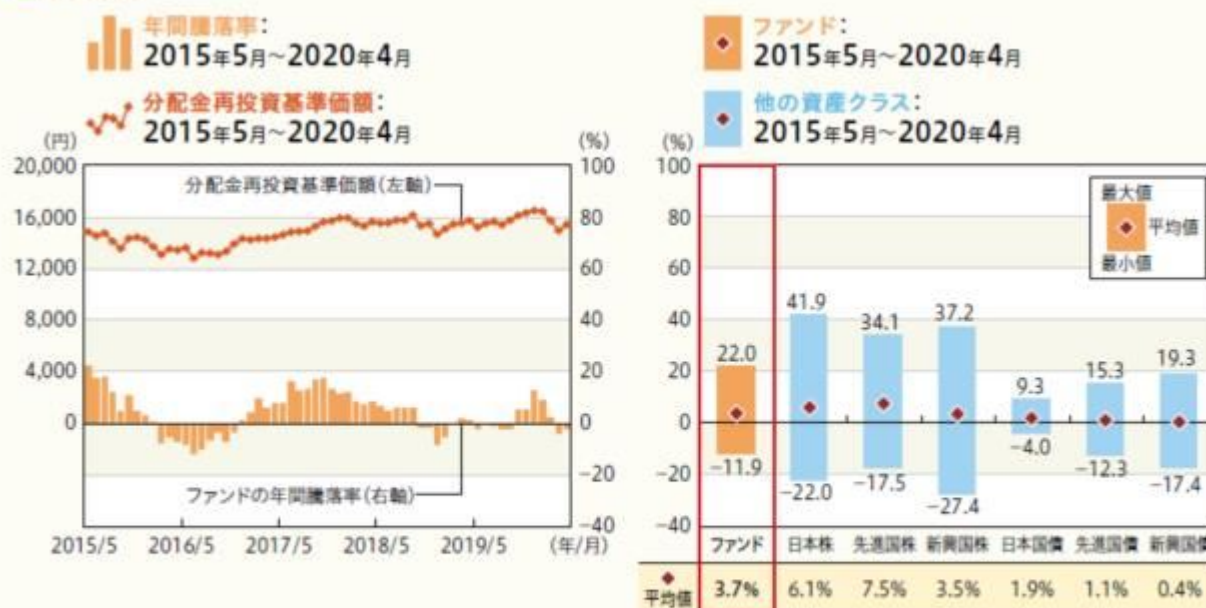
〔 ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移 〕

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。

〔 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。

■<2040>



※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。

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	J.P. Morgan・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】

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

託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬率およびその実質的配分は以下の通りです。

決算期	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
第1期～第32期 （ターゲットイヤーの 決算日まで）	年0.462% （税抜き0.42%）	年0.19%	年0.2%	年0.03%
第33期以降 （ターゲットイヤーの 決算翌日以降）	年0.231% （税抜き0.21%）	年0.08%	年0.1%	年0.03%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンド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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

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

□ 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。

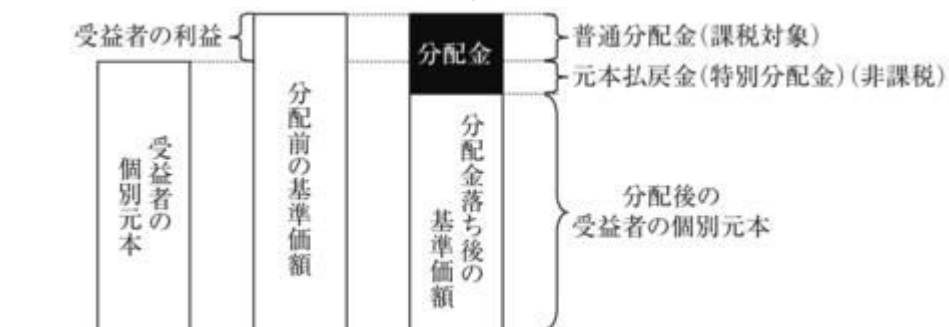
八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社

債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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4月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1) 【投資状況】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	676,946,047	99.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,570,486	0.67
合計(純資産総額)		681,516,533	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

イ 主要投資銘柄

2020年 4月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	85,533,307	2.2774	194,801,561	2.3700	202,713,937	29.74
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	140,212,400	1.2843	180,085,815	1.2890	180,733,783	26.52
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	43,019,105	3.3230	142,954,050	3.4540	148,587,988	21.80
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	72,291,866	1.8478	133,583,293	1.8321	132,445,927	19.43
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	12,350,785	1.0092	12,465,635	1.0092	12,464,412	1.83

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 4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.33
合計	99.33

【投資不動産物件】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

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3期 (2011年 4月13日)	3,130,163	3,130,163	8,674	8,674
第4期 (2012年 4月13日)	20,230,023	20,230,023	8,618	8,618
第5期 (2013年 4月15日)	10,961,140	10,961,140	11,020	11,020
第6期 (2014年 4月14日)	17,867,281	17,867,281	11,765	11,765
第7期 (2015年 4月13日)	81,578,616	81,578,616	14,379	14,379
第8期 (2016年 4月13日)	178,916,663	178,916,663	13,267	13,267
第9期 (2017年 4月13日)	236,077,626	236,077,626	14,009	14,009
第10期 (2018年 4月13日)	331,831,432	331,831,432	15,438	15,438
第11期 (2019年 4月15日)	494,351,089	494,351,089	15,763	15,763
第12期 (2020年 4月13日)	654,089,367	654,089,367	15,101	15,101
2019年 4月末日	493,473,621		15,710	
5月末日	534,981,290		15,187	
6月末日	554,886,492		15,484	
7月末日	575,036,559		15,625	
8月末日	581,166,073		15,373	
9月末日	600,850,006		15,728	
10月末日	628,350,871		16,104	
11月末日	649,129,390		16,307	
12月末日	667,504,734		16,478	
2020年 1月末日	684,205,631		16,414	
2月末日	664,843,823		15,704	
3月末日	647,203,728		14,939	
4月末日	681,516,533		15,400	

【分配の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期	2010年 4月14日～2011年 4月13日	0
第4期	2011年 4月14日～2012年 4月13日	0
第5期	2012年 4月14日～2013年 4月15日	0
第6期	2013年 4月16日～2014年 4月14日	0
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	0
第11期	2018年 4月14日～2019年 4月15日	0
第12期	2019年 4月16日～2020年 4月13日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	収益率（％）
第3期	4.4
第4期	0.6
第5期	27.9
第6期	6.8
第7期	22.2
第8期	7.7
第9期	5.6
第10期	10.2
第11期	2.1
第12期	4.2

（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基準価額を控除した額を前期末分配基準価額で除したものをいいます。

（4）【設定及び解約の実績】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	2,593,247	0
第4期	19,866,478	0
第5期	5,765,406	19,294,423

第6期	9,427,064	4,186,617
第7期	44,831,283	3,281,608
第8期	84,680,093	6,563,135
第9期	49,340,920	15,674,791
第10期	53,950,215	7,519,004
第11期	113,641,120	14,980,754
第12期	141,241,710	21,719,594

(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 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	154,147,896,740	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,494,170,280	2.22
合計(純資産総額)		157,642,067,020	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,300,580,000	2.09
合計	買建	-	3,300,580,000	2.09

国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	108,818,240,800	79.63
地方債証券	日本	8,516,004,485	6.23
特殊債券	日本	13,066,095,321	9.56
社債券	日本	5,280,703,000	3.86
	フランス	200,014,000	0.15

	オーストラリア	199,998,000	0.15
	小計	5,680,715,000	4.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		570,382,298	0.42
合計(純資産総額)		136,651,437,904	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	132,181,138,977	66.06
	イギリス	9,747,363,948	4.87
	スイス	7,531,274,676	3.76
	カナダ	6,997,645,384	3.50
	フランス	6,578,798,892	3.29
	ドイツ	5,636,600,495	2.82
	アイルランド	3,827,487,191	1.91
	オーストラリア	3,630,530,958	1.81
	オランダ	3,511,017,485	1.75
	香港	1,798,688,839	0.90
	スウェーデン	1,736,670,818	0.87
	スペイン	1,656,520,216	0.83
	デンマーク	1,467,560,438	0.73
	イタリア	1,137,766,829	0.57
	フィンランド	788,740,165	0.39
	シンガポール	728,014,417	0.36
	バミューダ	658,037,486	0.33
	ベルギー	599,195,469	0.30
	ジャージー	583,407,617	0.29
	イスラエル	417,660,894	0.21
	ケイマン諸島	408,748,233	0.20
	ノルウェー	366,599,341	0.18
ニュージーランド	214,404,829	0.11	
ルクセンブルグ	168,095,524	0.08	
キュラソー	142,851,077	0.07	
オーストリア	120,712,598	0.06	

	ポルトガル	113,754,847	0.06
	リベリア	46,410,452	0.02
	マン島	24,609,492	0.01
	パプアニューギニア	13,603,539	0.01
	英ヴァージン諸島	11,023,880	0.01
	小計	192,844,935,006	96.38
投資証券	アメリカ	3,838,539,399	1.92
	オーストラリア	475,223,824	0.24
	香港	139,521,428	0.07
	フランス	131,492,946	0.07
	イギリス	120,759,656	0.06
	シンガポール	90,634,854	0.05
	カナダ	42,897,180	0.02
	小計	4,839,069,287	2.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,408,098,495	1.20
合計(純資産総額)		200,092,102,788	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	2,215,847,923	1.10
	買建	ドイツ	478,237,840	0.23
	買建	イギリス	154,313,316	0.07
	買建	オーストラリア	93,585,600	0.04
合計	買建		2,941,984,679	1.44

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		512,928,000	0.25

外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	76,666,172,703	49.64
	フランス	14,214,333,864	9.20
	イタリア	12,699,539,188	8.22
	イギリス	9,823,839,999	6.36
	ドイツ	8,354,576,708	5.41
	スペイン	7,949,452,798	5.15
	ベルギー	3,572,215,534	2.31
	カナダ	2,890,686,380	1.87
	オーストラリア	2,855,652,197	1.85
	オランダ	2,743,564,952	1.78
	オーストリア	2,296,668,166	1.49
	メキシコ	1,097,913,521	0.71
	フィンランド	1,094,681,908	0.71
	アイルランド	997,545,944	0.65
	ポーランド	864,690,250	0.56
	マレーシア	746,106,817	0.48
	デンマーク	708,678,654	0.46
	シンガポール	644,840,586	0.42
	スウェーデン	414,290,057	0.27
ノルウェー	344,638,129	0.22	
	小計	150,980,088,355	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,456,694,272	2.24
合計(純資産総額)		154,436,782,627	100.00

マネーインカム・マザーファンド

2020年 4月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
特殊債券	日本	1,856,586,360	70.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		784,953,014	29.72
合計(純資産総額)		2,641,539,374	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 4月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	835,800	7,616.65	6,365,996,070	6,666.00	5,571,442,800	3.53
日本	株式	ソニー	電気機器	469,200	6,910.82	3,242,556,744	6,932.00	3,252,494,400	2.06
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	583,200	4,194.04	2,445,964,128	4,633.00	2,701,965,600	1.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	67,900	37,389.92	2,538,775,568	38,770.00	2,632,483,000	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	623,400	4,382.59	2,732,106,606	3,883.00	2,420,662,200	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	981,600	2,759.77	2,708,990,232	2,443.00	2,398,048,800	1.52
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,052,300	567.18	2,865,563,514	434.30	2,194,213,890	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	45,900	42,552.05	1,953,139,095	44,650.00	2,049,435,000	1.30
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	542,400	3,002.23	1,628,409,552	3,148.00	1,707,475,200	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	547,700	3,130.49	1,714,569,373	3,109.00	1,702,799,300	1.08
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	512,400	3,893.95	1,995,259,980	3,182.00	1,630,456,800	1.03
日本	株式	第一三共	医薬品	214,200	6,917.79	1,481,790,618	7,382.00	1,581,224,400	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	589,200	3,039.99	1,791,162,108	2,610.50	1,538,106,600	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	125,900	11,724.26	1,476,084,334	12,015.00	1,512,688,500	0.96
日本	株式	花王	化学	179,400	8,620.47	1,546,512,318	8,316.00	1,491,890,400	0.95
日本	株式	HOYA	精密機器	149,700	9,921.26	1,485,212,622	9,866.00	1,476,940,200	0.94
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	511,000	3,900.29	1,993,048,190	2,844.00	1,453,284,000	0.92
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,400	15,495.93	1,478,311,722	14,005.00	1,336,077,000	0.85
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	261,200	5,896.04	1,540,045,648	5,086.00	1,328,463,200	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	219,900	6,400.97	1,407,573,303	6,019.00	1,323,578,100	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	71,200	20,666.30	1,471,440,560	17,830.00	1,269,496,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,040,200	165.27	1,659,343,854	125.80	1,263,057,160	0.80
日本	株式	三菱商事	卸売業	516,900	2,858.43	1,477,522,467	2,300.00	1,188,870,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	359,800	4,196.59	1,509,933,082	3,241.00	1,166,111,800	0.74

日本	株式	アステラス製薬	医薬品	648,600	1,867.22	1,211,078,892	1,786.50	1,158,723,900	0.74
日本	株式	S M C	機械	23,500	49,085.02	1,153,497,970	49,000.00	1,151,500,000	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	180,300	7,961.78	1,435,508,934	6,286.00	1,133,365,800	0.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	514,700	2,408.42	1,239,613,774	2,125.00	1,093,737,500	0.69
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	47,500	22,276.58	1,058,137,550	22,940.00	1,089,650,000	0.69
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	62,300	21,737.51	1,354,246,873	17,005.00	1,059,411,500	0.67

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 4月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.21
		建設業	2.58
		食料品	3.93
		繊維製品	0.51
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.23
		医薬品	6.49
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.52
		機械	4.94
		電気機器	14.39
		輸送用機器	7.23
		精密機器	2.53
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.62
陸運業	4.20		
海運業	0.13		
空運業	0.35		

	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.57
	卸売業	4.56
	小売業	4.65
	銀行業	5.06
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.15
	その他金融業	1.06
	不動産業	2.12
	サービス業	5.02
合計		97.78

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 4月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第410回利付国債(2年)	3,170,000,000	100.48	3,185,324,600	100.53	3,186,896,100	0.100	2022/3/1	2.33
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	2,090,000,000	101.00	2,111,028,700	101.23	2,115,874,200	0.100	2024/12/20	1.55
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	103.09	2,092,747,300	0.800	2023/6/20	1.53
日本	国債証券	第411回利付国債(2年)	1,780,000,000	100.47	1,788,450,100	100.55	1,789,932,400	0.100	2022/4/1	1.31
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,635,000,000	100.98	1,651,156,800	101.45	1,658,740,200	0.100	2029/12/20	1.21
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	104.99	1,527,706,350	1.700	2022/12/20	1.12
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	103.35	1,328,163,150	0.800	2023/9/20	0.97
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	102.37	1,295,043,750	0.800	2022/9/20	0.95
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	103.42	1,256,565,150	1.000	2023/3/20	0.92
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,110,000,000	101.73	1,129,247,000	101.67	1,128,581,400	0.100	2026/6/20	0.83
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	108.92	1,110,984,000	2.100	2024/3/20	0.81
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	107.61	1,097,693,400	1.900	2023/12/20	0.80
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	107.09	1,097,693,000	1.900	2023/9/20	0.80
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	101.70	1,052,605,350	0.100	2029/3/20	0.77
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	101.43	1,014,350,000	1.200	2021/6/30	0.74

日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	980,000,000	101.93	998,981,600	101.95	999,149,200	0.100	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	981,000,000	102.09	1,001,547,300	101.74	998,098,830	0.100	2026/9/20	0.73
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	960,000,000	103.30	991,718,400	102.25	981,609,600	1.000	2022/3/20	0.72
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	133.08	987,468,440	131.04	972,383,580	2.400	2034/3/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	938,000,000	101.90	955,836,000	101.81	954,996,560	0.100	2026/12/20	0.70
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	114.36	972,119,500	112.32	954,728,500	2.000	2025/12/20	0.70
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	890,000,000	101.86	906,554,000	101.60	904,275,600	0.100	2026/3/20	0.66
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	857,000,000	103.12	883,738,400	102.67	879,924,750	0.300	2025/12/20	0.64
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	860,000,000	103.53	890,358,000	101.61	873,846,000	0.100	2029/6/20	0.64
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	113.12	882,367,200	110.73	863,694,000	2.400	2024/6/20	0.63
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	850,000,000	101.46	862,473,000	101.51	862,835,000	0.100	2029/9/20	0.63
日本	国債証券	第56回利付国債(20年)	818,000,000	106.68	872,650,580	104.71	856,527,800	2.000	2022/6/20	0.63
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	117.53	872,080,020	115.24	855,125,320	2.300	2026/6/20	0.63
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	734,000,000	117.17	860,027,800	115.16	845,296,420	2.100	2026/12/20	0.62
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	815,000,000	103.76	845,644,000	103.07	840,028,650	0.600	2024/3/20	0.61

□ 種類別の投資比率

2020年 4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.63
地方債証券	6.23
特殊債券	9.56
社債券	4.16
合計	99.58

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 4月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	372,892	16,168.36	6,029,052,954	18,961.94	7,070,757,259	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	228,505	28,432.76	6,497,028,624	30,749.70	7,026,461,364	3.51

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,665	192,908.89	4,179,371,310	253,571.51	5,493,626,931	2.75
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	124,019	21,201.93	2,629,443,310	20,753.08	2,573,776,886	1.29
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,938	137,960.62	2,198,816,368	143,363.96	2,284,934,916	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,446	137,822.75	2,128,810,321	143,438.77	2,215,555,343	1.11
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	135,649	14,603.78	1,980,988,900	16,056.14	2,178,000,529	1.09
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	153,361	11,288.41	1,731,203,226	11,275.28	1,729,188,247	0.86
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	88,048	19,489.88	1,716,045,121	19,427.89	1,710,587,501	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	161,245	13,708.21	2,210,381,111	10,458.29	1,686,348,293	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	128,483	12,900.27	1,657,466,380	12,512.33	1,607,622,929	0.80
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	48,895	29,571.99	1,445,922,827	30,741.15	1,503,088,798	0.75
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	223,631	6,142.88	1,373,740,097	6,604.56	1,476,985,699	0.74
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	46,151	30,798.86	1,421,398,432	30,317.95	1,399,203,724	0.70
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	67,565	23,182.24	1,566,308,073	20,263.62	1,369,111,533	0.68
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	36,084	33,560.87	1,211,010,606	37,429.15	1,350,593,683	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	56,079	23,281.62	1,305,610,501	23,704.83	1,329,343,425	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	213,529	6,359.83	1,358,008,930	6,211.28	1,326,289,347	0.66
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	375,942	3,928.54	1,476,903,636	3,358.92	1,262,760,644	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	440,243	3,446.55	1,517,322,813	2,648.23	1,165,868,506	0.58
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	285,960	4,041.82	1,155,799,819	4,073.88	1,164,967,983	0.58
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	131,546	9,184.40	1,208,172,109	8,631.88	1,135,490,589	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	92,661	15,716.30	1,456,288,278	11,996.15	1,111,575,950	0.56
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	217,519	7,006.39	1,524,024,512	5,072.05	1,103,267,287	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	210,391	5,617.08	1,181,784,593	5,035.71	1,059,468,988	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	110,441	9,889.13	1,092,166,158	9,313.21	1,028,561,264	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	72,083	14,357.98	1,034,966,597	14,252.18	1,027,340,122	0.51
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	218,093	4,767.47	1,039,751,988	4,631.74	1,010,151,337	0.50

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	22,530	33,942.98	764,735,355	44,018.68	991,740,957	0.50
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	96,717	12,119.05	1,172,118,933	10,112.03	978,006,115	0.49

ロ 種類別・業種別の投資比率

2020年 4月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.87
		素材	4.12
		資本財	6.05
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.06
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.56
		メディア・娯楽	6.37
		小売	5.59
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	4.81
		家庭用品・パーソナル用品	2.15
		ヘルスケア機器・サービス	5.35
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.35
		銀行	5.84
		各種金融	4.25
		保険	3.23
		不動産	0.74
		ソフトウェア・サービス	11.11
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.05		
電気通信サービス	2.24		
公益事業	3.61		
半導体・半導体製造装置	3.72		
投資証券			2.42
合計			98.80

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 4月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
--------	----	-----	----	----------	----------	-----------	---------	--------	------	----------

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	11,800,000	10,695.34	1,262,051,208	11,313.19	1,334,956,586	1.750	2024/6/30	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	10,500,000	10,694.51	1,122,924,007	10,896.56	1,144,139,372	1.750	2021/7/31	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	12,226.99	660,257,822	15,154.66	818,352,018	3.000	2048/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,350.76	715,098,065	12,539.69	790,000,576	2.625	2029/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	10,861.49	705,997,417	11,435.92	743,335,123	2.125	2024/3/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	11,777.13	671,296,558	12,940.45	737,605,888	3.125	2028/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,938.31	689,113,626	11,600.40	730,825,485	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	11,541.96	634,807,800	12,667.43	696,708,908	2.875	2028/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,564.26	639,138,125	11,418.39	690,812,689	1.625	2026/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,031.82	628,813,899	11,616.26	662,127,282	2.500	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,985.90	615,210,514	11,608.75	650,090,210	2.375	2024/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,200,000	11,131.57	578,842,118	12,350.16	642,208,547	2.375	2029/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,450,000	10,432.64	568,579,393	11,666.36	635,816,806	1.625	2029/8/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	12,600.50	630,025,000	12,428.12	621,406,200	3.000	2022/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	20,892.64	605,886,676	21,003.42	609,099,296	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,000,000	11,234.70	561,735,437	11,972.77	598,638,984	2.750	2025/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	11,408.37	547,601,880	12,470.39	598,578,870	2.750	2028/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,123.66	567,306,873	11,665.52	594,941,950	2.750	2024/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	11,090.26	543,423,098	12,057.10	590,798,235	2.375	2027/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	10,804.55	540,227,850	11,718.96	585,948,172	2.000	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	4,000,000	11,858.39	474,335,818	14,484.64	579,385,685	2.875	2045/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3,800,000	12,244.96	465,308,640	15,225.63	578,574,142	3.000	2049/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000	13,309.48	479,141,627	16,011.29	576,406,686	3.625	2044/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	4,800,000	11,189.28	537,085,872	11,986.13	575,334,645	2.625	2025/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	10,985.06	549,253,358	11,462.64	573,132,124	2.500	2023/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,000,000	10,549.13	527,456,885	11,450.95	572,547,678	1.625	2026/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	4,900,000	10,881.53	533,195,305	11,616.26	569,197,136	2.125	2025/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3,800,000	12,333.46	468,671,706	14,933.41	567,469,681	3.125	2044/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	4,100,000	11,084.42	454,461,335	13,664.33	560,237,587	2.500	2046/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	10,810.23	540,511,724	11,167.08	558,354,007	2.000	2022/11/30	0.36

□ 種類別の投資比率

2020年 4月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.76
合計	97.76

マネーインカム・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2020年 4月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (％)	償還期限	投資 比率 (％)
日本	特殊債券	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	100.33	301,011,000	100.28	300,846,000	1.100	2020/7/31	11.39
日本	特殊債券	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	244,000,000	100.39	244,961,360	100.34	244,839,360	1.000	2020/8/31	9.27
日本	特殊債券	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	101.83	203,670,000	101.74	203,480,000	1.900	2021/3/26	7.70
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	200,000,000	101.45	202,912,000	101.43	202,870,000	1.200	2021/6/30	7.68
日本	特殊債券	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	200,000,000	100.04	200,082,000	100.02	200,058,000	0.199	2020/6/18	7.57
日本	特殊債券	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101.29	101,292,000	101.20	101,204,000	1.800	2020/12/27	3.83
日本	特殊債券	第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101.07	101,075,000	101.01	101,013,000	1.200	2021/2/26	3.82
日本	特殊債券	第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100.98	100,980,000	100.91	100,919,000	1.200	2021/1/29	3.82
日本	特殊債券	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	100.82	100,825,000	100.76	100,765,000	1.200	2020/12/14	3.81
日本	特殊債券	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100.48	100,486,000	100.44	100,440,000	0.900	2020/10/21	3.80
日本	特殊債券	第25回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100.10	100,109,000	100.09	100,098,000	0.147	2020/11/25	3.79
日本	特殊債券	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100.06	100,062,000	100.05	100,054,000	0.100	2020/10/6	3.79

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 4月30日現在

種類	投資比率（％）
特殊債券	70.28
合計	70.28

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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・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 4月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	227	日本円	3,153,055,600	3,300,580,000	2.09

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 4月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 2006	買建	141	米ドル	19,874,535.5	2,123,991,608	20,734,050	2,215,847,923	1.10
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 2006	買建	139	ユーロ	3,966,888	460,159,008	4,122,740	478,237,840	0.23
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 2006	買建	10	オースト ラリアド ル	1,305,670	91,187,993	1,340,000	93,585,600	0.04

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	19英ポンド	1,116,268	148,441,318	1,160,425	154,313,316	0.07
------	--------------------	-----------	----	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

（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 4月30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	4,800,000.00	512,788,800	512,928,000	0.25

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報



■<2040>

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	99.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.67
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	29.74
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	26.52
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	21.80
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	19.43
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	1.83

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.22
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.09%

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	3.53
日本	株式	ソニー	電気機器	2.06
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.71
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.52
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1.30
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.08

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	79.63
特殊債券	日本	9.56
地方債証券	日本	6.23
社債券	日本	3.86
	フランス	0.15
	オーストラリア	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.42
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第410回利付国債(2年)	0.100	2022/03/01	2.33
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	0.100	2024/12/20	1.55
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.53
日本	国債証券	第411回利付国債(2年)	0.100	2022/04/01	1.31
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	0.100	2029/12/20	1.21
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.12
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.97
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	0.95
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.92
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	0.100	2026/06/20	0.83

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	66.06
	イギリス	4.87
	スイス	3.76
	カナダ	3.50
	フランス	3.29
	ドイツ	2.82
	その他	12.08
投資証券	アメリカ・その他	2.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.20
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.44%

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	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.75
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.29
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.11
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	1.09
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.86
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.84

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	49.64
	フランス	9.20
	イタリア	8.22
	イギリス	6.36
	ドイツ	5.41
	スペイン	5.15
	ベルギー	2.31
	その他	11.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.24
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2024/06/30	0.86
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2021/07/31	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.51
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	0.48
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	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.43

■マネーインカム・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	70.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29.72
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.100	2020/07/31	11.39
日本	特殊債券	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.000	2020/08/31	9.27
日本	特殊債券	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.900	2021/03/26	7.70
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	1.200	2021/06/30	7.68
日本	特殊債券	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	2020/06/18	7.57
日本	特殊債券	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.800	2020/12/27	3.83
日本	特殊債券	第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2021/02/26	3.82
日本	特殊債券	第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2021/01/29	3.82
日本	特殊債券	第57回政府保証関西国際空港債券	1.200	2020/12/14	3.81
日本	特殊債券	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.900	2020/10/21	3.80

※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)

■<2040>



※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。

※2020年のファンドの収益率は、年初から2020年4月30日までの顧客率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会

社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（2）【保管】

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

（3）【信託期間】

2008年3月31日から下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、

信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約

款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

八 一部解約実行請求権

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

二 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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12期(2019年 4月16日から2020年 4月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 (2019年 4月15日現在)	第12期 (2020年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,015,518	3,259,343
コール・ローン	340,908	2,265,733
親投資信託受益証券	490,329,964	650,156,919
未収入金	1,000,000	-
流動資産合計	495,686,390	655,681,995
資産合計	495,686,390	655,681,995
負債の部		
流動負債		
未払解約金	290,904	87,528
未払受託者報酬	73,729	106,218
未払委託者報酬	958,347	1,380,755
未払利息	-	6
その他未払費用	12,321	18,121
流動負債合計	1,335,301	1,592,628
負債合計	1,335,301	1,592,628
純資産の部		
元本等		
元本	313,611,077	433,133,193
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	180,740,012	220,956,174
元本等合計	494,351,089	654,089,367
純資産合計	494,351,089	654,089,367
負債純資産合計	495,686,390	655,681,995

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期		第12期	
	自	2018年 4月14日	自	2019年 4月16日
	至	2019年 4月15日	至	2020年 4月13日
営業収益				
有価証券売買等損益		11,952,012		25,075,045
営業収益合計		11,952,012		25,075,045
営業費用				
支払利息		1,726		2,471
受託者報酬		137,893		195,682
委託者報酬		1,792,470		2,543,748
その他費用		24,557		34,035
営業費用合計		1,956,646		2,775,936
営業利益又は営業損失()		9,995,366		27,850,981
経常利益又は経常損失()		9,995,366		27,850,981
当期純利益又は当期純損失()		9,995,366		27,850,981
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()		108,784		205,730
期首剰余金又は期首欠損金()		116,880,721		180,740,012
剰余金増加額又は欠損金減少額		61,928,159		80,301,474
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		61,928,159		80,301,474
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,173,018		12,440,061
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,173,018		12,440,061
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()		180,740,012		220,956,174

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第12期	
	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2019年 4月16日から2020年 4月13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11期		第12期	
	(2019年 4月15日現在)		(2020年 4月13日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	313,611,077口		433,133,193口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5763円	1口当たり純資産額	1.5101円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,763円)	(10,000口当たりの純資産額)	15,101円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期		第12期	
	自 2018年 4月14日 至 2019年 4月15日		自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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(7,352,655円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,751,495円)、収益調整金(157,606,599円)、および分配準備積立金(29,250,587円)より、分配対象収益は196,961,336円(1万口当たり6,280.42円)ですが、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(9,450,675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(235,054,573円)、および分配準備積立金(37,185,089円)より、分配対象収益は281,690,337円(1万口当たり6,503.54円)ですが、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12期 自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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12期 (2020年 4月13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(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11期(自 2018年 4月14日 至 2019年 4月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,774,540円
合計	11,774,540円

第12期(自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	24,587,736円
合計	24,587,736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12期 自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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11期 (2019年 4月15日現在)	第12期 (2020年 4月13日現在)
期首元本額	214,950,711円	313,611,077円
期中追加設定元本額	113,641,120円	141,241,710円
期中一部解約元本額	14,980,754円	21,719,594円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	86,046,135	195,892,630	
	外国株式インデックス・マザーファンド	44,465,029	147,699,486	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	67,678,112	125,123,293	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	131,188,831	168,485,815	
	マネーインカム・マザーファンド	12,836,318	12,955,695	
合計		342,214,425	650,156,919	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,457,525,367	1,569,931,879
コール・ローン	208,638,233	1,091,338,581
株式	173,171,361,310	148,206,257,960
派生商品評価勘定	80,937,960	70,320,500
未収入金	4,824,311	12,960,400
未収配当金	1,923,955,847	1,992,318,344

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
差入委託証拠金	50,690,000	-
流動資産合計	177,897,933,028	152,943,127,664
資産合計	177,897,933,028	152,943,127,664
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	17,468,900
前受金	81,195,000	53,010,000
未払金	-	45,670,200
未払解約金	163,338,570	298,597,444
未払利息	608	2,960
その他未払費用	72,541	383,203
流動負債合計	244,606,719	415,132,707
負債合計	244,606,719	415,132,707
純資産の部		
元本等		
元本	69,243,723,709	66,999,567,497
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	108,409,602,600	85,528,427,460
元本等合計	177,653,326,309	152,527,994,957
純資産合計	177,653,326,309	152,527,994,957
負債純資産合計	177,897,933,028	152,943,127,664

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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	（2019年 4月15日現在）	（2020年 4月13日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式 2,732,400,000円	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式 2,610,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,243,723,709口	66,999,567,497口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5656円 (10,000口当たりの純資産額 25,656円)	1口当たり純資産額 2.2766円 (10,000口当たりの純資産額 22,766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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 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	(2020年 4月13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、新株予約権証券) 「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)

(2019年 4月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960
	東証株価指数先物	4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960
合計		4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960

(2020年 4月13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	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
	東証株価指数先物	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
合計		3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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)

(2019年 4月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,068,329,504円
同期中における追加設定元本額	13,916,268,555円
同期中における一部解約元本額	12,740,874,350円
2019年 4月15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	10,274,019,641円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	830,155,477円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,964,449,304円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,853,907,596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）	121,085,132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）	7,938,639円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	26,728,335円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	66,367,789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）	98,546,290円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	58,012,897円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	144,202,998円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,877,407,552円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	9,129,223,248円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,081,860,998円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,029,489,659円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	994,185,788円
イオン・バランス戦略ファンド	72,532,788円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,361,956円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	19,948,207円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	22,326,660円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	78,900,004円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	46,684,329円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	79,518,179円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,293,486円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	5,402,453,400円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	25,017,073円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	225,151,325円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,454,923,789円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,489,132,334円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	9,253,609,369円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	59,588,186円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	226,593,592円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	796,449円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	942,907,444円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	57,187,516円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	382,097,522円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,109,499,058円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	966,355,652円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,118,178,505円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,573,523円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	930,339,818円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	65,794,715円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	46,865,696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)	1,174,726,549円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	107,829,530円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	48,426,618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>	22,746,684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>	212,053,626円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	393,936,535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>	164,873,486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>	119,503,474円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	62,251,723円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	9,591,895円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	77,717,022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>	946,967,774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)	201,015,951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>	20,958,549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>	1,618,468,794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>	224,746,577円
S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	133,073,322円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	11,331,622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>	118,884,555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>	56,899,955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>	140,273,790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>	148,327,141円
合計	69,243,723,709円

(2020年 4月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,243,723,709円
同期中における追加設定元本額	16,941,213,035円
同期中における一部解約元本額	19,185,369,247円
2020年 4月13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	9,964,536,945円
三井住友・D C年金バランス3 0 (債券重点型)	1,007,154,836円
三井住友・D C年金バランス5 0 (標準型)	4,682,046,360円
三井住友・D C年金バランス7 0 (株式重点型)	3,203,157,146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)	84,286,777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)	7,771,247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)	27,830,753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)	77,317,486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)	127,394,223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)	86,046,135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)	181,252,174円

国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,814,911,783円
三井住友・D CつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	12,839,183,881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)	561,168,497円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	411,929,217円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 0	14,698,817円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	88,807,681円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	72,638,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	212,846,574円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	102,613,725円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	126,077,209円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	16,579,634円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	10,439,245円
三井住友D S・年金バランス3 0(債券重点型)	155,573円
三井住友D S・年金バランス5 0(標準型)	1,105,768円
三井住友D S・年金バランス7 0(株式重点型)	827,282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	2,752,764円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,948,100,879円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	22,926,442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>	220,267,664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>	3,234,260,231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>	2,428,994,643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>	9,037,107,599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>	57,396,433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>	218,485,657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>	657,085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>	880,814,914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>	58,124,475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>	405,907,028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>	1,106,480,802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>	939,572,269円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	2,905,693,174円
S M A M・バランスV A株4 0 T <適格機関投資家限定>	1,225,167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>	66,011,486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>	81,792,352円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	48,200,904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>	23,412,935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>	209,289,501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>	402,959,759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>	119,019,653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>	56,952,405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>	10,193,913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>	72,366,784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>	989,295,905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)	188,003,249円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	22,115,210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>	937,750,878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>	189,817,826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 >	1,542,313,109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 >	112,200,588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 >	10,043,124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 >	14,237,375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 >	15,653,159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 >	148,815,098円
合計	66,999,567,497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	3,700	2,541.00	9,401,700	
日本水産	101,000	472.00	47,672,000	
マルハニチロ	14,500	2,269.00	32,900,500	
カネコ種苗	4,600	1,453.00	6,683,800	
サカタのタネ	11,900	3,330.00	39,627,000	
ホクト	8,300	1,901.00	15,778,300	
日鉄鉱業	2,300	4,185.00	9,625,500	
三井松島ホールディングス	5,600	866.00	4,849,600	
国際石油開発帝石	410,300	662.50	271,823,750	
石油資源開発	13,000	1,947.00	25,311,000	
K & O エナジーグループ	5,600	1,539.00	8,618,400	
ヒノキヤグループ	3,600	1,420.00	5,112,000	
ショーボンドホールディングス	15,600	4,275.00	66,690,000	
ミライト・ホールディングス	29,300	1,333.00	39,056,900	
タマホーム	6,500	1,184.00	7,696,000	
スペースバリューホールディングス	17,900	323.00	5,781,700	
安藤・間	61,200	669.00	40,942,800	
東急建設	30,200	542.00	16,368,400	
コムシスホールディングス	36,000	2,804.00	100,944,000	
ピーアールホールディングス	13,400	467.00	6,257,800	
高松コンストラクショングループ	6,600	2,300.00	15,180,000	
東建コーポレーション	3,100	7,610.00	23,591,000	
大成建設	78,100	3,265.00	254,996,500	
大林組	231,700	933.00	216,176,100	
清水建設	236,200	823.00	194,392,600	

飛島建設	8,500	1,001.00	8,508,500
長谷工コーポレーション	89,900	1,142.00	102,665,800
松井建設	11,800	618.00	7,292,400
銭高組	1,600	3,610.00	5,776,000
鹿島建設	183,200	1,110.00	203,352,000
不動テトラ	7,600	1,266.00	9,621,600
大末建設	6,100	725.00	4,422,500
鉄建建設	5,700	2,249.00	12,819,300
西松建設	18,600	1,964.00	36,530,400
三井住友建設	59,400	436.00	25,898,400
大豊建設	6,000	2,205.00	13,230,000
前田建設工業	60,500	854.00	51,667,000
奥村組	13,800	2,293.00	31,643,400
東鉄工業	9,600	2,744.00	26,342,400
浅沼組	3,000	3,375.00	10,125,000
戸田建設	97,400	635.00	61,849,000
熊谷組	10,900	2,359.00	25,713,100
北野建設	2,200	2,501.00	5,502,200
矢作建設工業	12,100	747.00	9,038,700
ピーエス三菱	10,600	537.00	5,692,200
日本ハウスホールディングス	22,500	283.00	6,367,500
大東建託	28,400	10,145.00	288,118,000
新日本建設	10,000	784.00	7,840,000
N I P P O	18,900	2,344.00	44,301,600
東亜道路工業	2,000	2,908.00	5,816,000
前田道路	21,300	2,015.00	42,919,500
日本道路	2,500	6,320.00	15,800,000
東亜建設工業	8,300	1,375.00	11,412,500
日本国土開発	18,500	558.00	10,323,000
若築建設	5,800	1,183.00	6,861,400
東洋建設	27,700	440.00	12,188,000
五洋建設	93,800	537.00	50,370,600
世紀東急工業	14,000	795.00	11,130,000
福田組	2,800	4,065.00	11,382,000
住友林業	59,400	1,315.00	78,111,000
日本基礎技術	13,700	388.00	5,315,600
巴コーポレーション	16,200	333.00	5,394,600
大和ハウス工業	232,700	2,664.00	619,912,800
ライト工業	13,000	1,293.00	16,809,000
積水ハウス	257,300	1,804.50	464,297,850
ユアテック	15,200	597.00	9,074,400
中電工	8,100	2,131.00	17,261,100

関電工	30,600	849.00	25,979,400
きんでん	55,700	1,683.00	93,743,100
東京エネシス	9,800	775.00	7,595,000
トーエネック	2,900	3,170.00	9,193,000
住友電設	6,400	2,172.00	13,900,800
日本電設工業	11,900	2,191.00	26,072,900
協和エクシオ	35,300	2,539.00	89,626,700
新日本空調	6,800	2,138.00	14,538,400
九電工	16,300	2,825.00	46,047,500
三機工業	16,900	1,215.00	20,533,500
日揮ホールディングス	73,200	986.00	72,175,200
中外炉工業	4,100	1,442.00	5,912,200
ヤマト	9,400	634.00	5,959,600
太平電業	6,100	2,180.00	13,298,000
高砂熱学工業	19,500	1,734.00	33,813,000
朝日工業社	2,200	2,959.00	6,509,800
明星工業	15,300	715.00	10,939,500
大気社	11,400	3,045.00	34,713,000
ダイダン	5,700	2,718.00	15,492,600
日比谷総合設備	8,100	1,851.00	14,993,100
O S J Bホールディングス	42,500	238.00	10,115,000
レイズネクスト	13,600	1,210.00	16,456,000
日本製粉	20,400	1,662.00	33,904,800
日清製粉グループ本社	84,500	1,620.00	136,890,000
昭和産業	6,800	3,255.00	22,134,000
鳥越製粉	8,500	849.00	7,216,500
中部飼料	8,700	1,559.00	13,563,300
フィード・ワン	55,900	158.00	8,832,200
日本甜菜製糖	4,700	1,679.00	7,891,300
三井製糖	5,900	2,091.00	12,336,900
日新製糖	3,600	1,896.00	6,825,600
森永製菓	17,600	4,335.00	76,296,000
中村屋	2,600	3,810.00	9,906,000
江崎グリコ	22,400	4,590.00	102,816,000
名糖産業	6,100	1,311.00	7,997,100
井村屋グループ	4,000	1,911.00	7,644,000
不二家	4,600	2,014.00	9,264,400
山崎製パン	56,400	2,201.00	124,136,400
モロゾフ	1,700	5,130.00	8,721,000
亀田製菓	4,300	5,090.00	21,887,000
寿スピリッツ	7,100	4,270.00	30,317,000
カルビー	34,400	3,030.00	104,232,000

森永乳業	14,000	4,210.00	58,940,000
六甲バター	5,800	1,393.00	8,079,400
ヤクルト本社	51,700	6,760.00	349,492,000
明治ホールディングス	49,600	7,500.00	372,000,000
雪印メグミルク	17,800	2,334.00	41,545,200
プリマハム	11,200	2,357.00	26,398,400
日本ハム	28,600	3,440.00	98,384,000
丸大食品	8,100	1,900.00	15,390,000
S Foods	5,800	2,236.00	12,968,800
柿安本店	3,200	2,171.00	6,947,200
伊藤ハム米久ホールディングス	42,300	619.00	26,183,700
サッポロホールディングス	25,900	1,982.00	51,333,800
アサヒグループホールディングス	157,500	3,537.00	557,077,500
キリンホールディングス	318,600	2,095.00	667,467,000
宝ホールディングス	56,300	725.00	40,817,500
オエノンホールディングス	22,200	404.00	8,968,800
養命酒製造	3,500	1,900.00	6,650,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	52,900	1,939.00	102,573,100
サントリー食品インターナショナル	50,100	4,045.00	202,654,500
ダイドーグループホールディングス	3,800	4,010.00	15,238,000
伊藤園	22,700	5,880.00	133,476,000
キーコーヒー	7,400	2,234.00	16,531,600
日清オイリオグループ	9,400	3,485.00	32,759,000
不二製油グループ本社	18,400	2,570.00	47,288,000
かどや製油	1,300	3,425.00	4,452,500
J - オイルミルズ	4,000	4,215.00	16,860,000
キッコーマン	53,800	4,600.00	247,480,000
味の素	166,100	1,840.00	305,624,000
キューピー	41,900	2,050.00	85,895,000
ハウス食品グループ本社	28,100	3,155.00	88,655,500
カゴメ	28,400	2,697.00	76,594,800
焼津水産化学工業	6,400	897.00	5,740,800
アリアケジャパン	7,000	6,070.00	42,490,000
ニチレイ	35,800	2,758.00	98,736,400
東洋水産	38,500	5,080.00	195,580,000
イトアンド	3,700	1,647.00	6,093,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,100	828.00	4,222,800
日清食品ホールディングス	31,900	8,850.00	282,315,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,174.00	9,130,800
一正蒲鉾	5,900	933.00	5,504,700
フジッコ	8,200	1,959.00	16,063,800
ロック・フィールド	8,200	1,405.00	11,521,000

日本たばこ産業	433,800	1,961.00	850,681,800
ケンコーマヨネーズ	4,800	1,983.00	9,518,400
わらべや日洋ホールディングス	5,500	1,565.00	8,607,500
なとり	5,400	1,722.00	9,298,800
ピククルスコーポレーション	2,000	2,251.00	4,502,000
北の達人コーポレーション	26,400	502.00	13,252,800
ユーグレナ	33,800	657.00	22,206,600
ミヨシ油脂	4,300	1,069.00	4,596,700
理研ビタミン	7,300	2,044.00	14,921,200
片倉工業	12,400	1,039.00	12,883,600
ゲンゼ	5,500	3,630.00	19,965,000
東洋紡	30,000	1,169.00	35,070,000
ユニチカ	25,200	294.00	7,408,800
富士紡ホールディングス	4,000	2,540.00	10,160,000
倉敷紡績	7,500	2,593.00	19,447,500
日本毛織	23,900	919.00	21,964,100
ダイドーリミテッド	25,600	187.00	4,787,200
帝国繊維	8,600	2,151.00	18,498,600
帝人	59,400	1,727.00	102,583,800
東レ	533,100	460.30	245,385,930
住江織物	2,600	1,714.00	4,456,400
アツギ	10,600	619.00	6,561,400
ダイニック	6,400	690.00	4,416,000
セーレン	18,200	1,252.00	22,786,400
小松マテーレ	13,500	738.00	9,963,000
ワコールホールディングス	19,500	2,233.00	43,543,500
ホギメディカル	8,600	3,775.00	32,465,000
T S Iホールディングス	27,600	388.00	10,708,800
マツオカコーポレーション	3,200	1,794.00	5,740,800
ワールド	10,700	1,301.00	13,920,700
三陽商会	5,100	890.00	4,539,000
オンワードホールディングス	46,200	389.00	17,971,800
ゴールドウイン	13,400	5,500.00	73,700,000
デサント	15,100	1,261.00	19,041,100
特種東海製紙	4,600	4,120.00	18,952,000
王子ホールディングス	303,100	571.00	173,070,100
日本製紙	33,000	1,564.00	51,612,000
三菱製紙	12,500	348.00	4,350,000
北越コーポレーション	48,500	407.00	19,739,500
中越パルプ工業	4,800	1,364.00	6,547,200
大王製紙	32,200	1,492.00	48,042,400
レンゴー	70,300	838.00	58,911,400

トーマック	5,300	1,509.00	7,997,700
ザ・パック	5,800	3,530.00	20,474,000
クラレ	114,400	1,056.00	120,806,400
旭化成	485,900	707.60	343,822,840
昭和電工	51,800	2,307.00	119,502,600
住友化学	527,700	308.00	162,531,600
住友精化	3,500	2,860.00	10,010,000
日産化学	40,900	3,740.00	152,966,000
ラサ工業	3,300	1,270.00	4,191,000
クレハ	6,000	4,270.00	25,620,000
多木化学	2,500	4,330.00	10,825,000
テイカ	5,800	1,469.00	8,520,200
石原産業	14,300	564.00	8,065,200
日本曹達	11,000	2,724.00	29,964,000
東ソー	112,600	1,284.00	144,578,400
トクヤマ	21,100	2,068.00	43,634,800
セントラル硝子	15,600	1,841.00	28,719,600
東亜合成	46,000	919.00	42,274,000
大阪ソーダ	7,300	2,511.00	18,330,300
関東電化工業	18,400	767.00	14,112,800
デンカ	26,500	2,586.00	68,529,000
信越化学工業	125,900	11,125.00	1,400,637,500
日本カーバイド工業	4,500	1,000.00	4,500,000
堺化学工業	5,300	1,710.00	9,063,000
第一稀元素化学工業	9,400	717.00	6,739,800
エア・ウォーター	68,100	1,354.00	92,207,400
大陽日酸	70,900	1,638.00	116,134,200
日本化学工業	2,800	2,196.00	6,148,800
日本パーカライジング	37,400	1,119.00	41,850,600
高压ガス工業	13,000	671.00	8,723,000
チタン工業	2,100	1,644.00	3,452,400
四国化成工業	10,700	986.00	10,550,200
ステラ ケミファ	4,200	2,348.00	9,861,600
保土谷化学工業	3,000	3,080.00	9,240,000
日本触媒	11,500	4,830.00	55,545,000
大日精化工業	6,300	2,201.00	13,866,300
カネカ	18,700	2,635.00	49,274,500
三菱瓦斯化学	68,000	1,258.00	85,544,000
三井化学	65,800	1,897.00	124,822,600
J S R	68,600	1,898.00	130,202,800
東京応化工業	12,600	3,940.00	49,644,000
大阪有機化学工業	6,700	1,500.00	10,050,000

三菱ケミカルホールディングス	489,400	602.50	294,863,500
KHネオケム	13,200	1,581.00	20,869,200
ダイセル	100,100	786.00	78,678,600
住友ベークライト	11,900	2,356.00	28,036,400
積水化学工業	155,600	1,380.00	214,728,000
日本ゼオン	66,600	819.00	54,545,400
アイカ工業	22,000	3,100.00	68,200,000
宇部興産	36,000	1,639.00	59,004,000
積水樹脂	13,200	2,046.00	27,007,200
タキロンシーアイ	17,400	578.00	10,057,200
旭有機材	4,800	1,322.00	6,345,600
日立化成	34,100	4,620.00	157,542,000
ニチバン	4,600	1,478.00	6,798,800
リケンテクノス	19,800	384.00	7,603,200
大倉工業	3,900	1,565.00	6,103,500
積水化成成品工業	10,900	564.00	6,147,600
群栄化学工業	2,400	2,520.00	6,048,000
ミライアル	3,800	992.00	3,769,600
ダイキョーニシカワ	15,400	456.00	7,022,400
森六ホールディングス	5,300	1,380.00	7,314,000
日本化薬	46,500	957.00	44,500,500
カーリットホールディングス	11,500	457.00	5,255,500
日本精化	6,700	1,438.00	9,634,600
扶桑化学工業	7,300	2,954.00	21,564,200
トリケミカル研究所	1,700	8,690.00	14,773,000
ADEKA	33,600	1,302.00	43,747,200
日油	27,600	3,455.00	95,358,000
ハリマ化成グループ	6,500	1,030.00	6,695,000
花王	179,400	8,725.00	1,565,265,000
第一工業製薬	2,900	3,955.00	11,469,500
三洋化成工業	4,300	3,880.00	16,684,000
大日本塗料	9,100	846.00	7,698,600
日本ペイントホールディングス	60,600	5,770.00	349,662,000
関西ペイント	82,700	2,044.00	169,038,800
中国塗料	21,800	812.00	17,701,600
日本特殊塗料	6,100	782.00	4,770,200
藤倉化成	13,200	469.00	6,190,800
太陽ホールディングス	5,400	4,030.00	21,762,000
DIC	30,600	2,350.00	71,910,000
サカタインクス	15,800	862.00	13,619,600
東洋インキSCホールディングス	13,800	2,061.00	28,441,800
T&K TOKA	7,600	720.00	5,472,000

富士フィルムホールディングス	143,800	5,471.00	786,729,800
資生堂	148,900	6,496.00	967,254,400
ライオン	97,300	2,206.00	214,643,800
高砂香料工業	5,200	2,042.00	10,618,400
マンダム	17,300	2,094.00	36,226,200
ミルボン	10,000	5,040.00	50,400,000
ファンケル	30,500	2,476.00	75,518,000
コーセー	14,100	13,470.00	189,927,000
コタ	5,720	1,196.00	6,841,120
ポーラ・オルビスホールディングス	31,900	2,039.00	65,044,100
ノエビアホールディングス	7,000	5,280.00	36,960,000
エステー	5,600	1,494.00	8,366,400
アグロ カネショウ	3,400	1,658.00	5,637,200
コニシ	12,100	1,388.00	16,794,800
長谷川香料	10,300	2,008.00	20,682,400
小林製薬	20,900	10,440.00	218,196,000
荒川化学工業	7,000	1,164.00	8,148,000
メック	5,800	1,493.00	8,659,400
タカラバイオ	19,800	2,160.00	42,768,000
J C U	9,200	2,264.00	20,828,800
デクセリアルズ	20,700	698.00	14,448,600
アース製薬	5,800	5,540.00	32,132,000
北興化学工業	9,100	547.00	4,977,700
大成ラミック	3,600	2,539.00	9,140,400
クミアイ化学工業	31,400	844.00	26,501,600
日本農薬	16,100	416.00	6,697,600
アキレス	5,800	1,566.00	9,082,800
有沢製作所	12,800	806.00	10,316,800
日東電工	51,300	4,850.00	248,805,000
レック	8,800	1,104.00	9,715,200
三光合成	13,900	240.00	3,336,000
藤森工業	6,200	3,075.00	19,065,000
前澤化成工業	7,500	993.00	7,447,500
未来工業	5,000	1,906.00	9,530,000
J S P	5,000	1,334.00	6,670,000
エフピコ	8,500	7,710.00	65,535,000
天馬	5,400	1,581.00	8,537,400
信越ポリマー	13,400	823.00	11,028,200
東リ	23,100	250.00	5,775,000
ニフコ	26,800	1,876.00	50,276,800
バルカー	6,200	1,806.00	11,197,200
ユニ・チャーム	144,800	3,989.00	577,607,200

協和キリン	75,100	2,431.00	182,568,100
武田薬品工業	623,400	3,608.00	2,249,227,200
アステラス製薬	648,600	1,723.00	1,117,537,800
大日本住友製薬	55,900	1,414.00	79,042,600
塩野義製薬	95,600	5,454.00	521,402,400
あすか製薬	9,800	1,116.00	10,936,800
日本新薬	19,700	7,920.00	156,024,000
中外製薬	78,000	13,565.00	1,058,070,000
科研製薬	12,900	5,810.00	74,949,000
エーザイ	89,600	7,599.00	680,870,400
ロート製薬	38,600	3,015.00	116,379,000
小野薬品工業	172,100	2,533.00	435,929,300
久光製薬	19,700	4,930.00	97,121,000
持田製薬	10,500	4,330.00	45,465,000
参天製薬	139,400	1,833.00	255,520,200
扶桑薬品工業	4,100	2,077.00	8,515,700
日本ケミファ	2,000	2,419.00	4,838,000
ツムラ	23,300	2,840.00	66,172,000
日医工	21,500	1,387.00	29,820,500
キッセイ薬品工業	13,500	2,566.00	34,641,000
生化学工業	14,900	1,079.00	16,077,100
栄研化学	13,400	2,150.00	28,810,000
鳥居薬品	5,000	2,855.00	14,275,000
JCRファーマ	5,300	10,470.00	55,491,000
東和薬品	9,600	2,267.00	21,763,200
富士製薬工業	5,900	1,213.00	7,156,700
沢井製薬	15,300	6,080.00	93,024,000
ゼリア新薬工業	13,900	2,034.00	28,272,600
第一三共	214,200	7,432.00	1,591,934,400
キョーリン製薬ホールディングス	16,800	2,236.00	37,564,800
大幸薬品	9,900	1,834.00	18,156,600
ダイト	4,700	2,955.00	13,888,500
大塚ホールディングス	142,600	4,215.00	601,059,000
大正製薬ホールディングス	15,700	6,540.00	102,678,000
ペプチドリーム	38,200	3,465.00	132,363,000
日本コークス工業	90,100	60.00	5,406,000
ニチレキ	9,400	1,341.00	12,605,400
ユシロ化学工業	6,400	1,133.00	7,251,200
富士石油	29,000	184.00	5,336,000
出光興産	83,700	2,491.00	208,496,700
JXTGホールディングス	1,131,100	374.30	423,370,730
コスモエネルギーホールディングス	22,100	1,602.00	35,404,200

横浜ゴム	43,000	1,303.00	56,029,000
TOYO TIRE	44,000	1,157.00	50,908,000
ブリヂストン	215,700	3,255.00	702,103,500
住友ゴム工業	66,900	989.00	66,164,100
オカモト	4,700	4,280.00	20,116,000
ニッタ	8,100	1,886.00	15,276,600
住友理工	16,100	544.00	8,758,400
三ツ星ベルト	10,200	1,302.00	13,280,400
バンドー化学	14,400	592.00	8,524,800
日東紡績	11,200	4,675.00	52,360,000
A G C	73,800	2,554.00	188,485,200
日本板硝子	11,500	309.00	3,553,500
日本山村硝子	5,400	834.00	4,503,600
日本電気硝子	30,600	1,433.00	43,849,800
オハラ	4,000	908.00	3,632,000
住友大阪セメント	14,700	3,310.00	48,657,000
太平洋セメント	47,500	2,053.00	97,517,500
日本ヒューム	10,600	561.00	5,946,600
日本コンクリート工業	22,200	242.00	5,372,400
三谷セキサン	3,600	4,340.00	15,624,000
アジアパイルホールディングス	15,000	409.00	6,135,000
東海カーボン	78,700	907.00	71,380,900
日本カーボン	3,900	3,270.00	12,753,000
東洋炭素	4,900	1,408.00	6,899,200
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	3,355.00	14,091,000
T O T O	53,500	3,530.00	188,855,000
日本碍子	91,000	1,273.00	115,843,000
日本特殊陶業	58,100	1,465.00	85,116,500
M A R U W A	2,900	6,420.00	18,618,000
品川リフラクトリーズ	2,400	2,134.00	5,121,600
黒崎播磨	1,700	3,660.00	6,222,000
ヨータイ	8,200	643.00	5,272,600
東京窯業	16,500	289.00	4,768,500
フジインコーポレーテッド	6,900	2,614.00	18,036,600
ニチアス	20,100	2,003.00	40,260,300
ニチハ	10,400	1,958.00	20,363,200
日本製鉄	331,900	844.00	280,123,600
神戸製鋼所	137,400	339.00	46,578,600
中山製鋼所	13,000	382.00	4,966,000
合同製鐵	4,600	1,883.00	8,661,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,700	666.00	132,334,200
東京製鐵	36,600	667.00	24,412,200

共英製鋼	8,700	1,291.00	11,231,700
大和工業	16,300	1,959.00	31,931,700
東京鐵鋼	4,300	1,103.00	4,742,900
大阪製鐵	4,500	1,214.00	5,463,000
淀川製鋼所	9,700	1,729.00	16,771,300
丸一鋼管	24,000	2,418.00	58,032,000
モリ工業	2,600	2,236.00	5,813,600
大同特殊鋼	12,100	3,340.00	40,414,000
日本冶金工業	6,300	1,597.00	10,061,100
山陽特殊製鋼	6,300	860.00	5,418,000
愛知製鋼	4,200	2,916.00	12,247,200
日立金属	80,600	1,069.00	86,161,400
大平洋金属	5,500	1,668.00	9,174,000
新日本電工	53,400	151.00	8,063,400
栗本鐵工所	4,300	1,822.00	7,834,600
三菱製鋼	6,700	809.00	5,420,300
シンニッタン	15,600	245.00	3,822,000
大紀アルミニウム工業所	11,000	556.00	6,116,000
日本輕金属ホールディングス	191,100	164.00	31,340,400
三井金属鉱業	20,400	1,841.00	37,556,400
東邦亜鉛	4,600	1,170.00	5,382,000
三菱マテリアル	49,100	2,088.00	102,520,800
住友金属鉱山	94,900	2,392.00	227,000,800
D O W A ホールディングス	18,700	2,829.00	52,902,300
古河機械金属	13,100	1,050.00	13,755,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,100	884.00	8,044,400
東邦チタニウム	14,700	585.00	8,599,500
U A C J	11,400	1,595.00	18,183,000
C K サンエツ	2,000	2,698.00	5,396,000
古河電気工業	22,700	1,910.00	43,357,000
住友電気工業	276,100	1,044.50	288,386,450
フジクラ	92,900	292.00	27,126,800
昭和電線ホールディングス	9,600	1,019.00	9,782,400
タツタ電線	16,300	480.00	7,824,000
リョービ	8,800	1,197.00	10,533,600
アーレスティ	13,200	339.00	4,474,800
アサヒホールディングス	13,500	2,278.00	30,753,000
稲葉製作所	6,500	1,239.00	8,053,500
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,535.00	5,065,500
トーカロ	20,700	953.00	19,727,100
アルファC o	4,300	917.00	3,943,100
S U M C O	88,800	1,416.00	125,740,800

川田テクノロジーズ	1,800	5,570.00	10,026,000
RS Technologies	2,600	2,372.00	6,167,200
東洋製罐グループホールディングス	48,000	1,135.00	54,480,000
ホッカンホールディングス	4,800	1,493.00	7,166,400
コロナ	5,900	938.00	5,534,200
横河ブリッジホールディングス	14,000	1,877.00	26,278,000
三和ホールディングス	70,800	788.00	55,790,400
文化シャッター	22,500	786.00	17,685,000
三協立山	10,500	911.00	9,565,500
アルインコ	7,700	935.00	7,199,500
LIXILグループ	109,600	1,255.00	137,548,000
ノーリツ	15,700	1,154.00	18,117,800
長府製作所	7,300	2,157.00	15,746,100
リンナイ	14,600	7,850.00	114,610,000
日東精工	12,400	502.00	6,224,800
岡部	15,400	718.00	11,057,200
ジーテクト	8,900	1,075.00	9,567,500
東プレ	13,600	1,111.00	15,109,600
高周波熱錬	15,000	594.00	8,910,000
東京製綱	7,900	542.00	4,281,800
パイオラックス	10,100	1,553.00	15,685,300
エイチワン	9,300	484.00	4,501,200
日本発條	79,600	680.00	54,128,000
三益半導体工業	5,700	1,922.00	10,955,400
日本製鋼所	23,300	1,263.00	29,427,900
三浦工業	32,200	4,090.00	131,698,000
タクマ	24,900	1,238.00	30,826,200
ツガミ	15,600	813.00	12,682,800
オークマ	8,500	3,320.00	28,220,000
芝浦機械	8,800	2,016.00	17,740,800
アマダ	92,700	855.00	79,258,500
アイダエンジニアリング	18,800	693.00	13,028,400
F U J I	30,600	1,600.00	48,960,000
牧野フライス製作所	8,600	2,821.00	24,260,600
オーエスジー	35,000	1,286.00	45,010,000
旭ダイヤモンド工業	20,300	467.00	9,480,100
D M G 森精機	46,600	894.00	41,660,400
ソディック	18,100	687.00	12,434,700
ディスコ	10,000	22,700.00	227,000,000
日東工器	4,500	1,631.00	7,339,500
日進工具	2,600	2,585.00	6,721,000
パンチ工業	10,100	308.00	3,110,800

豊和工業	5,700	635.00	3,619,500
島精機製作所	12,100	1,542.00	18,658,200
オプトラン	8,500	2,727.00	23,179,500
イワキポンプ	4,900	895.00	4,385,500
フリュー	9,200	839.00	7,718,800
ヤマシンフィルタ	16,300	841.00	13,708,300
日阪製作所	10,600	736.00	7,801,600
やまびこ	14,000	781.00	10,934,000
平田機工	3,500	4,820.00	16,870,000
ペガサスミシン製造	13,700	379.00	5,192,300
マルマエ	4,200	755.00	3,171,000
タツモ	3,900	1,077.00	4,200,300
ナプテスコ	43,400	2,722.00	118,134,800
三井海洋開発	8,200	1,453.00	11,914,600
レオン自動機	7,700	1,170.00	9,009,000
S M C	23,500	48,320.00	1,135,520,000
ホソカワミクロン	2,600	4,770.00	12,402,000
ユニオンツール	3,000	2,591.00	7,773,000
オイレス工業	9,700	1,367.00	13,259,900
日精エー・エス・ビー機械	2,800	2,959.00	8,285,200
サトーホールディングス	10,800	2,037.00	21,999,600
技研製作所	6,800	3,760.00	25,568,000
日精樹脂工業	7,700	952.00	7,330,400
小松製作所	338,700	1,846.00	625,240,200
住友重機械工業	42,300	2,122.00	89,760,600
日立建機	29,400	2,417.00	71,059,800
日工	13,400	582.00	7,798,800
巴工業	4,200	1,989.00	8,353,800
井関農機	8,100	1,153.00	9,339,300
T O W A	8,800	786.00	6,916,800
北川鉄工所	3,700	1,539.00	5,694,300
ローツェ	3,400	4,125.00	14,025,000
クボタ	397,400	1,243.50	494,166,900
荏原実業	2,600	2,157.00	5,608,200
三菱化工機	3,700	1,659.00	6,138,300
月島機械	14,300	1,245.00	17,803,500
帝国電機製作所	7,300	1,321.00	9,643,300
新東工業	17,200	756.00	13,003,200
澁谷工業	6,600	2,567.00	16,942,200
アイチ コーポレーション	14,100	658.00	9,277,800
小森コーポレーション	19,000	769.00	14,611,000
鶴見製作所	6,000	2,010.00	12,060,000

住友精密工業	2,100	2,275.00	4,777,500
酒井重工業	1,900	2,125.00	4,037,500
荏原製作所	31,300	2,150.00	67,295,000
西島製作所	10,400	771.00	8,018,400
北越工業	9,300	1,017.00	9,458,100
ダイキン工業	95,400	13,690.00	1,306,026,000
オルガノ	2,700	5,210.00	14,067,000
トーヨーカネツ	4,200	1,892.00	7,946,400
栗田工業	40,200	2,638.00	106,047,600
椿本チエイン	9,800	2,365.00	23,177,000
大同工業	6,800	669.00	4,549,200
アネスト岩田	11,900	857.00	10,198,300
ダイフク	38,000	7,040.00	267,520,000
加藤製作所	6,000	1,195.00	7,170,000
タダノ	37,200	748.00	27,825,600
フジテック	26,300	1,552.00	40,817,600
C K D	21,000	1,594.00	33,474,000
キトー	7,500	984.00	7,380,000
平和	21,100	1,866.00	39,372,600
理想科学工業	6,900	1,479.00	10,205,100
S A N K Y O	17,100	3,025.00	51,727,500
日本金銭機械	10,700	531.00	5,681,700
マースグループホールディングス	5,900	1,655.00	9,764,500
フクシマガリレイ	4,500	3,165.00	14,242,500
ダイコク電機	5,300	1,141.00	6,047,300
竹内製作所	12,400	1,388.00	17,211,200
アマノ	19,700	2,313.00	45,566,100
J U K I	11,900	574.00	6,830,600
マックス	11,500	1,594.00	18,331,000
グローリー	19,300	2,391.00	46,146,300
新晃工業	7,200	1,444.00	10,396,800
大和冷機工業	11,200	939.00	10,516,800
セガサミーホールディングス	75,000	1,300.00	97,500,000
日本ピストンリング	4,400	1,136.00	4,998,400
リケン	3,700	2,868.00	10,611,600
T P R	9,000	1,146.00	10,314,000
ツバキ・ナカシマ	16,500	615.00	10,147,500
ホシザキ	21,900	7,700.00	168,630,000
大豊工業	8,200	532.00	4,362,400
日本精工	138,200	660.00	91,212,000
N T N	174,500	182.00	31,759,000
ジェイテクト	69,200	711.00	49,201,200

不二越	7,000	2,735.00	19,145,000
日本トムソン	24,300	354.00	8,602,200
THK	43,400	2,309.00	100,210,600
ユーシン精機	7,700	664.00	5,112,800
前澤給装工業	3,700	1,969.00	7,285,300
イーグル工業	9,600	678.00	6,508,800
日本ピラー工業	8,000	1,216.00	9,728,000
キット	31,300	632.00	19,781,600
マキタ	97,400	3,310.00	322,394,000
日立造船	60,300	340.00	20,502,000
三菱重工業	125,500	2,634.00	330,567,000
IHI	54,200	1,200.00	65,040,000
スター精密	11,800	1,060.00	12,508,000
日清紡ホールディングス	50,400	703.00	35,431,200
イビデン	45,800	2,162.00	99,019,600
コニカミノルタ	166,300	380.00	63,194,000
ブラザー工業	90,600	1,695.00	153,567,000
ミネベアミツミ	137,900	1,598.00	220,364,200
日立製作所	359,800	3,079.00	1,107,824,200
三菱電機	748,200	1,305.50	976,775,100
富士電機	44,900	2,429.00	109,062,100
東洋電機製造	4,200	1,200.00	5,040,000
安川電機	80,300	3,055.00	245,316,500
シンフォニアテクノロジー	11,000	910.00	10,010,000
明電舎	14,000	1,574.00	22,036,000
オリジン	3,400	1,429.00	4,858,600
山洋電気	3,700	4,175.00	15,447,500
デンヨー	6,700	1,920.00	12,864,000
東芝テック	9,500	3,380.00	32,110,000
芝浦メカトロニクス	1,700	2,362.00	4,015,400
マブチモーター	20,500	3,145.00	64,472,500
日本電産	180,300	5,561.00	1,002,648,300
トレックス・セミコンダクター	5,500	1,009.00	5,549,500
東光高岳	6,500	900.00	5,850,000
宮越ホールディングス	4,300	521.00	2,240,300
ダイヘン	8,000	2,905.00	23,240,000
ヤーマン	13,800	706.00	9,742,800
JVCケンウッド	65,300	178.00	11,623,400
ミマキエンジニアリング	11,300	396.00	4,474,800
第一精工	3,900	2,100.00	8,190,000
日新電機	18,100	885.00	16,018,500
大崎電気工業	18,000	495.00	8,910,000

オムロン	66,800	5,790.00	386,772,000
日東工業	10,900	1,804.00	19,663,600
I D E C	11,300	1,389.00	15,695,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,500	1,412.00	36,006,000
サクサホールディングス	3,000	1,577.00	4,731,000
メルコホールディングス	3,200	2,715.00	8,688,000
日本電気	90,800	4,015.00	364,562,000
富士通	72,300	10,040.00	725,892,000
沖電気工業	31,000	994.00	30,814,000
電気興業	4,000	2,388.00	9,552,000
サンケン電気	8,600	1,987.00	17,088,200
アイホン	5,100	1,478.00	7,537,800
ルネサスエレクトロニクス	360,100	448.00	161,324,800
セイコーエプソン	91,900	1,014.00	93,186,600
ワコム	54,900	331.00	18,171,900
アルバック	14,000	2,634.00	36,876,000
E I Z O	5,900	3,100.00	18,290,000
日本信号	19,400	982.00	19,050,800
京三製作所	19,700	452.00	8,904,400
能美防災	10,100	2,018.00	20,381,800
ホーチキ	5,800	1,297.00	7,522,600
エレコム	8,300	4,370.00	36,271,000
パナソニック	855,400	794.10	679,273,140
シャープ	86,600	1,140.00	98,724,000
アンリツ	48,400	2,087.00	101,010,800
富士通ゼネラル	20,700	1,812.00	37,508,400
ソニー	473,700	6,507.00	3,082,365,900
T D K	36,000	8,600.00	309,600,000
帝国通信工業	5,800	1,168.00	6,774,400
タムラ製作所	26,300	377.00	9,915,100
アルプスアルパイン	66,900	994.00	66,498,600
日本トリム	1,600	2,838.00	4,540,800
ローランド ディー . ジー .	5,300	1,240.00	6,572,000
フォスター電機	8,700	1,077.00	9,369,900
S M K	2,400	2,352.00	5,644,800
ヨコオ	5,000	2,222.00	11,110,000
ホシデン	20,000	834.00	16,680,000
ヒロセ電機	11,500	10,960.00	126,040,000
日本航空電子工業	17,200	1,298.00	22,325,600
T O A	9,600	704.00	6,758,400
マクセルホールディングス	16,500	988.00	16,302,000
古野電気	11,000	863.00	9,493,000

ユニデンホールディングス	2,800	1,783.00	4,992,400
スミダコーポレーション	6,900	632.00	4,360,800
アイコム	4,600	2,495.00	11,477,000
リオン	3,800	2,287.00	8,690,600
船井電機	10,700	456.00	4,879,200
横河電機	69,000	1,342.00	92,598,000
新電元工業	3,000	2,331.00	6,993,000
アズビル	47,000	2,762.00	129,814,000
東亜ディーケーケー	5,500	897.00	4,933,500
日本光電工業	31,300	3,785.00	118,470,500
チノー	4,200	1,232.00	5,174,400
共和電業	15,200	372.00	5,654,400
堀場製作所	14,900	5,360.00	79,864,000
アドバンテスト	55,600	4,430.00	246,308,000
エスベック	7,000	1,574.00	11,018,000
キーエンス	67,900	36,430.00	2,473,597,000
日置電機	4,200	3,045.00	12,789,000
シスメックス	53,600	7,950.00	426,120,000
日本マイクロニクス	14,100	770.00	10,857,000
メガチップス	7,800	1,536.00	11,980,800
O B A R A G R O U P	4,100	2,422.00	9,930,200
コーセル	11,700	911.00	10,658,700
イリソ電子工業	6,500	3,010.00	19,565,000
オブテックスグループ	13,100	1,008.00	13,204,800
千代田インテグレ	4,500	1,688.00	7,596,000
レーザーテック	32,800	5,190.00	170,232,000
スタンレー電気	52,300	2,266.00	118,511,800
岩崎電気	4,400	1,275.00	5,610,000
ウシオ電機	42,400	1,016.00	43,078,400
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	339.00	4,440,900
日本セラミック	8,000	1,881.00	15,048,000
山一電機	6,000	1,311.00	7,866,000
図研	5,200	2,181.00	11,341,200
日本電子	14,800	2,720.00	40,256,000
カシオ計算機	66,500	1,620.00	107,730,000
ファナック	71,200	14,595.00	1,039,164,000
日本シイエムケイ	19,300	417.00	8,048,100
エンプラス	4,700	2,203.00	10,354,100
ローム	33,100	6,260.00	207,206,000
浜松ホトニクス	53,600	4,440.00	237,984,000
三井ハイテック	9,000	1,078.00	9,702,000
新光電気工業	25,200	1,043.00	26,283,600

京セラ	105,200	6,075.00	639,090,000	
太陽誘電	33,100	2,787.00	92,249,700	
村田製作所	219,900	5,594.00	1,230,120,600	
双葉電子工業	12,300	1,017.00	12,509,100	
北陸電気工業	4,900	851.00	4,169,900	
ニチコン	26,600	650.00	17,290,000	
日本ケミコン	6,500	1,091.00	7,091,500	
K O A	11,900	867.00	10,317,300	
市光工業	12,000	441.00	5,292,000	
小糸製作所	44,400	3,890.00	172,716,000	
ミツバ	14,400	433.00	6,235,200	
S C R E E Nホールディングス	13,200	3,925.00	51,810,000	
キャノン電子	8,100	1,596.00	12,927,600	
キャノン	402,700	2,270.00	914,129,000	
リコー	190,200	686.00	130,477,200	
象印マホービン	22,400	1,481.00	33,174,400	
東京エレクトロン	47,500	21,790.00	1,035,025,000	
トヨタ紡織	22,100	1,238.00	27,359,800	
ユニプレス	14,900	906.00	13,499,400	
豊田自動織機	60,200	5,180.00	311,836,000	
モリタホールディングス	13,600	1,605.00	21,828,000	
三櫻工業	10,700	683.00	7,308,100	
デンソー	164,800	3,676.00	605,804,800	
東海理化電機製作所	19,500	1,314.00	25,623,000	
川崎重工業	58,400	1,452.00	84,796,800	
名村造船所	29,600	191.00	5,653,600	
日本車輛製造	3,300	2,562.00	8,454,600	
三菱ロジスネクスト	10,700	892.00	9,544,400	
日産自動車	885,400	369.00	326,712,600	
いすゞ自動車	219,600	738.70	162,218,520	
トヨタ自動車	835,800	6,525.00	5,453,595,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	95,100	579.00	55,062,900	
三菱自動車工業	279,100	305.00	85,125,500	
エフテック	7,600	419.00	3,184,400	
武蔵精密工業	17,300	770.00	13,321,000	
日産車体	15,300	824.00	12,607,200	
新明和工業	20,400	1,101.00	22,460,400	
極東開発工業	13,900	1,203.00	16,721,700	
日信工業	15,700	2,206.00	34,634,200	
トピー工業	6,800	1,205.00	8,194,000	
ティラド	4,100	1,277.00	5,235,700	
タチエス	12,300	935.00	11,500,500	

N O K	41,100	1,103.00	45,333,300
フタバ産業	21,700	449.00	9,743,300
K Y B	8,300	2,026.00	16,815,800
大同メタル工業	17,200	520.00	8,944,000
プレス工業	42,100	244.00	10,272,400
太平洋工業	16,300	799.00	13,023,700
ケーヒン	17,700	2,540.00	44,958,000
河西工業	11,400	494.00	5,631,600
アイシン精機	61,500	2,736.00	168,264,000
マツダ	219,800	571.00	125,505,800
今仙電機製作所	10,000	685.00	6,850,000
本田技研工業	589,200	2,336.50	1,376,665,800
スズキ	149,100	3,034.00	452,369,400
S U B A R U	233,100	2,005.50	467,482,050
安永	4,500	972.00	4,374,000
ヤマハ発動機	97,000	1,263.00	122,511,000
ショーワ	17,900	2,250.00	40,275,000
T B K	13,100	460.00	6,026,000
エクセディ	10,200	1,544.00	15,748,800
豊田合成	24,500	1,826.00	44,737,000
愛三工業	14,100	525.00	7,402,500
日本プラスト	8,800	425.00	3,740,000
ヨロズ	8,200	1,057.00	8,667,400
エフ・シー・シー	12,500	1,522.00	19,025,000
シマノ	28,000	15,340.00	429,520,000
テイ・エス テック	17,500	2,762.00	48,335,000
ジャムコ	5,800	665.00	3,857,000
テルモ	212,200	3,690.00	783,018,000
日機装	22,800	809.00	18,445,200
日本エム・ディ・エム	5,200	1,463.00	7,607,600
島津製作所	88,900	2,884.00	256,387,600
J M S	8,300	844.00	7,005,200
長野計器	7,800	778.00	6,068,400
ブイ・テクノロジー	3,500	3,200.00	11,200,000
東京計器	6,400	716.00	4,582,400
インターアクション	4,400	1,962.00	8,632,800
東京精密	13,500	3,175.00	42,862,500
マニー	30,200	2,398.00	72,419,600
ニコン	121,300	953.00	115,598,900
トプコン	39,100	799.00	31,240,900
オリンパス	415,700	1,569.00	652,233,300
理研計器	6,400	2,038.00	13,043,200

タムロン	6,300	1,740.00	10,962,000
HOYA	149,700	9,615.00	1,439,365,500
ノーリツ銅機	5,600	1,001.00	5,605,600
エー・アンド・デイ	8,100	636.00	5,151,600
朝日インテック	63,800	2,890.00	184,382,000
シチズン時計	89,400	367.00	32,809,800
メニコン	10,400	4,825.00	50,180,000
松風	4,300	1,554.00	6,682,200
セイコーホールディングス	10,300	1,658.00	17,077,400
ニプロ	53,700	1,181.00	63,419,700
スノーピーク	6,200	714.00	4,426,800
パラマウントベッドホールディングス	7,900	4,425.00	34,957,500
トランザクション	6,000	853.00	5,118,000
ニホンフラッシュ	7,600	1,149.00	8,732,400
前田工織	8,400	1,965.00	16,506,000
永大産業	15,600	265.00	4,134,000
アートネイチャー	10,600	671.00	7,112,600
バンダイナムコホールディングス	77,600	5,523.00	428,584,800
SHOEI	7,600	2,079.00	15,800,400
フランスベッドホールディングス	10,300	863.00	8,888,900
パイロットコーポレーション	12,400	3,350.00	41,540,000
萩原工業	5,200	1,271.00	6,609,200
トッパン・フォームズ	16,000	963.00	15,408,000
フジシールインターナショナル	17,100	1,863.00	31,857,300
タカラトミー	34,500	813.00	28,048,500
廣濟堂	7,600	802.00	6,095,200
プロネクサス	7,400	1,009.00	7,466,600
大建工業	5,500	1,693.00	9,311,500
凸版印刷	104,100	1,543.00	160,626,300
大日本印刷	97,700	2,294.00	224,123,800
共同印刷	2,900	2,703.00	7,838,700
NISSHA	14,600	716.00	10,453,600
TAKARA & COMPANY	4,500	1,765.00	7,942,500
アシックス	62,700	916.00	57,433,200
小松ウオール工業	3,100	1,825.00	5,657,500
ヤマハ	44,300	4,145.00	183,623,500
河合楽器製作所	2,800	2,463.00	6,896,400
クリナップ	9,300	515.00	4,789,500
ピジョン	45,500	4,035.00	183,592,500
オリバー	2,000	2,895.00	5,790,000
キングジム	8,200	814.00	6,674,800
リンテック	17,700	2,297.00	40,656,900

イトーキ	20,000	305.00	6,100,000	
任天堂	45,900	44,310.00	2,033,829,000	
三菱鉛筆	12,500	1,373.00	17,162,500	
タカスタンダード	14,500	1,619.00	23,475,500	
コクヨ	36,000	1,427.00	51,372,000	
ナカバヤシ	9,900	528.00	5,227,200	
グロープライド	4,000	1,731.00	6,924,000	
オカムラ	26,000	775.00	20,150,000	
美津濃	7,000	1,714.00	11,998,000	
東京電力ホールディングス	592,600	372.00	220,447,200	
中部電力	228,900	1,485.50	340,030,950	
関西電力	284,100	1,154.50	327,993,450	
中国電力	107,900	1,490.00	160,771,000	
北陸電力	69,900	729.00	50,957,100	
東北電力	184,600	1,024.00	189,030,400	
四国電力	68,300	829.00	56,620,700	
九州電力	153,200	878.00	134,509,600	
北海道電力	70,500	443.00	31,231,500	
沖縄電力	14,200	1,896.00	26,923,200	
電源開発	59,100	2,120.00	125,292,000	
イーレックス	11,200	1,300.00	14,560,000	
レノバ	13,400	1,011.00	13,547,400	
東京瓦斯	144,800	2,590.50	375,104,400	
大阪瓦斯	144,500	2,033.00	293,768,500	
東邦瓦斯	36,800	5,160.00	189,888,000	
北海道瓦斯	5,600	1,523.00	8,528,800	
広島ガス	22,700	348.00	7,899,600	
西部瓦斯	8,600	2,566.00	22,067,600	
静岡ガス	21,100	943.00	19,897,300	
メタウォーター	3,900	4,040.00	15,756,000	
SBSホールディングス	6,800	1,787.00	12,151,600	
東武鉄道	78,200	3,505.00	274,091,000	
相鉄ホールディングス	24,200	2,748.00	66,501,600	
東急	187,500	1,647.00	308,812,500	
京浜急行電鉄	95,700	1,781.00	170,441,700	
小田急電鉄	110,500	2,313.00	255,586,500	
京王電鉄	38,800	6,070.00	235,516,000	
京成電鉄	51,900	3,010.00	156,219,000	
富士急行	10,500	2,768.00	29,064,000	
新京成電鉄	3,300	2,041.00	6,735,300	
東日本旅客鉄道	131,800	8,224.00	1,083,923,200	
西日本旅客鉄道	66,900	6,954.00	465,222,600	

東海旅客鉄道	62,300	17,475.00	1,088,692,500
西武ホールディングス	100,900	1,238.00	124,914,200
鴻池運輸	11,500	1,171.00	13,466,500
西日本鉄道	21,000	2,546.00	53,466,000
ハマキョウレックス	5,800	2,689.00	15,596,200
サカイ引越センター	3,900	5,580.00	21,762,000
近鉄グループホールディングス	70,500	5,100.00	359,550,000
阪急阪神ホールディングス	93,900	3,590.00	337,101,000
南海電気鉄道	34,200	2,333.00	79,788,600
京阪ホールディングス	31,600	4,725.00	149,310,000
神戸電鉄	2,600	3,680.00	9,568,000
名古屋鉄道	57,800	3,055.00	176,579,000
山陽電気鉄道	6,000	2,002.00	12,012,000
日本通運	25,000	5,040.00	126,000,000
ヤマトホールディングス	124,700	1,911.00	238,301,700
山九	19,700	3,990.00	78,603,000
丸全昭和運輸	6,200	2,261.00	14,018,200
センコーグループホールディングス	38,800	850.00	32,980,000
トナミホールディングス	1,900	4,960.00	9,424,000
ニッコンホールディングス	25,300	2,040.00	51,612,000
福山通運	8,900	3,655.00	32,529,500
セイノーホールディングス	52,600	1,216.00	63,961,600
神奈川中央交通	2,300	3,950.00	9,085,000
日立物流	13,000	2,396.00	31,148,000
丸和運輸機関	7,400	2,707.00	20,031,800
C & F ロジホールディングス	8,200	1,203.00	9,864,600
九州旅客鉄道	62,400	2,918.00	182,083,200
S Gホールディングス	74,700	2,709.00	202,362,300
日本郵船	60,200	1,335.00	80,367,000
商船三井	45,100	1,754.00	79,105,400
川崎汽船	12,800	914.00	11,699,200
N S ユナイテッド海運	5,000	1,386.00	6,930,000
飯野海運	38,200	306.00	11,689,200
乾汽船	6,100	1,195.00	7,289,500
日本航空	128,300	1,969.00	252,622,700
A N Aホールディングス	130,300	2,420.00	315,326,000
トランコム	2,100	7,060.00	14,826,000
日新	6,200	1,678.00	10,403,600
三菱倉庫	23,100	2,165.00	50,011,500
三井倉庫ホールディングス	8,700	1,412.00	12,284,400
住友倉庫	25,100	1,209.00	30,345,900
澁澤倉庫	4,900	1,950.00	9,555,000

東陽倉庫	20,900	320.00	6,688,000
日本トランスシティ	18,500	443.00	8,195,500
川西倉庫	4,000	962.00	3,848,000
安田倉庫	8,000	834.00	6,672,000
東洋埠頭	4,900	1,288.00	6,311,200
上組	39,000	1,820.00	70,980,000
近鉄エクスプレス	14,800	1,500.00	22,200,000
エーアイティー	8,200	759.00	6,223,800
日本コンセプト	3,700	1,382.00	5,113,400
NEC ネットエスアイ	7,000	4,490.00	31,430,000
システナ	26,000	1,456.00	37,856,000
デジタルアーツ	3,800	5,340.00	20,292,000
日鉄ソリューションズ	11,000	2,671.00	29,381,000
キューブシステム	7,700	616.00	4,743,200
コア	4,100	1,164.00	4,772,400
ソリトンシステムズ	4,200	1,328.00	5,577,600
ソフトクリエイティブホールディングス	4,100	1,668.00	6,838,800
T I S	73,600	1,976.00	145,433,600
電算システム	3,800	2,279.00	8,660,200
グリー	47,600	403.00	19,182,800
コーエーテクモホールディングス	14,900	2,685.00	40,006,500
三菱総合研究所	3,300	3,230.00	10,659,000
ファインデックス	8,200	760.00	6,232,000
ブレインパッド	2,100	4,810.00	10,101,000
K L a b	15,500	662.00	10,261,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	10,600	778.00	8,246,800
ネクソン	205,300	1,747.00	358,659,100
エムアップホールディングス	2,500	2,404.00	6,010,000
エイチーム	7,800	662.00	5,163,600
エニグモ	6,600	768.00	5,068,800
コロプラ	25,100	820.00	20,582,000
ブロードリーフ	39,000	493.00	19,227,000
デジタルハーツホールディングス	6,100	766.00	4,672,600
システム情報	5,000	725.00	3,625,000
メディアドゥホールディングス	2,800	3,250.00	9,100,000
じげん	22,900	284.00	6,503,600
バイキューブ	5,300	1,189.00	6,301,700
フィックスターズ	9,300	1,114.00	10,360,200
C A R T A H O L D I N G S	5,300	842.00	4,462,600
オブティム	4,700	2,222.00	10,443,400
セレス	4,000	753.00	3,012,000
S H I F T	2,000	8,980.00	17,960,000

ティーガイア	6,400	2,065.00	13,216,000
セック	1,600	2,769.00	4,430,400
テクマトリックス	5,500	2,368.00	13,024,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,100	1,553.00	28,109,300
GMOペイメントゲートウェイ	12,200	8,370.00	102,114,000
システムリサーチ	2,900	1,428.00	4,141,200
インターネットイニシアティブ	11,200	3,605.00	40,376,000
さくらインターネット	10,600	526.00	5,575,600
GMOクラウド	1,900	2,120.00	4,028,000
SRAホールディングス	4,400	2,127.00	9,358,800
eBASE	9,800	823.00	8,065,400
アバント	6,200	877.00	5,437,400
アドソル日進	3,200	2,271.00	7,267,200
フリービット	5,500	704.00	3,872,000
コムチュア	8,300	2,228.00	18,492,400
アステリア	8,900	346.00	3,079,400
マークラインズ	4,800	1,613.00	7,742,400
メディカル・データ・ビジョン	7,400	714.00	5,283,600
gumi	10,900	588.00	6,409,200
モバイルファクトリー	2,700	1,035.00	2,794,500
テラスカイ	3,000	2,909.00	8,727,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,255.00	5,647,500
ダブルスタンダード	1,300	3,765.00	4,894,500
オープンドア	5,300	821.00	4,351,300
アカツキ	2,800	3,700.00	10,360,000
Ubicomホールディングス	2,600	1,275.00	3,315,000
LINE	16,800	5,240.00	88,032,000
チェンジ	1,800	3,265.00	5,877,000
オークネット	6,400	1,120.00	7,168,000
AOI TYO Holdings	9,500	444.00	4,218,000
マクロミル	16,900	574.00	9,700,600
オロ	2,300	3,100.00	7,130,000
サインポスト	1,800	1,317.00	2,370,600
ソルクシーズ	4,700	548.00	2,575,600
プロトコーポレーション	8,400	848.00	7,123,200
野村総合研究所	104,000	2,476.00	257,504,000
サイバネットシステム	8,000	579.00	4,632,000
インテージホールディングス	11,100	750.00	8,325,000
ソースネクスト	38,700	299.00	11,571,300
インフォコム	8,200	2,689.00	22,049,800
HEROZ	900	3,180.00	2,862,000
ラクスル	4,400	2,219.00	9,763,600

アルテリア・ネットワークス	8,500	2,088.00	17,748,000
フォーカスシステムズ	6,600	703.00	4,639,800
クレスコ	5,500	1,318.00	7,249,000
フジ・メディア・ホールディングス	70,800	1,059.00	74,977,200
オービック	25,500	14,880.00	379,440,000
ジャストシステム	11,900	5,850.00	69,615,000
TDCソフト	7,400	772.00	5,712,800
Zホールディングス	1,011,800	360.00	364,248,000
トレンドマイクロ	32,800	4,725.00	154,980,000
IDホールディングス	3,900	1,341.00	5,229,900
日本オラクル	14,900	9,660.00	143,934,000
アルファシステムズ	2,700	2,757.00	7,443,900
フューチャー	9,100	1,385.00	12,603,500
CAC Holdings	6,100	981.00	5,984,100
SBテクノロジー	3,000	2,406.00	7,218,000
オービックビジネスコンサルタント	7,500	4,630.00	34,725,000
伊藤忠テクノソリューションズ	33,300	3,150.00	104,895,000
アイティフォー	10,900	591.00	6,441,900
大塚商会	39,600	4,615.00	182,754,000
サイボウズ	9,300	1,930.00	17,949,000
ソフトブレーン	6,800	386.00	2,624,800
電通国際情報サービス	4,400	4,050.00	17,820,000
デジタルガレージ	13,600	3,545.00	48,212,000
EMシステムズ	11,600	879.00	10,196,400
ウェザーニューズ	3,100	3,295.00	10,214,500
CIJ	7,500	755.00	5,662,500
WOWOW	3,800	2,428.00	9,226,400
スカラ	8,400	472.00	3,964,800
IMAGICA GROUP	8,700	346.00	3,010,200
ネットワンシステムズ	28,400	2,456.00	69,750,400
アルゴグラフィックス	6,000	3,240.00	19,440,000
マーベラス	14,900	513.00	7,643,700
エイベックス	13,500	827.00	11,164,500
日本ユニシス	23,300	2,922.00	68,082,600
兼松エレクトロニクス	4,000	3,435.00	13,740,000
東京放送ホールディングス	44,800	1,610.00	72,128,000
日本テレビホールディングス	61,300	1,194.00	73,192,200
朝日放送グループホールディングス	10,800	682.00	7,365,600
テレビ朝日ホールディングス	20,700	1,589.00	32,892,300
スカパーJ SATホールディングス	49,700	397.00	19,730,900
テレビ東京ホールディングス	6,200	2,262.00	14,024,400
ビジョン	8,100	723.00	5,856,300

USEN - NEXT HOLDINGS	3,400	1,278.00	4,345,200
コネクシオ	4,800	1,381.00	6,628,800
日本通信	25,500	167.00	4,258,500
日本電信電話	981,600	2,562.50	2,515,350,000
KDDI	547,700	3,100.00	1,697,870,000
ソフトバンク	669,000	1,381.50	924,223,500
光通信	7,600	19,540.00	148,504,000
NTTドコモ	542,400	3,287.00	1,782,868,800
エムティーアイ	10,300	562.00	5,788,600
GMOインターネット	29,500	2,288.00	67,496,000
KADOKAWA	20,400	1,615.00	32,946,000
学研ホールディングス	10,000	1,701.00	17,010,000
ゼンリン	15,300	1,046.00	16,003,800
アイネット	4,700	1,420.00	6,674,000
松竹	4,900	11,520.00	56,448,000
東宝	43,500	3,320.00	144,420,000
東映	2,800	13,520.00	37,856,000
エヌ・ティ・ティ・データ	194,700	1,034.00	201,319,800
ピー・シー・エー	1,500	3,095.00	4,642,500
DTS	15,900	1,912.00	30,400,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	4,950.00	155,925,000
シーイーシー	8,100	1,436.00	11,631,600
カプコン	35,000	3,330.00	116,550,000
ジャステック	6,400	1,016.00	6,502,400
SCSK	17,000	5,240.00	89,080,000
日本システムウエア	3,100	1,826.00	5,660,600
アイネス	7,800	1,302.00	10,155,600
TKC	6,100	4,835.00	29,493,500
富士ソフト	9,500	3,640.00	34,580,000
NSD	23,900	1,437.00	34,344,300
コナミホールディングス	26,800	3,115.00	83,482,000
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,351.00	8,463,600
JBCホールディングス	5,800	1,746.00	10,126,800
ミロク情報サービス	6,700	2,512.00	16,830,400
ソフトバンクグループ	583,200	4,200.00	2,449,440,000
伊藤忠食品	2,100	4,350.00	9,135,000
エレマテック	8,600	786.00	6,759,600
JALUX	3,500	1,582.00	5,537,000
あらた	5,700	4,330.00	24,681,000
東京エレクトロン デバイス	3,400	2,280.00	7,752,000
フィールズ	10,500	320.00	3,360,000
双日	400,100	249.00	99,624,900

アルフレッサ ホールディングス	81,800	2,182.00	178,487,600
横浜冷凍	22,300	886.00	19,757,800
アルコニックス	8,700	1,051.00	9,143,700
神戸物産	25,600	4,920.00	125,952,000
あい ホールディングス	11,500	1,345.00	15,467,500
ダイワボウホールディングス	6,200	6,160.00	38,192,000
マクニカ・富士エレホールディングス	18,400	1,418.00	26,091,200
ラクト・ジャパン	3,000	3,145.00	9,435,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,700	1,101.00	16,184,700
八洲電機	8,800	785.00	6,908,000
レスターホールディングス	8,000	1,643.00	13,144,000
ジューテックホールディングス	3,200	989.00	3,164,800
T O K A Iホールディングス	38,400	929.00	35,673,600
三洋貿易	8,700	802.00	6,977,400
ウイン・パートナーズ	6,500	946.00	6,149,000
シップヘルスケアホールディングス	12,100	4,660.00	56,386,000
コメダホールディングス	16,000	1,589.00	25,424,000
小野建	7,500	1,155.00	8,662,500
佐島電機	7,300	794.00	5,796,200
伯東	5,700	947.00	5,397,900
コンドーテック	7,700	916.00	7,053,200
ナガイレーベン	11,200	2,481.00	27,787,200
三菱食品	7,400	2,644.00	19,565,600
松田産業	6,500	1,276.00	8,294,000
第一興商	11,500	2,783.00	32,004,500
メディバルホールディングス	79,000	2,156.00	170,324,000
S P K	5,400	1,266.00	6,836,400
萩原電気ホールディングス	3,300	2,072.00	6,837,600
アズワン	4,800	9,400.00	45,120,000
尾家産業	3,600	1,430.00	5,148,000
シモジマ	6,100	1,231.00	7,509,100
ドウシシャ	7,700	1,239.00	9,540,300
高速	5,500	1,228.00	6,754,000
ハピネット	7,300	1,075.00	7,847,500
日本ライフライン	21,900	1,255.00	27,484,500
マルカ	3,700	1,704.00	6,304,800
I D O M	22,200	384.00	8,524,800
進和	5,300	1,710.00	9,063,000
ダイトロン	3,900	1,442.00	5,623,800
シークス	10,100	815.00	8,231,500
オーハシテクニカ	5,700	1,351.00	7,700,700
伊藤忠商事	514,700	2,089.00	1,075,208,300

丸紅	769,100	497.50	382,627,250
長瀬産業	41,000	1,283.00	52,603,000
蝶理	5,100	1,458.00	7,435,800
豊田通商	81,400	2,291.00	186,487,400
三共生興	16,400	464.00	7,609,600
兼松	26,500	1,105.00	29,282,500
三井物産	646,800	1,481.00	957,910,800
日本紙パルプ商事	4,400	3,615.00	15,906,000
日立ハイテク	25,700	7,950.00	204,315,000
カメイ	9,500	1,065.00	10,117,500
スターゼン	2,900	4,290.00	12,441,000
山善	26,900	895.00	24,075,500
椿本興業	1,700	3,275.00	5,567,500
住友商事	464,900	1,189.50	552,998,550
内田洋行	3,500	4,265.00	14,927,500
三菱商事	516,900	2,185.50	1,129,684,950
第一実業	3,800	3,515.00	13,357,000
キャノンマーケティングジャパン	21,400	2,122.00	45,410,800
西華産業	6,200	1,091.00	6,764,200
佐藤商事	7,700	790.00	6,083,000
菱洋エレクトロ	7,800	2,249.00	17,542,200
東京産業	9,700	478.00	4,636,600
ユアサ商事	6,500	2,952.00	19,188,000
神鋼商事	2,400	1,650.00	3,960,000
阪和興業	13,900	1,600.00	22,240,000
正栄食品工業	4,900	3,800.00	18,620,000
カナデン	7,400	1,177.00	8,709,800
菱電商事	6,500	1,347.00	8,755,500
フルサト工業	5,000	1,337.00	6,685,000
岩谷産業	17,000	3,675.00	62,475,000
極東貿易	3,200	1,304.00	4,172,800
イワキ	12,900	456.00	5,882,400
三愛石油	17,800	1,126.00	20,042,800
稲畑産業	14,900	1,141.00	17,000,900
明和産業	9,000	467.00	4,203,000
ワキタ	16,600	1,005.00	16,683,000
東邦ホールディングス	23,900	2,339.00	55,902,100
サンゲツ	20,200	1,564.00	31,592,800
ミツウロコグループホールディングス	11,700	1,075.00	12,577,500
シナネンホールディングス	3,800	2,701.00	10,263,800
伊藤忠エネクス	16,100	831.00	13,379,100
サンリオ	22,400	1,469.00	32,905,600

サンワテクノス	6,800	813.00	5,528,400
リョーサン	8,300	2,343.00	19,446,900
新光商事	13,600	830.00	11,288,000
トーホー	5,100	1,677.00	8,552,700
三信電気	5,400	1,413.00	7,630,200
東陽テクニカ	10,400	981.00	10,202,400
モスフードサービス	10,100	2,589.00	26,148,900
加賀電子	7,700	1,724.00	13,274,800
ソーダニッカ	10,500	577.00	6,058,500
立花エレテック	6,000	1,462.00	8,772,000
PALTA C	11,900	5,420.00	64,498,000
太平洋興発	6,600	601.00	3,966,600
西本Wismettacホールディングス	2,000	1,830.00	3,660,000
国際紙パルプ商事	22,900	282.00	6,457,800
ヤマタネ	6,500	1,167.00	7,585,500
日鉄物産	4,700	3,370.00	15,839,000
泉州電業	3,100	2,479.00	7,684,900
トラスコ中山	15,200	2,254.00	34,260,800
オートバックスセブン	29,600	1,261.00	37,325,600
モリト	9,300	635.00	5,905,500
加藤産業	11,100	3,475.00	38,572,500
イノテック	6,000	870.00	5,220,000
イエローハット	14,200	1,431.00	20,320,200
J Kホールディングス	8,700	711.00	6,185,700
日伝	7,000	1,989.00	13,923,000
杉本商事	4,900	1,667.00	8,168,300
因幡電機産業	20,600	2,267.00	46,700,200
東テク	3,100	1,779.00	5,514,900
ミスミグループ本社	92,400	2,414.00	223,053,600
タキヒヨー	4,000	1,570.00	6,280,000
スズケン	31,500	4,145.00	130,567,500
ジェコス	7,200	787.00	5,666,400
ローソン	18,800	5,360.00	100,768,000
サンエー	5,900	4,490.00	26,491,000
カワチ薬品	5,800	2,288.00	13,270,400
エービーシー・マート	11,500	5,080.00	58,420,000
アスクル	7,800	3,190.00	24,882,000
ゲオホールディングス	13,000	1,312.00	17,056,000
アダストリア	10,600	1,318.00	13,970,800
くら寿司	3,900	3,860.00	15,054,000
キャンドウ	5,000	1,701.00	8,505,000
パルグループホールディングス	8,200	1,271.00	10,422,200

エディオン	32,500	912.00	29,640,000
サーラコーポレーション	16,400	558.00	9,151,200
ハローズ	2,900	2,765.00	8,018,500
フジオフードシステム	7,700	1,225.00	9,432,500
あみやき亭	2,300	2,771.00	6,373,300
ひらまつ	22,900	151.00	3,457,900
大黒天物産	2,200	3,410.00	7,502,000
ハニーズホールディングス	7,300	1,107.00	8,081,100
アルペン	6,700	1,537.00	10,297,900
クオールホールディングス	11,400	1,204.00	13,725,600
ジーンズホールディングス	4,000	5,100.00	20,400,000
ビックカメラ	42,300	820.00	34,686,000
D C Mホールディングス	40,200	1,019.00	40,963,800
Monotaro	52,600	2,940.00	154,644,000
DDホールディングス	4,200	707.00	2,969,400
アークランドサービスホールディングス	6,300	1,516.00	9,550,800
J . フロント リテイリング	87,800	779.00	68,396,200
ドトール・日レスホールディングス	10,900	1,644.00	17,919,600
マツモトキヨシホールディングス	30,100	3,645.00	109,714,500
ブロンコビリー	4,300	2,116.00	9,098,800
Z O Z O	51,400	1,617.00	83,113,800
物語コーポレーション	2,000	5,720.00	11,440,000
ココカラファイン	7,700	5,110.00	39,347,000
三越伊勢丹ホールディングス	129,400	621.00	80,357,400
H a m e e	3,600	1,278.00	4,600,800
ウエルシアホールディングス	21,900	7,440.00	162,936,000
クリエイイトSDホールディングス	12,100	2,835.00	34,303,500
チムニー	3,300	1,443.00	4,761,900
シュッピン	7,100	629.00	4,465,900
ネクステージ	11,100	627.00	6,959,700
ジョイフル本田	21,300	1,256.00	26,752,800
鳥貴族	3,200	1,351.00	4,323,200
キリン堂ホールディングス	3,600	1,969.00	7,088,400
ホットランド	6,500	969.00	6,298,500
すかいらーくホールディングス	82,900	1,511.00	125,261,900
S F Pホールディングス	4,300	1,317.00	5,663,100
綿半ホールディングス	3,400	1,602.00	5,446,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,000	976.00	19,520,000
B E E N O S	3,900	827.00	3,225,300
あさひ	6,200	1,267.00	7,855,400
日本調剤	5,300	1,719.00	9,110,700
コスモス薬品	3,300	24,590.00	81,147,000

セブン&アイ・ホールディングス	288,600	3,472.00	1,002,019,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,100	562.00	22,536,200
ツルハホールディングス	16,000	13,370.00	213,920,000
サンマルクホールディングス	5,700	1,742.00	9,929,400
トリドールホールディングス	18,800	1,145.00	21,526,000
T O K Y O B A S E	9,800	241.00	2,361,800
J Mホールディングス	4,200	2,180.00	9,156,000
パロックジャパンリミテッド	7,400	579.00	4,284,600
クスリのアオキホールディングス	6,700	8,310.00	55,677,000
力の源ホールディングス	4,500	588.00	2,646,000
スシローグローバルホールディングス	32,400	1,519.00	49,215,600
L I X I L ビバ	7,400	1,894.00	14,015,600
メディカルシステムネットワーク	9,200	449.00	4,130,800
ノジマ	12,800	1,771.00	22,668,800
カッパ・クリエイト	9,800	1,293.00	12,671,400
良品計画	98,200	1,036.00	101,735,200
アドヴァン	12,200	1,050.00	12,810,000
アルビス	3,600	2,044.00	7,358,400
コナカ	18,000	293.00	5,274,000
G - 7ホールディングス	4,400	2,223.00	9,781,200
イオン北海道	11,900	747.00	8,889,300
コジマ	16,100	352.00	5,667,200
コーナン商事	9,800	2,272.00	22,265,600
エコス	3,200	1,807.00	5,782,400
ワタミ	10,100	938.00	9,473,800
パン・パシフィック・インターナショナルホ	162,300	1,887.00	306,260,100
西松屋チェーン	16,700	852.00	14,228,400
ゼンショーホールディングス	35,800	2,041.00	73,067,800
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,367.00	8,338,700
サイゼリヤ	12,200	1,991.00	24,290,200
V Tホールディングス	32,700	280.00	9,156,000
フジ・コーポレーション	3,000	1,775.00	5,325,000
ユナイテッドアローズ	8,000	1,578.00	12,624,000
ハイデイ日高	10,100	1,480.00	14,948,000
コロワイド	25,200	1,452.00	36,590,400
ピーシーデポコーポレーション	13,100	473.00	6,196,300
壱番屋	5,300	4,145.00	21,968,500
スギホールディングス	14,800	5,660.00	83,768,000
薬王堂ホールディングス	3,500	2,327.00	8,144,500
ヴィア・ホールディングス	13,700	410.00	5,617,000
スクロール	15,800	282.00	4,455,600
ヨンドシーホールディングス	7,800	1,766.00	13,774,800

ファミリーマート	59,200	1,696.00	100,403,200
木曽路	9,300	2,325.00	21,622,500
S R S ホールディングス	11,200	810.00	9,072,000
千趣会	17,800	350.00	6,230,000
ケーヨー	19,400	514.00	9,971,600
上新電機	8,100	1,918.00	15,535,800
日本瓦斯	11,900	3,400.00	40,460,000
ロイヤルホールディングス	12,400	1,635.00	20,274,000
いなげや	9,200	1,529.00	14,066,800
島忠	14,000	2,691.00	37,674,000
チヨダ	9,200	1,044.00	9,604,800
ライフコーポレーション	5,600	3,250.00	18,200,000
リンガーハット	9,100	2,027.00	18,445,700
Mr M a x H D	12,500	401.00	5,012,500
A O K I ホールディングス	14,900	666.00	9,923,400
オークワ	11,400	1,519.00	17,316,600
コメリ	11,300	1,935.00	21,865,500
青山商事	15,200	849.00	12,904,800
しまむら	8,500	6,360.00	54,060,000
高島屋	54,500	959.00	52,265,500
松屋	16,800	654.00	10,987,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,000	808.00	28,280,000
近鉄百貨店	3,000	2,330.00	6,990,000
丸井グループ	68,000	1,646.00	111,928,000
アクシアル リテイリング	6,000	3,895.00	23,370,000
イオン	283,300	2,176.00	616,460,800
イズミ	15,100	2,826.00	42,672,600
平和堂	14,300	1,774.00	25,368,200
フジ	8,600	1,756.00	15,101,600
ヤオコー	8,100	6,330.00	51,273,000
ゼビオホールディングス	10,100	867.00	8,756,700
ケーズホールディングス	70,700	1,139.00	80,527,300
O l y m p i c グループ	6,800	606.00	4,120,800
日産東京販売ホールディングス	18,400	204.00	3,753,600
Genky DrugStores	3,700	2,057.00	7,610,900
ブックオフグループホールディングス	5,900	803.00	4,737,700
アインホールディングス	9,300	5,890.00	54,777,000
元気寿司	2,500	2,150.00	5,375,000
ヤマダ電機	224,700	512.00	115,046,400
アークランドサカモト	11,500	994.00	11,431,000
ニトリホールディングス	32,000	15,405.00	492,960,000
グルメ杵屋	7,900	858.00	6,778,200

吉野家ホールディングス	24,300	2,098.00	50,981,400
松屋フーズホールディングス	3,500	3,690.00	12,915,000
サガミホールディングス	10,000	1,202.00	12,020,000
関西スーパーマーケット	7,200	1,021.00	7,351,200
王将フードサービス	5,300	5,690.00	30,157,000
プレナス	8,300	1,731.00	14,367,300
ミニストップ	6,500	1,423.00	9,249,500
アークス	14,300	1,930.00	27,599,000
パローホールディングス	15,600	1,906.00	29,733,600
ベルク	3,700	5,750.00	21,275,000
大庄	5,400	1,032.00	5,572,800
ファーストリテイリング	9,900	46,350.00	458,865,000
サンドラッグ	27,700	3,365.00	93,210,500
サックスパーホールディングス	8,900	563.00	5,010,700
ペルーナ	17,200	475.00	8,170,000
じもとホールディングス	54,900	90.00	4,941,000
めぶきフィナンシャルグループ	382,600	212.00	81,111,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,098.00	10,980,000
九州フィナンシャルグループ	121,500	443.00	53,824,500
ゆうちょ銀行	210,000	987.00	207,270,000
富山第一銀行	17,000	282.00	4,794,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	435,200	306.00	133,171,200
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	611.00	30,916,600
関西みらいフィナンシャルグループ	45,400	345.00	15,663,000
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,429.00	9,574,300
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	2,246.00	28,748,800
新生銀行	54,300	1,444.00	78,409,200
あおぞら銀行	44,300	2,050.00	90,815,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,052,300	420.80	2,126,007,840
りそなホールディングス	808,800	332.90	269,249,520
三井住友トラスト・ホールディングス	139,500	3,080.00	429,660,000
三井住友フィナンシャルグループ	511,000	2,781.50	1,421,346,500
千葉銀行	246,000	474.00	116,604,000
群馬銀行	144,800	329.00	47,639,200
武蔵野銀行	10,900	1,322.00	14,409,800
千葉興業銀行	20,200	240.00	4,848,000
筑波銀行	30,900	157.00	4,851,300
七十七銀行	25,000	1,302.00	32,550,000
青森銀行	5,600	2,140.00	11,984,000
秋田銀行	5,400	1,355.00	7,317,000
山形銀行	8,200	1,345.00	11,029,000
岩手銀行	4,800	2,587.00	12,417,600

東邦銀行	68,300	242.00	16,528,600
東北銀行	4,000	847.00	3,388,000
みちのく銀行	5,500	1,072.00	5,896,000
ふくおかフィナンシャルグループ	61,300	1,390.00	85,207,000
静岡銀行	183,400	625.00	114,625,000
十六銀行	9,300	1,849.00	17,195,700
スルガ銀行	76,700	348.00	26,691,600
八十二銀行	176,000	373.00	65,648,000
山梨中央銀行	9,200	726.00	6,679,200
大垣共立銀行	14,600	2,073.00	30,265,800
福井銀行	6,200	1,484.00	9,200,800
北國銀行	7,800	3,370.00	26,286,000
清水銀行	3,400	1,758.00	5,977,200
富山銀行	1,600	1,800.00	2,880,000
滋賀銀行	14,700	2,588.00	38,043,600
南都銀行	12,700	2,136.00	27,127,200
百五銀行	69,000	299.00	20,631,000
京都銀行	26,100	3,480.00	90,828,000
紀陽銀行	26,600	1,523.00	40,511,800
ほくほくフィナンシャルグループ	49,300	855.00	42,151,500
広島銀行	107,900	436.00	47,044,400
山陰合同銀行	44,200	560.00	24,752,000
中国銀行	63,300	1,002.00	63,426,600
伊予銀行	104,400	559.00	58,359,600
百十四銀行	7,900	1,911.00	15,096,900
四国銀行	11,600	788.00	9,140,800
阿波銀行	12,200	2,379.00	29,023,800
大分銀行	4,800	2,005.00	9,624,000
宮崎銀行	4,900	2,277.00	11,157,300
佐賀銀行	4,600	1,060.00	4,876,000
沖縄銀行	7,100	3,095.00	21,974,500
琉球銀行	17,800	980.00	17,444,000
セブン銀行	249,900	285.00	71,221,500
みずほフィナンシャルグループ	10,040,200	124.60	1,251,008,920
山口フィナンシャルグループ	93,000	565.00	52,545,000
名古屋銀行	6,000	2,286.00	13,716,000
北洋銀行	116,000	191.00	22,156,000
愛知銀行	2,600	3,005.00	7,813,000
中京銀行	3,000	2,051.00	6,153,000
大光銀行	2,500	1,482.00	3,705,000
愛媛銀行	10,400	1,143.00	11,887,200
京葉銀行	31,000	506.00	15,686,000

栃木銀行	42,700	148.00	6,319,600
北日本銀行	2,700	1,830.00	4,941,000
東和銀行	14,200	600.00	8,520,000
トモニホールディングス	59,400	366.00	21,740,400
フィデアホールディングス	75,000	96.00	7,200,000
池田泉州ホールディングス	89,000	155.00	13,795,000
F P G	24,100	531.00	12,797,100
S B I ホールディングス	82,500	1,736.00	143,220,000
ジャフコ	11,700	3,050.00	35,685,000
大和証券グループ本社	592,000	418.90	247,988,800
野村ホールディングス	1,301,500	427.80	556,781,700
岡三証券グループ	65,600	341.00	22,369,600
丸三証券	26,400	433.00	11,431,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,500	245.00	21,682,500
水戸証券	26,500	195.00	5,167,500
いちよし証券	15,600	440.00	6,864,000
松井証券	42,900	799.00	34,277,100
マネックスグループ	40,400	193.00	7,797,200
極東証券	13,900	529.00	7,353,100
岩井コスモホールディングス	8,000	918.00	7,344,000
藍澤証券	14,500	725.00	10,512,500
スパークス・グループ	32,600	172.00	5,607,200
かんぽ生命保険	27,000	1,320.00	35,640,000
S O M P O ホールディングス	138,700	3,554.00	492,939,800
アニコム ホールディングス	6,000	3,470.00	20,820,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	192,900	3,000.00	578,700,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,600	1,821.00	110,352,600
第一生命ホールディングス	417,300	1,331.50	555,634,950
東京海上ホールディングス	264,200	5,124.00	1,353,760,800
T & D ホールディングス	221,500	875.00	193,812,500
アドバンスクリエイト	2,600	1,762.00	4,581,200
全国保証	21,200	2,950.00	62,540,000
日本モーゲージサービス	2,200	1,560.00	3,432,000
C a s a	3,000	1,068.00	3,204,000
アルヒ	12,100	1,186.00	14,350,600
プレミアグループ	4,400	1,466.00	6,450,400
クレディセゾン	51,200	1,105.00	56,576,000
芙蓉総合リース	7,800	5,360.00	41,808,000
みずほリース	11,900	2,087.00	24,835,300
東京センチュリー	14,700	3,665.00	53,875,500
日本証券金融	31,600	492.00	15,547,200
アイフル	112,300	222.00	24,930,600

リコーリース	6,000	2,802.00	16,812,000
イオンフィナンシャルサービス	44,600	1,095.00	48,837,000
アコム	148,800	447.00	66,513,600
ジャックス	8,500	1,647.00	13,999,500
オリエントコーポレーション	209,500	117.00	24,511,500
日立キャピタル	17,600	1,966.00	34,601,600
アプラスフィナンシャル	45,700	59.00	2,696,300
オリックス	462,000	1,258.00	581,196,000
三菱UFJリース	185,400	495.00	91,773,000
日本取引所グループ	212,000	2,068.00	438,416,000
イー・ギャランティ	8,500	1,830.00	15,555,000
NECキャピタルソリューション	3,000	1,838.00	5,514,000
いちご	98,200	254.00	24,942,800
日本駐車場開発	99,200	133.00	13,193,600
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,340.00	6,432,000
ヒューリック	158,800	966.00	153,400,800
三栄建築設計	3,800	1,145.00	4,351,000
野村不動産ホールディングス	44,800	1,677.00	75,129,600
三重交通グループホールディングス	19,400	488.00	9,467,200
サムティ	9,900	1,268.00	12,553,200
ディア・ライフ	14,300	368.00	5,262,400
日本商業開発	6,100	1,283.00	7,826,300
プレサンスコーポレーション	14,100	1,082.00	15,256,200
ユニゾホールディングス	11,400	5,960.00	67,944,000
日本管理センター	7,000	1,063.00	7,441,000
フージャースホールディングス	17,600	612.00	10,771,200
オープンハウス	21,700	2,128.00	46,177,600
東急不動産ホールディングス	201,200	493.00	99,191,600
飯田グループホールディングス	61,100	1,386.00	84,684,600
ムゲンエステート	10,200	429.00	4,375,800
ビーロッド	5,700	590.00	3,363,000
ハウスドゥ	4,700	733.00	3,445,100
ジェイ・エス・ビー	1,200	4,070.00	4,884,000
パーク24	39,400	1,439.00	56,696,600
パラカ	3,100	1,578.00	4,891,800
三井不動産	364,600	1,891.00	689,458,600
三菱地所	518,000	1,701.00	881,118,000
平和不動産	14,100	2,675.00	37,717,500
東京建物	78,300	1,098.00	85,973,400
ダイビル	20,700	849.00	17,574,300
京阪神ビルディング	13,600	1,323.00	17,992,800
住友不動産	166,400	2,722.50	453,024,000

テオーシー	18,000	601.00	10,818,000
東京楽天地	1,700	4,085.00	6,944,500
スタートコーポレーション	9,400	2,068.00	19,439,200
フジ住宅	11,800	492.00	5,805,600
空港施設	13,300	403.00	5,359,900
ゴールドクレスト	6,900	1,652.00	11,398,800
エスリード	4,000	1,257.00	5,028,000
日神グループホールディングス	14,500	380.00	5,510,000
日本エスコン	14,400	612.00	8,812,800
タカラレーベン	37,200	341.00	12,685,200
A V A N T I A	7,000	546.00	3,822,000
イオンモール	37,600	1,295.00	48,692,000
ファースト住建	4,800	1,024.00	4,915,200
カチタス	18,600	1,794.00	33,368,400
トーセイ	12,000	994.00	11,928,000
サンフロンティア不動産	12,400	790.00	9,796,000
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	783.00	5,950,800
ランドビジネス	7,400	282.00	2,086,800
日本空港ビルデング	23,800	4,130.00	98,294,000
日本工営	4,900	2,773.00	13,587,700
L I F U L L	29,500	321.00	9,469,500
ジェイエイシーリクルートメント	5,300	1,031.00	5,464,300
日本M & Aセンター	54,400	3,185.00	173,264,000
メンバーズ	2,700	1,304.00	3,520,800
UTグループ	8,600	1,046.00	8,995,600
タケエイ	8,600	773.00	6,647,800
ビーネックスグループ	10,800	503.00	5,432,400
コシダカホールディングス	19,800	377.00	7,464,600
パソナグループ	8,400	899.00	7,551,600
リンクアンドモチベーション	18,700	294.00	5,497,800
G C A	10,800	575.00	6,210,000
エス・エム・エス	22,800	2,085.00	47,538,000
パーソルホールディングス	71,800	975.00	70,005,000
リニカル	4,900	859.00	4,209,100
クックパッド	30,600	299.00	9,149,400
学情	3,400	1,103.00	3,750,200
スタジオアリス	5,100	1,496.00	7,629,600
シミックホールディングス	5,000	1,436.00	7,180,000
総合警備保障	28,300	5,220.00	147,726,000
カカクコム	53,200	2,007.00	106,772,400
アイロムグループ	3,500	1,235.00	4,322,500
ルネサンス	5,500	902.00	4,961,000

ディップ	10,200	1,697.00	17,309,400
オプトホールディング	4,500	1,538.00	6,921,000
新日本科学	9,300	568.00	5,282,400
ツクイ	19,600	389.00	7,624,400
ベネフィット・ワン	19,600	1,623.00	31,810,800
エムスリー	157,800	3,700.00	583,860,000
アウトソーシング	40,700	432.00	17,582,400
ウェルネット	11,700	463.00	5,417,100
ワールドホールディングス	2,900	1,245.00	3,610,500
ディー・エヌ・エー	36,400	1,133.00	41,241,200
博報堂D Yホールディングス	98,200	1,051.00	103,208,200
ぐるなび	15,500	528.00	8,184,000
タカミヤ	12,500	405.00	5,062,500
ジャパンベストレスキューシステム	6,500	642.00	4,173,000
ファンコミュニケーションズ	22,800	421.00	9,598,800
ライク	3,200	1,192.00	3,814,400
エスプール	15,500	725.00	11,237,500
WDBホールディングス	3,600	2,242.00	8,071,200
バリューコマース	4,400	1,755.00	7,722,000
インフォマート	80,000	698.00	55,840,000
J Pホールディングス	28,000	258.00	7,224,000
E P Sホールディングス	11,300	1,152.00	13,017,600
プレステージ・インターナショナル	27,100	811.00	21,978,100
アミューズ	4,400	2,123.00	9,341,200
ドリームインキュベータ	3,800	1,073.00	4,077,400
クイック	5,200	952.00	4,950,400
ケネディクス	69,600	413.00	28,744,800
電通グループ	73,800	1,885.00	139,113,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	513.00	2,000,700
ぴあ	2,200	2,060.00	4,532,000
イオンファンタジー	3,400	1,333.00	4,532,200
シーティーエス	9,700	531.00	5,150,700
ネクシィーズグループ	3,300	959.00	3,164,700
みらかホールディングス	20,600	2,334.00	48,080,400
アルプス技研	6,900	1,452.00	10,018,800
日本空調サービス	9,600	679.00	6,518,400
オリエンタルランド	76,100	13,800.00	1,050,180,000
ダスキン	18,200	2,794.00	50,850,800
明光ネットワークジャパン	11,900	733.00	8,722,700
ファルコホールディングス	5,000	1,735.00	8,675,000
ラウンドワン	21,200	678.00	14,373,600
リゾートトラスト	33,700	1,048.00	35,317,600

ビー・エム・エル	9,300	2,727.00	25,361,100
りらいあコミュニケーションズ	13,000	1,049.00	13,637,000
リソー教育	37,700	256.00	9,651,200
ユー・エス・エス	79,800	1,619.00	129,196,200
サイバーエージェント	41,400	4,065.00	168,291,000
楽天	334,500	881.00	294,694,500
クリーク・アンド・リバー社	5,000	839.00	4,195,000
テー・オー・ダブリュー	16,600	262.00	4,349,200
山田コンサルティンググループ	4,600	1,011.00	4,650,600
セントラルスポーツ	3,200	2,040.00	6,528,000
フルキャストホールディングス	7,300	1,118.00	8,161,400
エン・ジャパン	12,700	2,001.00	25,412,700
テクノプロ・ホールディングス	14,300	4,565.00	65,279,500
アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	5,900.00	18,290,000
Gunosy	5,500	886.00	4,873,000
イー・ガーディアン	4,000	1,606.00	6,424,000
ジャパンマテリアル	21,700	1,453.00	31,530,100
ベクトル	10,100	700.00	7,070,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,900	770.00	5,313,000
I B J	6,700	564.00	3,778,800
アサンテ	4,300	1,465.00	6,299,500
N・フィールド	9,300	403.00	3,747,900
バリューHR	3,600	1,382.00	4,975,200
M&Aキャピタルパートナーズ	5,200	2,505.00	13,026,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,639.00	6,228,200
シグマクシス	5,500	1,427.00	7,848,500
ウィルグループ	5,600	556.00	3,113,600
リクルートホールディングス	512,400	2,514.50	1,288,429,800
エラン	4,600	1,596.00	7,341,600
日本郵政	586,600	832.50	488,344,500
ベルシステム24ホールディングス	12,500	1,087.00	13,587,500
鎌倉新書	6,100	1,056.00	6,441,600
LITALICO	3,000	2,148.00	6,444,000
アトラエ	2,200	2,462.00	5,416,400
ストライク	2,800	3,855.00	10,794,000
ソラスト	20,300	966.00	19,609,800
インソース	3,800	1,927.00	7,322,600
ベイカレント・コンサルティング	4,500	5,120.00	23,040,000
グレイステクノロジー	3,600	2,719.00	9,788,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	2,587.00	19,919,900
グリーンズ	5,200	385.00	2,002,000
日総工産	6,000	390.00	2,340,000

キュービーネットホールディングス	4,000	1,612.00	6,448,000	
R P Aホールディングス	4,800	617.00	2,961,600	
スプリックス	4,100	727.00	2,980,700	
カーブスホールディングス	18,600	466.00	8,667,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	645.00	3,805,500	
リログループ	39,400	2,225.00	87,665,000	
東祥	5,900	883.00	5,209,700	
エイチ・アイ・エス	11,400	1,270.00	14,478,000	
共立メンテナンス	11,800	2,334.00	27,541,200	
イチネンホールディングス	9,100	1,063.00	9,673,300	
建設技術研究所	5,500	1,745.00	9,597,500	
燦ホールディングス	4,400	1,210.00	5,324,000	
東京テアトル	4,700	1,144.00	5,376,800	
ナガワ	2,300	7,070.00	16,261,000	
よみうりランド	2,100	3,135.00	6,583,500	
東京都競馬	4,900	3,195.00	15,655,500	
カナモト	11,900	2,107.00	25,073,300	
東京ドーム	30,300	712.00	21,573,600	
西尾レントオール	6,900	2,193.00	15,131,700	
トランス・コスモス	7,100	1,862.00	13,220,200	
乃村工藝社	30,800	807.00	24,855,600	
藤田観光	4,100	1,636.00	6,707,600	
K N T - C Tホールディングス	5,700	758.00	4,320,600	
日本管財	7,400	1,803.00	13,342,200	
トーカイ	6,900	2,904.00	20,037,600	
セコム	75,700	9,043.00	684,555,100	
セントラル警備保障	3,600	4,075.00	14,670,000	
丹青社	14,000	691.00	9,674,000	
メイテック	9,100	4,105.00	37,355,500	
応用地質	7,700	1,251.00	9,632,700	
船井総研ホールディングス	14,500	2,070.00	30,015,000	
オオバ	8,900	532.00	4,734,800	
ベネッセホールディングス	24,100	2,812.00	67,769,200	
イオンディライト	8,400	3,050.00	25,620,000	
ナック	6,000	807.00	4,842,000	
ニチイ学館	11,100	1,057.00	11,732,700	
ダイセキ	12,200	2,265.00	27,633,000	
合 計	87,533,420		148,206,257,960	

(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
新株予約権証券	株式会社千葉興業銀行(ワラント)	27,200		
合計		27,200		

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

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	873,679,468	315,440,332
コール・ローン	74,173,371	219,278,434
国債証券	128,755,928,840	103,352,030,980
地方債証券	13,604,936,260	8,508,860,805
特殊債券	21,878,822,266	13,059,052,368
社債券	8,085,080,000	6,272,811,000
未収入金	340,728,400	-
未収利息	334,209,358	243,655,508
前払費用	4,582,070	6,060,238
流動資産合計	173,952,140,033	131,977,189,665
資産合計	173,952,140,033	131,977,189,665
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	-
未払解約金	572,376,379	1,839,311
未払利息	216	594
その他未払費用	28,877	219,836
流動負債合計	672,405,472	2,059,741
負債合計	672,405,472	2,059,741
純資産の部		
元本等		
元本	135,164,231,551	102,757,947,265
剰余金		
剰余金又は欠損金()	38,115,503,010	29,217,182,659
元本等合計	173,279,734,561	131,975,129,924
純資産合計	173,279,734,561	131,975,129,924
負債純資産合計	173,952,140,033	131,977,189,665

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	135,164,231,551口	102,757,947,265口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2820円 (10,000口当たりの純資産額 12,820円)	1口当たり純資産額 1.2843円 (10,000口当たりの純資産額 12,843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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび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	(2020年 4月13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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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)

(2019年 4月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	164,426,145,427円
同期中における追加設定元本額	19,535,271,602円
同期中における一部解約元本額	48,797,185,478円
2019年 4月15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)	4,482,730,145円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,808,731,235円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,692,996,801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)	601,656,207円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	55,315,846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)	166,178,438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)	284,949,077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)	249,509,952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)	97,802,322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)	205,486,079円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	89,745,240円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,542,502,334円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	681,391,509円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	35,152,756円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,754,258円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	32,572,333円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	12,463,338円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	7,386,803円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,545,151円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,091,687円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	25,016,965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>	5,804,678,114円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	18,391,887,313円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	7,314,559,645円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	17,857,476,316円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	349,856,151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>	586,552,080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>	2,742,513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>	252,488,538円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	112,648,590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>	2,014,357,930円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,167,297,178円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,824,705,632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>	10,766,831,762円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	3,063,620円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,812,140,837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)	11,107,156,241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>	520,836,297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>	373,216,255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)	10,572,184,186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>	927,922,952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>	187,670,363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>	44,089,906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>	2,006,963,386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>	2,524,154,466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>	2,398,251,609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>	1,026,373,073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>	244,033,609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>	18,430,319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>	357,572,916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>	6,290,675,364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>	301,457,933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>	154,310,304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>	1,424,200,086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>	682,426,859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>	1,680,356,767円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,970,683,965円
合計	135,164,231,551円

(2020年 4月13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	135,164,231,551円
同期中における追加設定元本額	26,368,392,039円

同期中における一部解約元本額	58,774,676,325円
2020年 4月13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)	4,916,603,754円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	8,113,528,180円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	1,680,333,318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)	760,735,655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)	50,269,872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)	178,435,133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)	338,879,703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)	323,559,798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)	131,188,831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)	240,773,140円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	120,113,280円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	2,134,904,474円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	857,165,158円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	298,800,465円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	13,814,140円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	1,104,968,204円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	354,564,578円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	480,307,279円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	82,224,866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	43,025,062円
三井住友D S ・ 年金バランス30 (債券重点型)	765,954円
三井住友D S ・ 年金バランス50 (標準型)	1,983,487円
三井住友D S ・ 年金バランス70 (株式重点型)	445,605円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,688,392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 >	15,261,189,102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 >	6,456,184,151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 >	15,516,600,710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 >	310,135,056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 >	527,038,286円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,972,815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 >	215,926,783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 >	103,533,600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 >	1,849,952,469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 >	1,964,073,011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 >	2,434,015,824円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,071,254,432円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	2,114,879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)	1,357,582,563円
S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	448,466,921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 >	622,144,119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 >	170,571,267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 >	41,651,607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 >	1,741,366,557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 >	2,265,783,446円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	884,439,072円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	201,287,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	17,629,769円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	309,173,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,580,424,372円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	257,779,674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>	379,382,709円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,223,935,464円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,393,683,063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>	4,003,193,514円
合計	102,757,947,265円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第403回利付国債(2年)	20,000,000	20,074,200	
	第404回利付国債(2年)	20,000,000	20,079,000	
	第405回利付国債(2年)	60,000,000	60,250,800	
	第407回利付国債(2年)	20,000,000	20,096,600	
	第409回利付国債(2年)	230,000,000	231,205,200	
	第410回利付国債(2年)	3,170,000,000	3,187,308,200	
	第411回利付国債(2年)	50,000,000	50,275,500	
	第130回利付国債(5年)	90,000,000	90,432,900	
	第131回利付国債(5年)	140,000,000	140,786,800	
	第132回利付国債(5年)	95,000,000	95,582,350	
	第133回利付国債(5年)	108,000,000	108,765,720	
	第134回利付国債(5年)	110,000,000	110,845,900	

第135回利付国債(5年)	190,000,000	191,596,000	
第136回利付国債(5年)	400,000,000	403,584,000	
第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,915,000	
第138回利付国債(5年)	600,000,000	605,670,000	
第140回利付国債(5年)	600,000,000	606,054,000	
第141回利付国債(5年)	15,000,000	15,160,650	
第142回利付国債(5年)	1,790,000,000	1,809,403,600	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	60,479,200	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	357,269,440	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	275,857,200	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	371,937,540	
第5回利付国債(40年)	245,000,000	357,511,350	
第6回利付国債(40年)	250,000,000	360,165,000	
第7回利付国債(40年)	265,000,000	367,923,350	
第8回利付国債(40年)	330,000,000	429,821,700	
第9回利付国債(40年)	468,000,000	458,630,640	
第10回利付国債(40年)	470,000,000	539,541,200	
第11回利付国債(40年)	340,000,000	379,168,000	
第12回利付国債(40年)	365,000,000	369,208,450	
第317回利付国債(10年)	55,000,000	56,016,950	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	982,051,200	
第322回利付国債(10年)	365,000,000	372,675,950	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	317,303,600	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	398,334,300	
第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,295,322,050	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,817,200	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,657,500	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	132,948,400	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,093,011,200	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,327,841,900	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	815,188,140	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	839,172,900	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	324,809,100	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,428,000	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	350,176,200	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,460,000	

第338回利付国債(10年)	805,000,000	826,380,800	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	807,129,150	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	792,768,900	
第341回利付国債(10年)	857,000,000	878,604,970	
第342回利付国債(10年)	890,000,000	902,504,500	
第343回利付国債(10年)	710,000,000	720,401,500	
第344回利付国債(10年)	1,051,000,000	1,066,680,920	
第345回利付国債(10年)	838,000,000	850,704,080	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	649,836,800	
第347回利付国債(10年)	430,000,000	436,695,100	
第348回利付国債(10年)	355,000,000	360,587,700	
第349回利付国債(10年)	690,000,000	700,957,200	
第350回利付国債(10年)	980,000,000	995,268,400	
第351回利付国債(10年)	430,000,000	436,553,200	
第352回利付国債(10年)	650,000,000	659,373,000	
第353回利付国債(10年)	800,000,000	810,816,000	
第354回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,047,978,900	
第355回利付国債(10年)	860,000,000	869,890,000	
第356回利付国債(10年)	750,000,000	758,145,000	
第357回利付国債(10年)	1,485,000,000	1,500,102,450	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	630,620,100	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	390,585,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	358,025,300	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	597,225,780	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	115,560,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	620,700,900	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	514,830,400	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	739,087,100	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	965,208,440	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	615,055,500	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	585,733,500	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	639,744,000	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	452,767,650	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	424,563,300	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	444,831,030	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	420,443,700	

第25回利付国債(30年)	300,000,000	398,184,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	488,979,150	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	603,886,800	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	533,220,400	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	242,782,050	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	642,835,680	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	426,084,750	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	537,704,700	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	501,730,740	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	627,387,880	
第35回利付国債(30年)	390,000,000	521,952,600	
第36回利付国債(30年)	100,000,000	134,428,000	
第37回利付国債(30年)	495,000,000	658,023,300	
第38回利付国債(30年)	370,000,000	485,432,600	
第39回利付国債(30年)	170,000,000	227,233,900	
第40回利付国債(30年)	310,000,000	408,239,000	
第41回利付国債(30年)	310,000,000	401,970,800	
第42回利付国債(30年)	200,000,000	259,620,000	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	409,815,000	
第44回利付国債(30年)	290,000,000	377,701,800	
第45回利付国債(30年)	335,000,000	421,577,400	
第46回利付国債(30年)	345,000,000	434,479,200	
第47回利付国債(30年)	330,000,000	423,993,900	
第48回利付国債(30年)	265,000,000	328,072,650	
第49回利付国債(30年)	335,000,000	414,957,800	
第50回利付国債(30年)	385,000,000	420,685,650	
第51回利付国債(30年)	405,000,000	392,607,000	
第52回利付国債(30年)	333,000,000	338,934,060	
第53回利付国債(30年)	177,000,000	184,423,380	
第54回利付国債(30年)	65,000,000	70,976,100	
第55回利付国債(30年)	425,000,000	464,401,750	
第56回利付国債(30年)	390,000,000	425,930,700	
第57回利付国債(30年)	505,000,000	551,904,400	
第58回利付国債(30年)	400,000,000	436,904,000	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	427,148,000	
第60回利付国債(30年)	270,000,000	302,535,000	

第6 1 回利付国債(30年)	315,000,000	336,287,700	
第6 2 回利付国債(30年)	115,000,000	116,769,850	
第6 3 回利付国債(30年)	380,000,000	375,580,600	
第6 4 回利付国債(30年)	335,000,000	330,645,000	
第6 5 回利付国債(30年)	245,000,000	242,109,000	
第5 6 回利付国債(20年)	818,000,000	856,895,900	
第5 9 回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,528,593,900	
第6 1 回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,256,881,050	
第6 4 回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,097,939,000	
第6 5 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,097,479,200	
第6 9 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,110,535,200	
第7 0 回利付国債(20年)	780,000,000	863,187,000	
第7 2 回利付国債(20年)	753,000,000	828,096,690	
第7 4 回利付国債(20年)	664,000,000	733,793,040	
第7 5 回利付国債(20年)	490,000,000	544,233,200	
第7 8 回利付国債(20年)	590,000,000	652,669,800	
第8 2 回利付国債(20年)	620,000,000	695,875,600	
第8 4 回利付国債(20年)	850,000,000	953,963,500	
第8 5 回利付国債(20年)	645,000,000	730,978,500	
第8 8 回利付国債(20年)	742,000,000	854,390,740	
第8 9 回利付国債(20年)	20,000,000	22,904,800	
第9 0 回利付国債(20年)	580,000,000	667,487,200	
第9 2 回利付国債(20年)	734,000,000	843,806,400	
第9 3 回利付国債(20年)	632,000,000	725,649,760	
第9 5 回利付国債(20年)	305,000,000	358,222,500	
第9 7 回利付国債(20年)	677,000,000	793,938,210	
第9 9 回利付国債(20年)	693,000,000	811,066,410	
第1 0 0 回利付国債(20年)	207,000,000	244,866,510	
第1 0 1 回利付国債(20年)	355,000,000	425,613,050	
第1 0 2 回利付国債(20年)	457,000,000	550,355,960	
第1 0 5 回利付国債(20年)	390,000,000	461,615,700	
第1 0 6 回利付国債(20年)	370,000,000	441,084,400	
第1 0 7 回利付国債(20年)	378,000,000	448,890,120	
第1 0 8 回利付国債(20年)	390,000,000	456,335,100	
第1 0 9 回利付国債(20年)	340,000,000	398,942,400	
第1 1 1 回利付国債(20年)	386,000,000	465,052,800	

第113回利付国債(20年)	427,000,000	512,331,680	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	437,037,480	
第116回利付国債(20年)	200,000,000	243,698,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	240,366,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	348,539,550	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	232,232,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	304,605,150	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	390,762,900	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	97,481,600	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	229,499,100	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	252,642,000	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	217,922,400	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	173,973,900	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	258,657,900	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	226,474,300	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	161,221,050	
第131回利付国債(20年)	560,000,000	662,424,000	
第132回利付国債(20年)	300,000,000	355,437,000	
第133回利付国債(20年)	160,000,000	191,414,400	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,916,000	
第135回利付国債(20年)	295,000,000	350,032,250	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	140,973,600	
第137回利付国債(20年)	45,000,000	53,505,450	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,125,250	
第139回利付国債(20年)	20,000,000	23,540,200	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	631,442,000	
第141回利付国債(20年)	270,000,000	322,093,800	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	132,592,900	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	201,013,100	
第144回利付国債(20年)	170,000,000	198,859,200	
第145回利付国債(20年)	200,000,000	239,456,000	
第146回利付国債(20年)	85,000,000	101,948,150	
第147回利付国債(20年)	220,000,000	261,373,200	
第148回利付国債(20年)	229,000,000	269,530,710	
第149回利付国債(20年)	695,000,000	819,043,600	
第150回利付国債(20年)	401,000,000	467,854,720	

	第151回利付国債(20年)	730,000,000	831,762,000	
	第152回利付国債(20年)	335,000,000	382,184,750	
	第153回利付国債(20年)	227,000,000	262,634,460	
	第154回利付国債(20年)	700,000,000	800,016,000	
	第155回利付国債(20年)	310,000,000	345,088,900	
	第156回利付国債(20年)	260,000,000	265,363,800	
	第157回利付国債(20年)	295,000,000	291,569,150	
	第158回利付国債(20年)	330,000,000	341,675,400	
	第159回利付国債(20年)	448,000,000	470,848,000	
	第160回利付国債(20年)	335,000,000	357,455,050	
	第161回利付国債(20年)	610,000,000	640,951,400	
	第162回利付国債(20年)	180,000,000	189,102,600	
	第163回利付国債(20年)	720,000,000	756,273,600	
	第164回利付国債(20年)	215,000,000	222,127,250	
	第165回利付国債(20年)	410,000,000	423,407,000	
	第166回利付国債(20年)	315,000,000	336,423,150	
	第167回利付国債(20年)	470,000,000	484,913,100	
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	192,540,300	
	第169回利付国債(20年)	630,000,000	627,152,400	
	第170回利付国債(20年)	325,000,000	323,511,500	
	第171回利付国債(20年)	355,000,000	353,356,350	
国債証券合計		92,725,000,000	103,352,030,980	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,803,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,154,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,674,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	527,952,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	650,240,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	194,260,455	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,985,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	101,704,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	101,914,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,156,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,843,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,724,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,514,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,514,000	

第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,677,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	201,072,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,882,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,763,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,441,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	110,932,800	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,468,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,087,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	327,918,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	132,273,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	111,396,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,666,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,918,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,569,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,034,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,017,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,776,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,770,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,750,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,929,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,255,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,624,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,150,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	214,440,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	110,101,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	136,151,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,694,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,029,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,172,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,822,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,934,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,371,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,027,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,111,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,506,000	

	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,795,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	149,815,050	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,087,000	
地方債証券合計		7,900,500,000	8,508,860,805	
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	215,426,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,436,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,116,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,973,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,826,000	
	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	303,876,000	
	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	101,835,000	
	第9回道路債券	100,000,000	131,128,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	156,195,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	454,596,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,238,000	
	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	237,068,000	
	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	135,779,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	357,078,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,571,000	
	第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,509,000	
	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	1,014,920,000	
	第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,591,000	
	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	305,793,000	
	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	204,768,000	
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	306,732,000		
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	119,090,000		

第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,967,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,163,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,771,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 (6年)	800,000,000	799,928,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,585,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	234,168,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,263,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,748,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,051,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,436,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,709,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,024,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,340,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,128,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,079,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	104,920,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,996,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,510,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,463,000	11,683,777	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,749,000	14,327,832	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,955,000	12,189,078	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,266,000	16,000,905	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,106,000	27,098,028	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,377,000	16,249,952	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,293,000	41,835,013	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,265,000	16,081,066	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,347,000	17,328,310	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,510,000	10,594,815	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,390,000	12,549,831	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,020,000	30,647,117	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,090,000	21,404,287	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,342,000	44,433,968	

第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,669,000	68,250,621	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,232,000	24,925,845	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,092,000	26,907,908	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,728,000	13,096,475	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,947,000	30,109,538	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,427,000	29,543,267	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,141,000	14,597,047	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,070,000	57,767,306	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,921,000	15,516,646	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,419,000	31,363,007	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,347,000	31,145,971	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,432,000	13,914,477	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,672,000	15,371,414	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,792,000	29,221,620	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,941,000	41,389,999	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,082,000	34,216,094	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,316,000	64,251,015	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,944,000	31,811,008	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,207,000	13,755,090	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,542,000	70,558,475	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,726,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,864,000	14,503,269	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,166,000	92,248,649	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,540,000	43,995,014	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,108,000	46,683,466	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,006,000	90,028,154	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,104,000	140,488,609	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,859,000	45,074,381	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,633,000	50,840,451	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,608,000	104,052,147	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,724,000	91,169,472	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,888,000	51,626,216	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,025,000	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,853,000	74,515,872	
第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,087,000	90,277,202	
第1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,906,000	89,845,736	

	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,317,000	90,258,401	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,366,000	91,180,197	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,091,000	91,032,450	
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,978,000	92,173,450	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,046,000	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,080,000	95,357,606	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,118,000	26,966,835	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,946,000	30,317,172	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,228,000	14,876,796	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,767,000	14,304,601	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,662,000	31,099,420	
	い第810号農林債	300,000,000	299,919,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	101,925,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,148,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,129,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,468,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,284,000	
特殊債券合計		12,246,993,000	13,059,052,368	
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	199,866,000	
	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	200,002,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,300,000	
	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	101,312,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,541,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,395,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,560,000	
	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	99,733,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,460,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,466,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,700,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,990,000	
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,378,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,966,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,783,000		

第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,429,000	
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	115,149,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	301,674,000	
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	99,774,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,374,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,871,000	
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	100,196,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,458,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,492,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,592,000	
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	99,710,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,655,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	127,047,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,552,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	100,932,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,508,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,454,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,077,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,078,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,463,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,531,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,958,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,821,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,832,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,105,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,309,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,597,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	199,822,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,422,000	

第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,456,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,310,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,102,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	207,010,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,683,000	
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	102,242,000	
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	99,609,000	
社債券合計	6,100,000,000	6,272,811,000	
合計		131,192,755,153	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,218,088,180	1,613,138,714
金銭信託	627,644,157	196,407,416
コール・ローン	53,285,541	136,532,670
株式	179,938,443,589	187,233,126,027
投資証券	4,532,168,945	5,087,009,262
派生商品評価勘定	119,560,762	145,973,096
未収入金	11,304,820	1,819,725
未収配当金	306,701,659	245,293,678
差入委託証拠金	1,714,108,747	1,816,503,539
流動資産合計	189,521,306,400	196,475,804,127
資産合計	189,521,306,400	196,475,804,127
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,800	236,418
前受金	119,522,362	136,840,750
未払解約金	601,276,393	2,100,611,158
未払利息	155	370
その他未払費用	16,112	99,189
流動負債合計	720,834,822	2,237,787,885
負債合計	720,834,822	2,237,787,885
純資産の部		
元本等		

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
元本	51,227,388,044	58,474,870,859
剰余金		
剰余金又は欠損金()	137,573,083,534	135,763,145,383
元本等合計	188,800,471,578	194,238,016,242
純資産合計	188,800,471,578	194,238,016,242
負債純資産合計	189,521,306,400	196,475,804,127

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
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	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
----	-----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	51,227,388,044口	58,474,870,859口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6855円 (10,000口当たりの純資産額 36,855円)	1口当たり純資産額 3.3217円 (10,000口当たりの純資産額 33,217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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 4月13日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 4月15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	3,700,621,603	-	3,820,143,965	119,522,362
	SPMINI 1906	2,636,887,895	-	2,724,013,193	87,125,298
	DJ EUR 1906	634,893,936	-	658,003,500	23,109,564
	FTSE 1906	231,078,939	-	237,826,952	6,748,013
	SPI200 1906	197,760,833	-	200,300,320	2,539,487
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	523,396,800	-	523,378,200	18,600
	米ドル	355,040,000	-	355,008,300	31,700
	カナダドル	19,317,700	-	19,320,000	2,300
	ユーロ	62,029,100	-	62,034,000	4,900
	英ポンド	33,724,900	-	33,734,100	9,200
	スイスフラン	16,753,500	-	16,756,500	3,000
	スウェーデンクローナ	5,319,600	-	5,319,600	-
	ノルウェークローネ	1,450,900	-	1,449,800	1,100
	デンマーククローネ	13,568,000	-	13,568,000	-
	オーストラリアドル	4,014,500	-	4,014,500	-
	ニュージーランドドル	757,900	-	758,000	100
	香港ドル	7,996,800	-	7,991,200	5,600
	シンガポールドル	2,482,500	-	2,482,800	300
	イスラエルシェケル	941,400	-	941,400	-
合計		4,224,018,403	-	4,343,522,165	119,540,962

(2020年4月13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	1,756,190,656	-	1,893,031,406	136,840,750
	SPMINI 2006	1,274,191,790	-	1,383,945,668	109,753,878
	DJ EUR 2006	287,308,580	-	303,894,765	16,586,185
	FTSE 2006	90,052,466	-	94,128,144	4,075,678
	SPI200 2006	104,637,820	-	111,062,829	6,425,009
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	90,036,600	-	90,016,300	20,300
	米ドル	70,356,000	-	70,343,000	13,000
	ユーロ	9,464,000	-	9,460,800	3,200
	英ポンド	8,089,800	-	8,087,400	2,400
	スウェーデンク ローナ	870,400	-	869,600	800
	香港ドル	1,256,400	-	1,255,500	900
	売建	1,914,997,788	-	1,906,081,560	8,916,228
	米ドル	1,445,100,800	-	1,437,161,600	7,939,200
	カナダドル	55,925,870	-	55,828,800	97,070
	ユーロ	151,146,450	-	150,781,500	364,950
	英ポンド	73,605,672	-	73,325,760	279,912
	スイスフラン	76,343,680	-	76,173,600	170,080
	スウェーデンク ローナ	17,072,235	-	17,065,900	6,335
	ノルウェークロー ネ	4,041,424	-	4,009,000	32,424
	デンマーククロー ネ	16,677,080	-	16,632,000	45,080
	オーストラリアド ル	38,902,562	-	39,079,200	176,638
	ニュージーランド ドル	1,969,200	-	1,972,200	3,000
	香港ドル	23,156,415	-	23,017,500	138,915
	シンガポールドル	6,508,200	-	6,494,000	14,200
	イスラエルシケ ル	4,548,200	-	4,540,500	7,700
	合計	3,761,225,044	-	3,889,129,266	145,736,678

(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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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)

(2019年 4月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	53,755,349,667円
同期中における追加設定元本額	12,591,793,268円
同期中における一部解約元本額	15,119,754,891円
2019年 4月15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	14,540,997,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	290,922,381円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,187,034,969円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	798,762,179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)	76,136,735円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,801,776円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,441,977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)	23,584,478円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	44,103,145円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	29,913,899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)	75,117,986円
外国株式指数ファンド	518,436,819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	3,285,262,338円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	551,156,354円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	537,982,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	536,487,290円
イオン・バランス戦略ファンド	31,169,212円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,505,740円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	13,944,330円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,621,644円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	55,172,963円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,650,373円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	55,569,185円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,770,492円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,790,978,249円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	8,634,376円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	76,749,837円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,600,205,202円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,531,892,342円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	6,544,631,497円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	20,379,742円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	105,911,372円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	423,742円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	774,601,539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〉	61,481,215円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	178,362,779円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	781,134,189円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	680,375,816円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,636,518,942円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,145,754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)	449,735,413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)	650,268,242円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	140,890,084円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	32,773,189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)	829,365,075円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	25,082,064円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	13,148,689円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	6,839,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	49,575,372円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	119,485,764円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	115,889,361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〉	1,149,798,643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〉	158,117,325円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	6,232,458,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	293,843,839円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA〈適格機関投資家限定〉	2,012,443,704円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	7,865,987円

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>	101,802,107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>	48,744,796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>	120,134,876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>	147,153,141円
合計	51,227,388,044円

(2020年 4月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,227,388,044円
同期中における追加設定元本額	27,385,256,620円
同期中における一部解約元本額	20,137,773,805円
2020年 4月13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	25,231,318,479円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	378,421,998円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,463,649,022円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	930,435,402円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	91,109,362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)	2,603,248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)	9,144,941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)	28,111,210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)	58,883,705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)	44,465,029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)	98,964,448円
外国株式指数ファンド	547,230,104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	5,541,347,659円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	258,142,746円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	257,721,554円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,944,854円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	9,114,050円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,371,954円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,821,410円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	154,555,549円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,647,971円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	91,931,978円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,370,050円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	2,667,451円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	54,190円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	329,790円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	229,988円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,790,260円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,336,856,076円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,390,349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 >	71,673,896円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,603,381,875円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,550,405,958円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,427,072,311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 >	19,789,865円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	105,025,426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 >	347,233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 >	743,175,435円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	64,157,112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 >	186,221,797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 >	790,847,473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 >	666,936,328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 >	1,587,087,513円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	897,600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)	285,453,719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 >	135,588,581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 >	17,994,714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 >	13,073,387円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	7,055,036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 >	43,227,998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 >	112,493,525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 >	688,091,914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 >	137,128,409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 >	5,755,492,578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 >	256,998,128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 >	95,964,227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 >	6,000,355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 >	7,004,719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 >	7,446,085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 >	135,212,835円
合計	58,474,870,859円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APACHE CORPORATION	19,062	8.20	156,308.40	
	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	12.86	411,185.64	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	18.88	370,652.16	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	38.58	453,199.26	
	CHEVRON CORPORATION	98,648	84.31	8,317,012.88	

CONCHO RESOURCES INC	10,172	52.74	536,471.28
CONOCOPHILLIPS	55,797	34.73	1,937,829.81
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	12.19	55,281.65
DEVON ENERGY CORPORATION	21,054	9.67	203,592.18
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	34.86	276,544.38
EOG RESOURCES INC	30,830	44.82	1,381,800.60
EXXON MOBIL CORPORATION	221,187	43.13	9,539,795.31
HALLIBURTON CO	44,317	8.21	363,842.57
HESS CORPORATION	15,362	40.38	620,317.56
HOLLYFRONTIER CORP	6,263	26.42	165,468.46
KINDER MORGAN INC	104,140	15.36	1,599,590.40
MARATHON OIL CORP	31,450	4.12	129,574.00
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	35,915	25.63	920,501.45
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	15,585	11.60	180,786.00
NOBLE ENERGY INC	26,757	7.51	200,945.07
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	50,338	15.36	773,191.68
ONEOK INC	19,764	28.40	561,297.60
PHILLIPS 66	23,496	61.52	1,445,473.92
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,858	75.48	668,601.84
SCHLUMBERGER LTD	73,444	16.47	1,209,622.68
TARGA RESOURCES CORP	11,788	8.61	101,494.68
TECHNIPFMC PLC	21,584	8.40	181,305.60
VALERO ENERGY CORP	22,007	50.10	1,102,550.70
WILLIAMS COS INC	61,445	16.59	1,019,372.55
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,440	219.32	2,509,020.80
ALBEMARLE CORPORATION	4,714	67.02	315,932.28
AMCOR PLC	82,302	9.16	753,886.32
AVERY DENNISON CORP	4,832	115.03	555,824.96
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	18.63	234,551.70
BALL CORPORATION	16,953	69.94	1,185,692.82
CELANESE CORPORATION	6,420	83.91	538,702.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	31.01	372,182.02
CORTEVA INC	38,111	27.93	1,064,440.23
CROWN HOLDINGS INC	6,863	62.20	426,878.60
DOW INC	40,227	36.56	1,470,699.12
DUPONT DE NEMOURS INC	38,956	40.78	1,588,625.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	59.71	419,582.17
ECOLAB INC	13,499	179.86	2,427,930.14
FMC CORPORATION	6,676	90.00	600,840.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	69,858	8.19	572,137.02
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	34.17	654,013.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	127.37	620,419.27

LINDE PLC	28,206	189.48	5,344,472.88
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,793	58.93	871,751.49
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	208.19	643,723.48
MOSAIC CO/THE	18,584	12.97	241,034.48
NEWMONT CORPORATION	42,763	57.31	2,450,747.53
NUCOR CORP	15,455	39.43	609,390.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	90.46	423,533.72
PPG INDUSTRIES INC	12,848	97.17	1,248,440.16
RPM INTERNATIONAL INC	6,118	65.81	402,625.58
SEALED AIR CORP	7,895	30.80	243,166.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,330	492.15	2,131,009.50
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	23.96	244,176.36
VULCAN MATERIALS CO	6,698	113.10	757,543.80
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	45.61	67,274.75
WESTROCK CO	13,034	32.16	419,173.44
3M COMPANY	29,528	147.78	4,363,647.84
ACUITY BRANDS INC	1,884	92.14	173,591.76
AERCAP HOLDINGS NV	7,156	25.76	184,338.56
ALLEGION PLC	4,764	95.36	454,295.04
AMETEK INC	11,307	78.23	884,546.61
BOEING CO	27,646	151.84	4,197,768.64
CARRIER GLOBAL CORP	42,223	14.78	624,055.94
CATERPILLAR INC	28,560	125.03	3,570,856.80
CUMMINS INC	7,936	150.70	1,195,955.20
DEERE & CO	15,907	145.75	2,318,445.25
DOVER CORP	7,186	89.41	642,500.26
EATON CORP PLC	22,126	81.44	1,801,941.44
EMERSON ELECTRIC CO	32,687	51.78	1,692,532.86
FASTENAL COMPANY	29,021	33.62	975,686.02
FLOWERVE CORPORATION	6,650	27.19	180,813.50
FORTIVE CORP	14,950	61.04	912,548.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	50.83	327,853.50
GENERAL DYNAMICS CORP	13,157	141.01	1,855,268.57
GENERAL ELECTRIC CO	450,795	7.14	3,218,676.30
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	32.07	249,729.09
HEICO CORP	1,888	82.00	154,816.00
HEICO CORP-CLASS A	4,435	72.76	322,690.60
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,500	143.43	5,378,625.00
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	13.25	252,068.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	192.39	405,365.73
IDEX CORP	3,839	151.52	581,685.28
ILLINOIS TOOL WORKS	16,690	159.28	2,658,383.20

INGERSOLL-RAND INC	16,918	26.50	448,327.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	81.31	563,234.37
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	49.51	569,365.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,600	23.49	248,994.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,974	30.60	1,253,804.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,752	190.79	2,242,164.08
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,056	204.29	420,020.24
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,059	371.00	4,844,889.00
MASCO CORP	14,885	40.37	600,907.45
MIDDLEBY CORP	2,823	58.08	163,959.84
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	336.65	2,792,511.75
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	49.14	1,037,394.54
OWENS CORNING	5,205	44.10	229,540.50
PACCAR INC	18,806	67.27	1,265,079.62
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,505	145.17	944,330.85
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	32.84	269,944.80
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	76,105	64.71	4,924,754.55
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	167.64	1,042,553.16
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,445	315.45	1,717,625.25
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	34.28	260,528.00
SMITH(A.O.) CORP	7,157	40.21	287,782.97
SNAP-ON INC	2,407	122.12	293,942.84
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	22.58	115,993.46
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,684	119.37	917,239.08
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	327.92	675,515.20
TEXTRON INC	11,803	29.44	347,480.32
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	91.60	1,168,724.40
TRANSDIGM GROUP INC	2,427	344.54	836,198.58
UNITED RENTALS INC	3,596	107.71	387,325.16
WABCO HOLDINGS INC	2,598	134.71	349,976.58
WABTEC CORP	9,231	55.26	510,105.06
WW GRAINGER INC	2,390	279.87	668,889.30
XYLEM INC	9,124	69.34	632,658.16
CINTAS CORP	4,833	198.74	960,510.42
COPART INC	10,456	74.99	784,095.44
COSTAR GROUP INC	1,853	631.28	1,169,761.84
EQUIFAX INC	6,127	124.22	761,095.94
IHS MARKIT LTD	20,640	65.47	1,351,300.80
MANPOWERGROUP	3,264	61.80	201,715.20
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	14.14	254,887.64
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	81.82	933,975.30
ROBERT HALF INTL INC	5,555	43.28	240,420.40

ROLLINS INC	6,451	36.02	232,365.02
TRANSUNION	9,497	71.49	678,940.53
VERISK ANALYTICS INC	8,444	148.26	1,251,907.44
WASTE CONNECTIONS INC	14,344	87.46	1,254,526.24
WASTE MANAGEMENT INC	22,016	99.85	2,198,297.60
AMERCO	390	277.84	108,357.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	12.51	71,006.76
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	73.22	507,048.50
CSX CORPORATION	38,440	64.00	2,460,160.00
DELTA AIR LINES INC	8,299	24.39	202,412.61
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,148	71.48	582,419.04
FEDEX CORP	13,281	122.29	1,624,133.49
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	99.19	437,527.09
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	136.60	696,660.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	35.03	278,138.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,893	159.30	2,213,154.90
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	135.15	665,748.90
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	36.47	230,344.52
UBER TECHNOLOGIES INC	23,948	27.11	649,230.28
UNION PACIFIC CORP	36,430	148.73	5,418,233.90
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	31.50	90,720.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,101	98.69	3,562,807.69
XPO LOGISTICS INC	4,716	61.90	291,920.40
APTIV PLC	13,074	62.23	813,595.02
AUTOLIV INC	4,001	57.66	230,697.66
BORGWARNER INC	12,075	25.74	310,810.50
FORD MOTOR COMPANY	208,063	5.37	1,117,298.31
GENERAL MOTORS CO	67,788	24.06	1,630,979.28
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	21.13	155,242.11
LEAR CORP	2,749	91.15	250,571.35
TESLA INC	7,121	573.00	4,080,333.00
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	13.38	83,344.02
D.R.HORTON INC	17,316	41.04	710,648.64
GARMIN LTD	6,739	78.65	530,022.35
HANESBRANDS INC	22,204	9.57	212,492.28
HASBRO INC	7,491	75.67	566,843.97
LEGGETT & PLATT INC	6,656	29.88	198,881.28
LENNAR CORP-CL A	13,372	44.80	599,065.60
LULULEMON ATHLETICA INC	6,005	203.51	1,222,077.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	88.01	251,972.63
NEWELL BRANDS INC	18,477	14.15	261,449.55
NIKE INC -CL B	65,353	86.79	5,671,986.87

NVR INC	173	2,928.01	506,545.73
POLARIS INC	2,467	56.00	138,152.00
PULTE GROUP INC	13,065	26.34	344,132.10
PVH CORP	3,303	49.51	163,531.53
RALPH LAUREN CORPORATION	1,971	80.41	158,488.11
TAPESTRY INC	14,712	15.70	230,978.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	10.43	90,052.62
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	9.35	77,520.85
VF CORP	17,117	59.21	1,013,497.57
WHIRLPOOL CORP	3,212	104.75	336,457.00
ARAMARK	13,242	23.29	308,406.18
CARNIVAL CORP	21,372	12.42	265,440.24
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,306	771.00	1,006,926.00
DARDEN RESTAURANTS INC	5,866	64.34	377,418.44
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	343.64	728,860.44
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	68.45	1,000,533.65
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	47.86	843,963.24
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	81.31	1,196,476.65
MCDONALD'S CORPORATION	39,439	183.70	7,244,944.30
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	14,027	13.60	190,767.20
MGM MIRAGE	25,878	14.55	376,524.90
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,922	13.11	143,187.42
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	40.22	363,427.92
STARBUCKS CORP	60,807	73.88	4,492,421.16
VAIL RESORTS INC	2,038	164.69	335,638.22
WYNN RESORTS LTD	4,913	70.65	347,103.45
YUM! BRANDS INC	16,382	80.37	1,316,621.34
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,230	60.46	2,371,845.80
ALPHABET INC-CL A	15,597	1,206.57	18,818,872.29
ALPHABET INC-CL C	16,069	1,211.45	19,466,790.05
ALTICE USA INC-A	6,300	24.60	154,980.00
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,924	466.64	3,697,655.36
COMCAST CORP-CLASS A	237,304	38.00	9,017,552.00
DISCOVERY INC-A	7,075	22.32	157,914.00
DISCOVERY INC-C	18,283	20.14	368,219.62
DISH NETWORK CORP.	12,937	23.07	298,456.59
ELECTRONIC ARTS INC	15,680	105.80	1,658,944.00
FACEBOOK INC-A	125,374	175.19	21,964,271.06
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	25.99	440,842.38
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	25.64	224,939.72
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	195.01	774,969.74
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	16.28	319,511.28

LIBERTY BROADBAND-C	5,418	115.48	625,670.64
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	18.59	156,750.88
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	17.39	366,563.81
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	24.92	256,376.96
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	32.34	247,336.32
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	32.05	132,719.05
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	38.27	287,484.24
MATCH GROUP INC	2,681	68.11	182,602.91
NETFLIX INC	22,915	370.72	8,495,048.80
NEWS CORP-CLASS A	16,662	9.49	158,122.38
OMNICOM GROUP	10,417	56.80	591,685.60
PINTEREST INC- CLASS A	14,828	16.75	248,369.00
ROKU INC	4,624	92.45	427,488.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	81,768	5.25	429,282.00
SNAP INC-A	35,102	13.61	477,738.22
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	119.40	681,415.80
THE WALT DISNEY CO.	94,149	104.50	9,838,570.50
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	18.34	74,295.34
TWITTER INC	37,026	27.77	1,028,212.02
VIACOMCBS INC	32,846	16.56	543,929.76
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	40.63	321,220.78
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	106.86	366,102.36
AMAZON.COM INC	21,928	2,042.76	44,793,641.28
AUTOZONE INC	1,271	940.83	1,195,794.93
BEST BUY COMPANY INC	13,126	65.99	866,184.74
BOOKING HOLDINGS INC	2,165	1,420.64	3,075,685.60
BURLINGTON STORES INC	3,739	176.89	661,391.71
CARMAX INC	8,427	66.50	560,395.50
DOLLAR GENERAL CORP	13,035	169.24	2,206,043.40
DOLLAR TREE INC	12,047	77.56	934,365.32
EBAY INC	41,830	33.83	1,415,108.90
EXPEDIA GROUP INC	6,894	62.42	430,323.48
GAP INC/THE	9,218	9.09	83,791.62
GENUINE PARTS CO	7,406	71.67	530,788.02
GRUBHUB INC	4,403	45.09	198,531.27
HOME DEPOT INC	56,903	201.53	11,467,661.59
KOHL'S CORP	8,274	19.91	164,735.34
LKQ CORPORATION	15,922	22.53	358,722.66
LOWE'S COMPANIES INC	39,710	95.31	3,784,760.10
MERCADOLIBRE INC	2,251	533.28	1,200,413.28
NORDSTROM INC	4,756	21.32	101,397.92
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,012	342.44	1,373,869.28

ROSS STORES INC	19,386	88.74	1,720,313.64
TARGET CORP	26,858	104.20	2,798,603.60
TIFFANY & CO	5,541	127.95	708,970.95
TJX COMPANIES INC	62,641	48.81	3,057,507.21
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	88.23	539,702.91
ULTA BEAUTY INC	2,765	202.48	559,857.20
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	76.85	221,865.95
COSTCO WHOLESALE CORP	23,132	300.01	6,939,831.32
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	4.93	66,555.00
KROGER CO	39,652	31.06	1,231,591.12
SYSCO CORP	26,129	49.59	1,295,737.11
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,527	43.98	1,782,377.46
WALMART INC	74,367	121.80	9,057,900.60
ALTRIA GROUP INC	95,985	40.91	3,926,746.35
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	37.58	1,067,422.32
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	62.89	982,341.80
BUNGE LIMITED	7,174	40.83	292,914.42
CAMPBELL SOUP CO	7,879	47.75	376,222.25
COCA-COLA CO/THE	212,668	49.00	10,420,732.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	12,989	43.64	566,839.96
CONAGRA BRANDS INC	24,639	32.46	799,781.94
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	166.24	1,476,377.44
GENERAL MILLS INC	32,415	57.40	1,860,621.00
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	47.54	710,200.06
INGREDION INC	3,320	82.10	272,572.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	112.75	650,342.00
KELLOGG CO	12,949	62.74	812,420.26
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	28.11	955,992.99
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	58.40	433,152.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,209	154.30	958,048.70
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	47.40	456,414.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	75,855	52.34	3,970,250.70
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,947	60.51	1,206,992.97
PEPSICO INC	72,888	133.63	9,740,023.44
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	81,565	75.34	6,145,107.10
THE HERSHEY COMPANY	7,514	143.91	1,081,339.74
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	60.94	910,992.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	68.39	853,849.15
CLOROX COMPANY	6,208	184.21	1,143,575.68
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	43,101	69.91	3,013,190.91
COTY INC-CL A	16,985	6.02	102,249.70
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,317	164.83	1,865,381.11

KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	131.49	2,340,522.00
PROCTER & GAMBLE CO	129,916	114.66	14,896,168.56
ABBOTT LABORATORIES	92,570	86.04	7,964,722.80
ABIOMED INC	2,288	160.08	366,263.04
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	193.19	744,554.26
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	87.81	701,865.33
ANTHEM INC	13,391	242.46	3,246,781.86
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,833	86.89	2,244,629.37
BECTON DICKINSON & CO	14,285	247.45	3,534,823.25
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,035	36.83	2,726,709.05
CARDINAL HEALTH INC	15,114	50.43	762,199.02
CENTENE CORP	29,691	66.42	1,972,076.22
CERNER CORP	15,537	68.38	1,062,420.06
CIGNA CORPORATION	19,703	181.83	3,582,596.49
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,509	296.57	744,094.13
CVS HEALTH CORPORATION	66,864	60.47	4,043,266.08
DANAHER CORP	32,178	145.73	4,689,299.94
DAVITA INC	5,115	74.82	382,704.30
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	41.87	496,745.68
DEXCOM INC	4,617	275.27	1,270,921.59
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,091	215.44	2,389,445.04
HCA HEALTHCARE INC	14,352	108.06	1,550,877.12
HENRY SCHEIN INC	7,559	52.25	394,957.75
HOLOGIC INC	13,592	41.11	558,767.12
HUMANA INC.	7,047	341.90	2,409,369.30
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	258.58	1,127,667.38
INSULET CORP	2,958	182.94	541,136.52
INTUITIVE SURGICAL INC	5,988	503.79	3,016,694.52
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	146.80	733,266.00
MCKESSON CORP	7,996	133.32	1,066,026.72
MEDTRONIC PLC	70,207	101.03	7,093,013.21
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	89.77	611,692.78
RESMED INC	7,271	159.82	1,162,051.22
STERIS PLC	4,287	152.69	654,582.03
STRYKER CORP	17,447	182.72	3,187,915.84
TELEFLEX INC	2,340	325.56	761,810.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,435	264.13	13,057,266.55
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	104.51	439,255.53
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,349	113.15	492,089.35
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,481	162.11	1,050,634.91
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,188	162.93	682,350.84
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,187	110.36	1,234,597.32

ABBVIE INC	77,535	79.75	6,183,416.25
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,308	78.33	1,199,075.64
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,946	96.23	1,053,333.58
ALLERGAN PLC	17,347	182.20	3,160,623.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	116.38	653,240.94
AMGEN INC	31,133	218.21	6,793,531.93
BEIGENE LTD-ADR	2,333	150.40	350,883.20
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,309	393.14	514,620.26
BIOGEN INC	9,176	321.05	2,945,954.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	79.55	722,314.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	122,790	58.91	7,233,558.90
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,964	24.50	440,118.00
ELI LILLY & CO	45,283	145.73	6,599,091.59
EXACT SCIENCES CORP	6,832	67.06	458,153.92
GILEAD SCIENCES INC	64,930	73.51	4,773,004.30
ILLUMINA INC	7,655	287.62	2,201,731.10
INCYTE CORP	9,243	86.81	802,384.83
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	53.00	358,280.00
IQVIA HOLDINGS INC	8,158	128.53	1,048,547.74
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	109.69	285,632.76
JOHNSON & JOHNSON	136,781	141.23	19,317,580.63
MERCK & CO. INC.	132,912	82.49	10,963,910.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	727.42	915,094.36
MYLAN NV	26,138	16.08	420,299.04
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	96.68	404,702.48
PERKINELMER INC	5,624	78.34	440,584.16
PERRIGO CO PLC	6,187	50.45	312,134.15
PFIZER INC	289,194	35.39	10,234,575.66
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,319	512.96	2,215,474.24
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	108.75	416,295.00
SEATTLE GENETICS INC	5,726	120.32	688,952.32
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	59,290	10.16	602,386.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,017	317.38	6,670,375.46
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,588	246.61	3,350,936.68
WATERS CORP	3,527	195.93	691,045.11
ZOETIS INC	24,652	128.75	3,173,945.00
BANK OF AMERICA CORP	446,319	24.86	11,095,490.34
CITIGROUP INC	114,553	47.41	5,430,957.73
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	22.11	459,865.89
COMERICA INC	7,691	34.75	267,262.25
EAST WEST BANCORP INC	9,201	31.11	286,243.11
FIFTH THIRD BANCORP	33,954	17.82	605,060.28

FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	99.50	885,251.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	9.02	478,884.55
JPMORGAN CHASE & CO	163,341	102.76	16,784,921.16
KEYCORP	51,128	12.01	614,047.28
M & T BANK CORP	5,998	114.75	688,270.50
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	12.30	248,460.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,260	105.42	2,452,069.20
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	45,237	11.01	498,059.37
SIGNATURE BANK	2,508	90.23	226,296.84
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	185.69	490,221.60
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	71,167	36.11	2,569,840.37
US BANCORP	76,789	38.05	2,921,821.45
WELLS FARGO & COMPANY	210,438	33.20	6,986,541.60
ZIONS BANCORPORATION	8,874	30.99	275,049.63
ALLY FINANCIAL INC	20,139	16.83	338,939.37
AMERICAN EXPRESS COMPANY	36,685	94.82	3,478,471.70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,062	120.47	730,289.14
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	37.14	1,567,567.98
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	68,576	193.84	13,292,771.84
BLACKROCK INC	6,128	471.42	2,888,861.76
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,684	49.17	1,705,412.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,649	60.11	1,481,651.39
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	93.42	528,850.62
CME GROUP INC.	18,911	190.16	3,596,115.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	39.21	644,024.25
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,809	41.76	451,383.84
EATON VANCE CORP	5,530	34.91	193,052.30
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	16.61	379,040.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	279.16	541,291.24
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	16.81	240,349.38
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,520	184.26	3,043,975.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,913	87.38	2,526,417.94
INVESCO LIMITED	18,328	9.86	180,714.08
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	14.17	182,580.45
KKR & CO INC -A	24,824	25.30	628,047.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	403.35	771,205.20
MOODY'S CORP	8,888	241.68	2,148,051.84
MORGAN STANLEY	64,495	41.08	2,649,454.60
MSCI INC-A	4,383	310.69	1,361,754.27
NASDAQ INC	6,498	107.92	701,264.16
NORTHERN TRUST CORP	11,127	84.89	944,571.03
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	69.44	446,221.44

S&P GLOBAL INC	12,907	283.55	3,659,779.85
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,841	36.54	2,186,590.14
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,574	50.93	283,883.82
STATE STREET CORP	19,913	60.95	1,213,697.35
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	17.62	490,276.50
T ROWE PRICE GROUP INC	12,364	105.16	1,300,198.24
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	37.96	532,502.88
VOYA FINANCIAL INC	7,308	45.65	333,610.20
AFLAC INC	38,953	38.08	1,483,330.24
ALLEGHANY CORPORATION	689	584.82	402,940.98
ALLSTATE CORP	17,397	100.34	1,745,614.98
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	80.49	284,854.11
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	47,036	26.54	1,248,335.44
AON PLC	11,871	192.05	2,279,825.55
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	31.00	634,756.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	86.84	815,774.96
ASSURANT INC	3,114	112.39	349,982.46
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	30.35	248,839.65
BROWN & BROWN INC	10,899	39.03	425,387.97
CHUBB LTD	23,475	122.27	2,870,288.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	83.58	656,771.64
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	166.09	213,923.92
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	212.30	438,399.50
FNF GROUP	13,937	28.86	402,221.82
GLOBE LIFE INC	6,040	80.40	485,616.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	41.88	767,702.28
LINCOLN NATIONAL CORP	8,356	34.29	286,527.24
LOEWS CORPORATION	13,914	39.42	548,489.88
MARKEL CORP	702	1,005.40	705,790.80
MARSH & MCLENNAN COS	26,208	96.61	2,531,954.88
METLIFE INC	41,534	35.46	1,472,795.64
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	32.60	460,442.40
PROGRESSIVE CORP	30,367	80.39	2,441,203.13
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	58.70	1,216,733.60
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	112.00	338,464.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	164.74	368,852.86
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	109.74	1,440,447.24
UNUM GROUP	9,769	15.58	152,201.02
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	58.32	433,200.96
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	196.02	1,337,444.46
CBRE GROUP INC-A	16,199	45.61	738,836.39
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,483	164.14	3,526,219.62

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.25	222,275.00
JONES LANG LASALLE INC	2,618	115.37	302,038.66
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	305.81	1,809,171.96
ACCENTURE PLC-CL A	33,298	177.92	5,924,380.16
ADOBE INC	25,314	318.70	8,067,571.80
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	95.39	793,740.19
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	38.58	85,724.76
ANSYS INC	4,256	237.92	1,012,587.52
AUTODESK INC	11,724	164.90	1,933,287.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,854	142.52	3,257,152.08
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	63.48	483,908.04
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	74.25	596,153.25
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	105.91	623,703.99
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	71.65	1,021,012.50
CDK GLOBAL INC	5,808	35.98	208,971.84
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,244	105.36	657,867.84
CITRIX SYSTEMS INC	6,676	139.40	930,634.40
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	29,465	54.28	1,599,360.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,984	89.09	176,754.56
DOCUSIGN INC	5,401	90.63	489,492.63
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	18.06	190,803.90
DXC TECHNOLOGY CO	11,825	16.09	190,264.25
EPAM SYSTEMS INC	3,128	192.29	601,483.12
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,347	125.12	4,047,256.64
FISERV INC	30,548	99.22	3,030,972.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	224.99	983,431.29
FORTINET INC	7,360	101.93	750,204.80
GARTNER INC	4,568	106.89	488,273.52
GLOBAL PAYMENTS INC	15,948	151.03	2,408,626.44
GODADDY INC - CLASS A	8,905	62.54	556,918.70
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	83.41	394,612.71
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,493	121.50	5,527,399.50
INTUIT INC	13,730	252.10	3,461,333.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	170.16	666,176.40
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	95.46	663,160.62
MASTERCARD INC-CL A	46,654	269.40	12,568,587.60
MICROSOFT CORP	376,974	165.14	62,253,486.36
MONGODB INC	2,035	140.34	285,591.90
NORTONLIFELOCK INC	31,347	19.37	607,191.39
OKTA INC	5,270	130.96	690,159.20
ORACLE CORPORATION	120,411	53.18	6,403,456.98
PALO ALTO NETWORKS INC	4,867	177.88	865,741.96

PAYCHEX INC	17,507	66.54	1,164,915.78
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	221.99	559,858.78
PAYPAL HOLDINGS INC	58,471	105.84	6,188,570.64
PTC INC	5,462	63.94	349,240.28
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,049	205.14	830,611.86
SABRE CORP	13,930	7.00	97,510.00
SALESFORCE.COM, INC.	43,624	154.55	6,742,089.20
SERVICENOW INC	9,802	278.06	2,725,544.12
SPLUNK INC	7,614	123.13	937,511.82
SQUARE INC-A	17,051	59.21	1,009,589.71
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	49.51	571,642.46
SYNOPSYS INC	7,601	136.58	1,038,144.58
TWILIO INC-A	5,649	95.34	538,575.66
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,865	311.99	581,861.35
VERISIGN INC	5,227	196.07	1,024,857.89
VISA INC	89,307	173.69	15,511,732.83
VMWARE INC	4,194	131.43	551,217.42
WESTERN UNION COMPANY	21,840	20.19	440,949.60
WIX.COM LTD	2,918	114.46	333,994.28
WORKDAY INC-CLASS A	8,688	145.41	1,263,322.08
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,698	81.91	1,285,823.18
APPLE INC	231,115	267.99	61,936,508.85
ARISTA NETWORKS INC	2,720	209.91	570,955.20
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	59.20	244,496.00
CDW CORP/DE	7,404	106.26	786,749.04
CISCO SYSTEMS INC	221,711	41.20	9,134,493.20
COGNEX CORP	8,698	46.19	401,760.62
CORNING INC	38,044	21.18	805,771.92
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,900	41.56	328,324.00
F5 NETWORKS INC	2,909	125.39	364,759.51
FLEX LTD	23,204	8.81	204,427.24
FLIR SYSTEMS INC	6,867	34.50	236,911.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	61,911	10.53	651,922.83
HP INC	78,476	15.97	1,253,261.72
IPG PHOTONICS CORP	1,776	119.05	211,432.80
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	21.67	378,358.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	92.10	878,818.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,241	152.89	1,412,856.49
NETAPP INC	10,919	42.73	466,568.87
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	51.25	647,492.50
TE CONNECTIVITY LTD	16,545	71.17	1,177,507.65
TRIMBLE INC	12,759	34.46	439,675.14

WESTERN DIGITAL CORP	14,857	45.05	669,307.85
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	19.36	187,733.92
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	201.22	550,739.14
AT&T INC	381,287	30.73	11,716,949.51
CENTURYLINK INC	49,758	10.65	529,922.70
T-MOBILE US INC	21,171	85.90	1,818,588.90
VERIZON COMMUNICATIONS INC	215,877	57.44	12,399,974.88
AES CORPORATION	33,656	14.72	495,416.32
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	53.14	643,047.14
AMEREN CORPORATION	12,454	79.00	983,866.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	86.31	2,220,497.37
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	131.75	1,206,039.50
ATMOS ENERGY CORP	5,710	105.20	600,692.00
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	17.81	453,513.84
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	62.33	875,113.20
CONSOLIDATED EDISON INC	17,938	87.94	1,577,467.72
DOMINION ENERGY INC	42,503	81.59	3,467,819.77
DTE ENERGY COMPANY	10,496	111.25	1,167,680.00
DUKE ENERGY CORP	37,900	90.31	3,422,749.00
EDISON INTERNATIONAL	17,941	60.27	1,081,304.07
ENTERGY CORP	10,866	102.91	1,118,220.06
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,092	44.61	450,204.12
EVERGY INC	11,273	63.10	711,326.30
EVERSOURCE ENERGY	17,463	90.10	1,573,416.30
EXELON CORP	50,837	39.15	1,990,268.55
FIRSTENERGY CORP	26,948	44.75	1,205,923.00
NEXTERA ENERGY INC	25,402	245.28	6,230,602.56
NISOURCE INC	18,919	26.58	502,867.02
NRG ENERGY INC	13,547	30.76	416,705.72
OGE ENERGY CORP	11,870	32.52	386,012.40
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	82.23	493,051.08
PPL CORPORATION	36,597	26.70	977,139.90
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,423	52.95	1,452,047.85
SEMPRA ENERGY	14,772	130.53	1,928,189.16
SOUTHERN CO	54,269	60.33	3,274,048.77
UGI CORPORATION	10,588	30.04	318,063.52
VISTRA ENERGY CORP	18,354	17.79	326,517.66
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	98.22	1,614,540.36
XCEL ENERGY INC	28,120	66.27	1,863,512.40
ADVANCED MICRO DEVICES	54,897	48.38	2,655,916.86
ANALOG DEVICES INC	19,683	98.79	1,944,483.57
APPLIED MATERIALS INC	49,028	49.59	2,431,298.52

	BROADCOM INC	20,398	254.30	5,187,211.40
	INTEL CORP	226,977	57.14	12,969,465.78
	KLA CORPORATION	7,805	150.12	1,171,686.60
	LAM RESEARCH CORP	7,733	258.28	1,997,279.24
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,750	24.28	770,890.00
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	51.79	715,427.06
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,065	78.45	946,499.25
	MICRON TECHNOLOGY INC	57,501	46.13	2,652,521.13
	NVIDIA CORP	30,405	262.95	7,994,994.75
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	89.97	1,300,696.29
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	13.73	287,121.76
	QORVO INC	6,042	83.11	502,150.62
	QUALCOMM INC	58,780	71.58	4,207,472.40
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	89.95	787,692.15
	TERADYNE INC	8,542	61.15	522,343.30
	TEXAS INSTRUMENTS INC	49,047	107.69	5,281,871.43
	XILINX INC	12,876	83.11	1,070,124.36
	米ドル 小計	15,540,519		1,231,528,931.60 (133,288,376,267)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	13.00	212,992.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	66,360	18.78	1,246,240.80
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	3.86	208,509.48
	ENBRIDGE INC	104,629	40.13	4,198,761.77
	HUSKY ENERGY INC	14,553	4.78	69,563.34
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	18.07	234,891.93
	INTER PIPELINE LTD	19,394	10.01	194,133.94
	KEYERA CORP	11,374	15.70	178,571.80
	OVINTIV INC	13,275	6.17	81,906.75
	PARKLAND FUEL CORP	7,666	29.77	228,216.82
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	28.56	782,858.16
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	8.99	81,251.62
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	22.75	1,789,105.50
	TC ENERGY CORP	49,694	66.28	3,293,718.32
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	68.51	815,611.55
	BARRICK GOLD CORP	94,983	31.48	2,990,064.84
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	42.71	280,305.73
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	7.32	231,839.04
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,493	159.15	1,510,810.95
	KINROSS GOLD CORP	63,501	7.86	499,117.86
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,581	50.11	780,763.91
	LUNDIN MINING CORP	28,209	6.18	174,331.62
	METHANEX CORPORATION	2,452	20.89	51,222.28

NUTRIEN LTD	29,898	51.46	1,538,551.08
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	11.07	274,690.98
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	32.06	92,108.38
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,560	44.71	1,098,077.60
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	0.47	36,029.70
CAE INC	12,891	19.00	244,929.00
WSP GLOBAL INC	6,141	84.25	517,379.25
THOMSON REUTERS CORP	11,217	99.32	1,114,072.44
AIR CANADA	5,737	20.08	115,198.96
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,013	111.19	4,115,475.47
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	315.76	2,246,632.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	51.31	737,016.84
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	22.76	206,342.16
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,069	61.51	865,384.19
STARS GROUP INC/THE	13,795	30.32	418,264.40
QUEBECOR INC -CL B	9,953	29.87	297,296.11
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	22.82	621,434.24
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,570	92.96	331,867.20
DOLLARAMA INC	14,542	41.00	596,222.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	47,257	35.42	1,673,842.94
EMPIRE CO LTD A	7,235	29.47	213,215.45
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	71.97	614,551.83
METRO INC	13,109	59.16	775,528.44
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	103.72	444,025.32
SAPUTO INC	13,425	33.94	455,644.50
AURORA CANNABIS INC	47,116	1.22	57,481.52
BAUSCH HEALTH COS INC	15,027	25.25	379,431.75
CANOPY GROWTH CORP	11,251	20.43	229,857.93
CRONOS GROUP INC	8,026	8.09	64,930.34
BANK OF MONTREAL	33,057	75.10	2,482,580.70
BANK OF NOVA SCOTIA	63,154	57.40	3,625,039.60
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	86.17	2,026,115.21
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	56.94	967,581.42
ROYAL BANK OF CANADA	75,357	88.25	6,650,255.25
TORONTO-DOMINION BANK	95,335	60.23	5,742,027.05
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	71,119	49.12	3,493,365.28
CI FINANCIAL CORP	11,041	13.69	151,151.29
IGM FINANCIAL INC	6,433	25.75	165,649.75
ONEX CORPORATION	4,217	56.57	238,555.69
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	401.66	559,512.38
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	23.60	335,120.00
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	45.91	222,709.41

	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	140.55	992,001.90
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	17.88	1,784,602.80
	POWER CORP OF CANADA	26,356	22.34	588,793.04
	SUN LIFE FINANCIAL INC	29,068	48.65	1,414,158.20
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	5.25	136,463.25
	CGI INC-CL A	13,436	84.13	1,130,370.68
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,290.78	1,324,340.28
	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	51.51	703,884.15
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,335	584.72	3,119,481.20
	BCE INC	8,379	57.41	481,038.39
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,988	60.13	1,201,878.44
	TELUS CORPORATION	15,222	22.27	338,993.94
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	30,305	19.60	593,978.00
	ALTAGAS LTD	17,347	14.90	258,470.30
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	39.77	120,503.10
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	35.52	260,858.88
	EMERA INC	13,874	56.20	779,718.80
	FORTIS INC	21,905	55.41	1,213,756.05
	HYDRO ONE LTD	15,052	26.53	399,329.56
	カナダドル 小計	2,064,620		84,012,556.42 (6,515,173,750)
ユーロ	ENI SPA	133,196	9.30	1,239,788.36
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	10.27	248,071.85
	NESTE OYJ	20,558	29.12	598,648.96
	OMV AG	7,781	30.70	238,876.70
	REPSOL SA	79,723	8.28	660,584.77
	TENARIS S.A.	25,963	6.00	155,933.77
	TOTAL SA	126,168	33.62	4,242,399.00
	VOPAK	3,130	46.25	144,762.50
	AIR LIQUIDE SA	24,422	118.45	2,892,785.90
	AKZO NOBEL	11,296	65.12	735,595.52
	ARCELORMITTAL	35,989	9.57	344,702.64
	ARKEMA	3,250	76.30	247,975.00
	BASF SE	48,831	46.89	2,289,929.74
	COVESTRO AG	8,053	29.92	240,945.76
	CRH PLC	40,916	27.37	1,119,870.92
	EVONIK INDUSTRIES AG	12,950	22.27	288,396.50
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	36.98	124,622.60
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,958	43.90	305,456.20
	KONINKLIJKE DSM NV	9,430	107.55	1,014,196.50
	LANXESS	4,409	41.85	184,516.65
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	26.60	304,330.60

SOLVAY SA	3,758	72.64	272,981.12
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	10.24	309,747.33
SYMRISE AG	6,524	88.14	575,025.36
THYSSENKRUPP AG	19,367	5.80	112,328.60
UMICORE	9,349	35.93	335,909.57
UPM-KYMMENE OYJ	27,288	24.61	671,557.68
VOESTALPINE AG	6,338	19.69	124,826.91
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,792	20.00	295,840.00
AIRBUS SE	30,303	61.00	1,848,483.00
ALSTOM RGPT	9,668	38.98	376,858.64
ANDRITZ AG	4,328	31.54	136,505.12
BOUYGUES SA	11,049	30.26	334,342.74
BRENTAG AG	7,392	37.64	278,234.88
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	6.09	333,798.85
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	25.98	664,646.34
DASSAULT AVIATION SA	172	825.50	141,986.00
EIFFAGE SA	3,488	73.66	256,926.08
FERROVIAL SA	23,480	23.10	542,388.00
GEA GROUP AG	8,178	21.50	175,827.00
HOCHTIEF AG	825	70.40	58,080.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	46.20	352,598.40
KION GROUP AG	3,179	44.37	141,052.23
KNORR-BREMSE AG	3,061	80.79	247,298.19
KONE OYJ-B	18,168	51.98	944,372.64
LEGRAND SA	13,198	59.16	780,793.68
LEONARDO SPA	18,310	7.15	130,916.50
METSO OYJ	5,880	23.18	136,298.40
MTU AERO ENGINES AG	2,496	132.40	330,470.40
PRYSMIAN SPA	11,926	15.65	186,641.90
SAFRAN SA	17,246	79.60	1,372,781.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,687	80.26	2,302,418.62
SIEMENS AG-REG	39,518	81.34	3,214,394.12
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	13.64	156,614.48
THALES SA	5,403	74.46	402,307.38
VINCI S.A.	27,362	76.50	2,093,193.00
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	7.00	132,358.80
BUREAU VERITAS SA	17,817	18.67	332,643.39
RANDSTAD NV	5,121	34.26	175,445.46
TELEPERFORMANCE	2,970	203.70	604,989.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	65.64	956,899.92
AENA SME SA	3,556	121.50	432,054.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	92.50	124,505.00

ATLANTIA SPA	26,501	12.94	343,055.44
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	8.88	147,177.12
DEUTSCHE POST AG-REG	50,830	25.67	1,304,806.10
FRAPORT AG	1,856	40.30	74,796.80
GETLINK	22,311	11.16	248,990.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,789	50.82	853,216.98
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	42.10	105,586.80
CONTINENTAL AG	5,578	73.04	407,417.12
DAIMLER AG	48,163	29.84	1,437,183.92
FAURECIA	3,127	30.85	96,467.95
FERRARI NV	6,593	140.60	926,975.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	52,499	7.47	392,640.02
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	87.04	761,251.84
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	19.78	108,955.99
PIRELLI & C SPA	17,484	3.37	59,060.95
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,765	44.25	343,601.25
PSA PEUGEOT CITROEN	28,139	13.41	377,484.68
RENAULT SA	8,830	18.53	163,690.54
VALEO SA	14,048	16.96	238,254.08
VOLKSWAGEN AG	1,984	133.00	263,872.00
VOLKSWAGEN AG PFD	9,869	122.54	1,209,347.26
ADIDAS AG	9,591	224.30	2,151,261.30
ESSILORLUXOTTICA	14,466	106.70	1,543,522.20
HERMES INTERNATIONAL	1,676	641.80	1,075,656.80
KERING	4,004	473.70	1,896,694.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,577	347.40	5,064,049.80
MONCLER SPA	10,437	32.85	342,855.45
PUMA SE	3,830	57.50	220,225.00
SEB SA	1,589	115.00	182,735.00
ACCOR SA	10,451	28.64	299,316.64
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,221	88.30	372,714.30
SODEXO	3,900	71.60	279,240.00
ALTICE NV -A W/I	37,625	3.53	132,853.87
BOLLORE	39,433	2.51	99,213.42
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	9.60	83,769.60
JC DECAUX SA	2,828	19.00	53,732.00
PUBLICIS GROUPE	10,736	30.08	322,938.88
SES	17,687	5.35	94,660.82
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	33.98	74,110.38
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,382	68.84	370,496.88
VIVENDI SA	44,196	21.10	932,535.60
DELIVERY HERO SE	5,334	62.88	335,401.92

INDITEX	55,558	25.26	1,403,395.08
JUST EAT TAKEAWAY	5,922	86.00	509,292.00
PROSUS NV	25,434	63.84	1,623,706.56
ZALANDO SE	6,626	39.91	264,443.66
CARREFOUR SA	28,378	14.22	403,535.16
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	35.90	65,804.70
COLRUYT NV	2,870	53.50	153,545.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	15.14	187,387.78
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	22.42	1,332,913.84
METRO AG	8,344	7.76	64,749.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,718	43.62	1,776,119.16
DANONE	32,081	58.60	1,879,946.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	28,021	6.63	185,779.23
HEINEKEN HOLDING NV	5,512	70.35	387,769.20
HEINEKEN NV	13,143	75.10	987,039.30
KERRY GROUP PLC-A	8,450	98.00	828,100.00
PERNOD-RICARD SA	11,112	139.50	1,550,124.00
REMY COINTREAU	1,273	103.20	131,373.60
BEIERSDORF AG	5,138	91.40	469,613.20
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	67.90	405,634.60
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	78.02	705,534.86
L'OREAL	13,235	244.80	3,239,928.00
UNILEVER NV	75,516	45.69	3,450,326.04
BIOMERIEUX	1,779	102.00	181,458.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	95.40	216,462.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	63.24	703,102.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,162	38.01	804,367.62
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,048	37.76	1,776,767.72
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	224.40	404,817.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,177	36.48	261,816.96
BAYER AG	51,954	57.47	2,985,796.38
EUROFINS SCIENTIFIC	701	470.00	329,470.00
GALAPAGOS NV	2,318	186.95	433,350.10
GRIFOLS S.A.	15,169	29.68	450,215.92
IPSEN	1,498	54.60	81,790.80
MERCK KGAA	6,553	95.80	627,777.40
ORION OYJ	6,379	40.35	257,392.65
QIAGEN N.V.	12,543	36.37	456,188.91
RECORDATI SPA	4,578	37.78	172,956.84
SANOFI	59,096	82.13	4,853,554.48
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	188.50	293,117.50
UCB SA	6,070	80.24	487,056.80

ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	7.95	150,382.20
AIB GROUP PLC	36,918	1.08	40,203.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	3.00	1,060,078.55
BANCO DE SABADELL SA	242,077	0.44	107,385.35
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	882,853	2.16	1,911,376.74
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,159	1.73	90,235.07
BANKIA SA	82,022	1.03	85,056.81
BANKINTER,S.A.	36,405	3.50	127,563.12
BNP PARIBAS	58,653	28.40	1,666,038.46
CAIXABANK	181,981	1.74	317,374.86
COMMERZBANK AG	46,644	3.39	158,449.66
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	6.97	405,468.36
ERSTE GROUP BANK AG	15,778	18.05	284,792.90
FINECOBANK SPA	32,034	9.44	302,465.02
ING GROEP NV-CVA	205,237	5.41	1,110,537.40
INTESA SANPAOLO	801,876	1.44	1,158,710.82
KBC GROUPE SA	13,541	48.54	657,280.14
MEDIOBANCA SPA	26,782	5.54	148,425.84
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	15.23	83,841.15
SOCIETE GENERALE	41,025	15.02	616,277.55
UNICREDIT SPA	105,606	7.43	785,391.82
AMUNDI SA	3,955	57.50	227,412.50
DEUTSCHE BANK AG -REG	99,560	6.11	609,207.64
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	132.65	1,330,612.15
EURAZEO	1,792	43.64	78,202.88
EXOR NV	6,204	50.38	312,557.52
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,071	72.96	297,020.16
NATIXIS	45,362	2.23	101,429.43
WENDEL	1,082	80.80	87,425.60
AEGON NV	91,609	2.49	228,198.01
AGEAS	8,765	34.14	299,237.10
ALLIANZ SE-REG	21,519	164.88	3,548,052.72
ASSICURAZIONI GENERALI	52,574	12.87	676,627.38
AXA SA	103,334	15.53	1,604,777.02
CNP ASSURANCES	8,978	9.40	84,393.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	138.10	422,309.80
MAPFRE SA	46,367	1.75	81,234.98
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,755	192.35	1,491,674.25
NN GROUP NV	15,922	25.32	403,145.04
POSTE ITALIANE SPA	26,562	8.30	220,623.97
SAMPO OYJ-A SHS	24,168	28.04	677,670.72

SCOR SE	7,099	22.88	162,425.12
AROUNDTOWN SA	63,402	5.25	333,240.91
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	35.05	635,947.20
VONOVIA SE	27,810	45.49	1,265,076.90
ADYEN NV	490	775.40	379,946.00
AMADEUS IT GROUP SA	21,931	49.70	1,089,970.70
ATOS SE	4,547	61.88	281,368.36
CAPGEMINI SA	8,059	81.00	652,779.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,666	130.80	871,912.80
E DENRED	12,139	40.50	491,629.50
SAP SE	51,388	110.00	5,652,680.00
WIRECARD AG	5,952	112.88	671,861.76
WORLDLINE SA	6,842	62.00	424,204.00
INGENICO S.A.	3,603	114.00	410,742.00
NOKIA OYJ	295,063	2.97	878,697.61
CELLNEX TELECOM SA	13,299	45.28	602,178.72
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	170,388	12.36	2,106,847.62
ELISA OYJ	6,988	53.68	375,115.84
ILIAD SA	1,016	128.80	130,860.80
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.19	380,190.57
ORANGE S.A.	100,867	11.36	1,146,353.45
PROXIMUS SA	9,798	20.51	200,956.98
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.37	182,377.72
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.36	91,828.38
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.47	100,096.33
TELEFONICA S.A.	241,284	4.32	1,043,312.01
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,861	28.55	195,881.55
E.ON SE	116,681	8.91	1,040,561.15
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	141,374	3.76	531,990.36
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	8.00	229,275.82
ENAGAS	10,471	20.09	210,362.39
ENDESA S.A.	18,336	19.92	365,253.12
ENEL SPA	420,373	6.45	2,712,666.96
ENGIE	91,950	9.88	909,017.70
FORTUM OYJ	24,312	15.51	377,079.12
IBERDROLA SA	317,605	9.10	2,892,746.34
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	16.11	248,722.29
RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	15.49	366,177.84
RWE AG	29,609	25.66	759,766.94
SNAM SPA	106,707	3.93	420,105.45
SUEZ	18,986	9.84	186,974.12
TERNA SPA	78,430	5.53	434,188.48

	UNIPER SE	11,709	23.62	276,566.58
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	19.23	549,228.03
	VERBUND AG	3,692	39.04	144,135.68
	ASML HOLDING NV	22,311	255.65	5,703,807.15
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	63,610	16.23	1,032,517.52
	STMICROELECTRONICS NV	35,518	22.20	788,499.60
	ユーロ 小計	10,258,623		169,584,221.56 (20,056,725,883)
英ポンド	BP PLC	1,045,687	3.35	3,510,894.10
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	216,119	15.09	3,262,532.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	197,290	14.72	2,904,108.80
	ANGLO AMERICAN PLC	51,260	14.62	749,728.76
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.62	148,164.05
	BHP GROUP PLC	110,160	13.14	1,447,502.40
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,689	44.12	339,238.68
	EVRAZ PLC	28,275	2.64	74,730.82
	GLENCORE PLC	538,015	1.44	778,830.51
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.80	199,515.57
	MONDI PLC	25,128	13.50	339,228.00
	RIO TINTO PLC	58,423	38.53	2,251,038.19
	ASHTREAD GROUP PLC	23,686	19.56	463,298.16
	BAE SYSTEMS PLC	173,381	5.38	933,483.30
	BUNZL PLC	17,064	16.94	289,064.16
	DCC PLC	4,734	53.58	253,647.72
	FERGUSON PLC	11,206	53.00	593,918.00
	MEGGITT PLC	36,960	2.81	104,042.40
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	1.00	248,689.31
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	86,917	3.50	304,383.33
	SMITHS GROUP PLC	24,168	12.37	298,958.16
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	84.00	309,540.00
	WEIR GROUP PLC/THE	16,710	9.32	155,737.20
	EXPERIAN PLC	48,942	22.52	1,102,173.84
	G4S PLC	74,291	1.06	79,379.93
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	48.42	396,269.28
	RELX PLC	100,974	17.91	1,808,949.21
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	3.92	355,235.49
	EASYJET PLC	7,630	6.81	51,975.56
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	5.12	239,260.05
	BURBERRY GROUP PLC	23,066	14.63	337,570.91
	PERSIMMON PLC	16,916	21.11	357,096.76
	TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.41	209,583.46
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	39.75	285,683.25

CARNIVAL PLC	8,091	9.65	78,126.69
COMPASS GROUP PLC	85,704	13.59	1,165,145.88
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.72	160,408.97
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,999	37.10	370,962.90
TUI AG-DI	17,636	3.98	70,332.36
WHITBREAD PLC	6,801	29.64	201,581.64
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	4.14	174,099.42
INFORMA PLC	70,487	4.63	326,425.29
ITV PLC	215,062	0.76	164,264.35
PEARSON PLC	39,623	5.22	206,832.06
WPP PLC	63,987	5.73	366,645.51
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	5.64	162,943.56
KINGFISHER PLC	109,678	1.52	167,204.11
MARKS & SPENCER GROUP PLC	84,084	1.10	92,954.86
NEXT PLC	6,860	46.24	317,206.40
OCADO GROUP PLC	22,177	13.68	303,381.36
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.00	225,853.62
TESCO PLC	527,322	2.32	1,223,387.04
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.80	264,612.23
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	19.45	326,195.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	120,786	30.20	3,648,341.13
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	20.29	176,604.16
DIAGEO PLC	123,591	26.33	3,254,151.03
IMPERIAL BRANDS PLC	45,288	16.65	754,045.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,076	61.68	2,225,167.68
UNILEVER PLC	56,404	41.24	2,326,100.96
NMC HEALTH PLC	3,940	9.38	36,972.96
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	15.64	693,712.20
ASTRAZENECA PLC	68,788	71.21	4,898,393.48
GLAXOSMITHKLINE PLC	256,292	15.44	3,957,661.06
BARCLAYS PLC	863,463	0.97	842,567.19
HSBC HOLDINGS PLC	1,064,508	4.28	4,565,142.55
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.33	1,254,304.03
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	245,244	1.22	300,423.90
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.50	660,843.54
3I GROUP PLC	49,338	7.73	381,481.41
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	14.89	291,524.94
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,570	72.32	1,126,022.40
M&G PLC	133,064	1.42	188,950.88
SCHRODERS PLC	6,213	26.60	165,265.80
ST JAMES'S PLACE PLC	23,417	8.25	193,237.08
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	2.30	283,751.42

	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	22.16	255,615.60
	AVIVA PLC	198,601	2.64	525,498.24
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.80	177,335.77
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	2.13	643,820.19
	PRUDENTIAL PLC	138,100	10.47	1,445,907.00
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	3.81	199,296.24
	AVEVA GROUP PLC	3,527	35.89	126,584.03
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	4.64	70,115.04
	SAGE GROUP PLC/THE	63,688	6.14	391,553.82
	HALMA PLC	19,839	19.70	390,828.30
	BT GROUP PLC	419,350	1.25	527,542.30
	VODAFONE GROUP PLC	1,419,322	1.13	1,604,117.72
	CENTRICA PLC	254,915	0.35	90,698.75
	NATIONAL GRID PLC	175,047	9.08	1,589,776.85
	SEVERN TRENT PLC	14,253	22.96	327,248.88
	SSE PLC	55,879	12.48	697,649.31
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.73	290,096.35
	英債券 小計	15,613,823		73,130,365.37 (9,857,973,251)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.04	182,222.04
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	495	607.00	300,465.00
	GIVAUDAN-REG	484	3,071.00	1,486,364.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	26,329	37.65	991,286.85
	SIKA AG	6,470	167.60	1,084,372.00
	ABB LTD	97,696	17.60	1,719,449.60
	GEBERIT AG-REG	1,986	406.90	808,103.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	204.80	192,716.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,102	212.70	447,095.40
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	39.71	278,724.49
	SGS SA	308	2,240.00	689,920.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,030	139.20	421,776.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	26,223	54.44	1,427,580.12
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,692	200.90	339,922.80
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	38.78	97,570.48
	DUFREY AG-REG	2,262	29.39	66,480.18
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	1,897.00	273,168.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	49	7,840.00	384,160.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	83,100.00	415,500.00
	NESTLE SA-REGISTERED	155,165	102.22	15,860,966.30
	ALCON INC	21,063	50.80	1,070,000.40
	SONOVA HOLDING AG	2,643	177.20	468,339.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	460	753.20	346,472.00

	LONZA GROUP AG-REG	3,995	399.30	1,595,203.50	
	NOVARTIS AG-REG SHS	112,292	82.12	9,221,419.04	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,601	308.70	11,298,728.70	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	143.00	377,234.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	132,838	8.61	1,144,797.88	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,877	35.61	458,549.97	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	67.35	125,742.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	751.20	730,917.60	
	UBS GROUP AG	201,356	9.67	1,948,320.65	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	142.90	353,677.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	342.50	594,237.50	
	SWISS RE AG	15,168	78.12	1,184,924.16	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,859	319.40	2,510,164.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	90.35	352,907.10	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,131	117.90	369,144.90	
	SWISSCOM AG-REG	1,239	517.00	640,563.00	
	スイスフラン 小計	910,133		62,259,188.01 (6,974,274,240)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	215.10	1,845,773.10	
	BOLIDEN AB	13,086	194.60	2,546,535.60	
	ALFA LAVAL AB	13,939	188.25	2,624,016.75	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	179.65	9,363,178.35	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	330.30	11,373,550.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	291.30	5,763,953.10	
	EPIROC AB-A	39,497	99.62	3,934,691.14	
	EPIROC AB-B	25,132	98.06	2,464,443.92	
	SANDVIK AB	61,070	140.20	8,562,014.00	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	172.80	2,714,860.80	
	SKF AB-B SHARES	20,607	140.45	2,894,253.15	
	VOLVO AB-B SHS	75,703	127.00	9,614,281.00	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	112.40	1,812,225.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,883	128.30	1,781,188.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	53.00	985,429.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,437	136.50	5,246,650.50	
	ICA GRUPPEN AB	5,614	432.70	2,429,177.80	
	SWEDISH MATCH AB	9,284	577.80	5,364,295.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,351	284.90	8,362,099.90	
	NORDEA BANK ABP	167,942	57.18	9,602,923.56	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	69.38	6,127,433.46	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	82.08	6,374,989.44	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	107.34	4,929,160.14	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,879	202.00	2,197,558.00	

	INVESTOR AB-B SHS	23,614	462.70	10,926,197.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	192.55	2,167,535.35	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,240	420.80	2,204,992.00	
	ERICSSON LM-B SHS	161,331	80.00	12,906,480.00	
	HEXAGON AB-B SHS	13,203	450.70	5,950,592.10	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,238	297.50	1,260,805.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	135.60	3,462,817.20	
	TELIA CO AB	151,710	35.03	5,314,401.30	
	スウェーデンクローナ 小計	1,297,808		163,108,502.96	(1,774,620,512)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,392	162.00	873,504.00	
	EQUINOR ASA	50,788	135.80	6,897,010.40	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	21.70	1,396,264.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	349.70	3,149,048.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	7,811	190.00	1,484,090.00	
	MOWI ASA	22,242	172.00	3,825,624.00	
	ORKLA ASA	43,456	89.58	3,892,788.48	
	DNB ASA	44,508	112.00	4,984,896.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	181.00	2,002,946.00	
	TELENOR ASA	37,498	153.00	5,737,194.00	
	ノルウェークローネ 小計	296,110		34,243,366.18	(361,609,946)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,935	511.60	3,036,346.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	310.00	3,568,720.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,581	580.40	5,560,812.40	
	ISS A/S	8,523	101.50	865,084.50	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	6,025.00	1,012,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	388	6,500.00	2,522,000.00	
	DSV PANALPINA A S	11,532	629.20	7,255,934.40	
	PANDORA A/S	4,763	224.20	1,067,864.60	
	CARLSBERG AS-B	5,585	792.80	4,427,788.00	
	COLOPLAST-B	6,052	993.40	6,012,056.80	
	DEMANT A/S	4,455	151.40	674,487.00	
	GENMAB A/S	3,294	1,465.00	4,825,710.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	219.20	634,803.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	92,657	406.45	37,660,437.65	
	DANSKE BANK A/S	32,789	74.06	2,428,353.34	
	TRYG A/S	5,752	185.00	1,064,120.00	
ORSTED A/S	9,592	654.60	6,278,923.20		
	デンマーククローネ 小計	215,474		88,895,641.09	(1,408,106,954)
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	24.22	324,208.92	

オーストラリア
ドル

OIL SEARCH LTD	70,573	2.70	190,547.10
ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	5.10	455,460.60
SANTOS LTD	84,526	4.61	389,664.86
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,659	17.95	137,479.05
WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,112	21.84	1,007,086.08
WORLEY LIMITED	31,142	7.19	223,910.98
ALUMINA LTD	106,977	1.47	157,791.07
BHP GROUP LTD	152,583	31.50	4,806,364.50
BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	10.19	235,276.91
BORAL LIMITED	75,397	2.58	194,524.26
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	11.34	794,945.34
INCITEC PIVOT LTD	61,355	2.21	135,594.55
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	27,158	20.27	550,492.66
NEWCREST MINING LIMITED	42,092	25.64	1,079,238.88
ORICA LIMITED	17,981	17.18	308,913.58
RIO TINTO LIMITED	19,336	89.39	1,728,445.04
SOUTH32 LTD	235,718	2.03	478,507.54
CIMIC GROUP LTD	4,062	23.25	94,441.50
BRAMBLES LIMITED	74,644	10.93	815,858.92
SEEK LIMITED	18,186	16.32	296,795.52
AURIZON HOLDINGS LTD	120,139	4.35	522,604.65
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	3.56	163,158.36
ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,541	22.90	722,288.90
CROWN RESORTS LTD	21,863	8.32	181,900.16
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	11.56	30,634.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	2.86	297,554.40
REA GROUP LTD	2,556	84.47	215,905.32
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,543	2.81	94,255.83
WESFARMERS LIMITED	59,674	37.50	2,237,775.00
COLES GROUP LIMITED	57,494	15.95	917,029.30
WOOLWORTHS GROUP LTD	65,824	35.10	2,310,422.40
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	9.41	220,589.22
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	10.63	387,612.32
COCHLEAR LIMITED	2,927	189.50	554,666.50
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	61.20	578,095.20
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	22.84	481,490.04
CSL LIMITED	23,588	329.00	7,760,452.00
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	152,816	16.54	2,527,576.64
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	6.17	122,418.97
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	91,374	61.76	5,643,258.24
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	154,272	16.08	2,480,693.76
WESTPAC BANKING CORPORATION	186,708	15.96	2,979,859.68

	AMP LIMITED	223,504	1.30	291,672.72
	ASX LTD	9,287	79.54	738,687.98
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	4.93	113,498.46
	MACQUARIE GROUP LTD	16,904	99.50	1,681,948.00
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	49.87	288,398.21
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	6.13	718,356.31
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.69	346,267.56
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	67,004	9.11	610,406.44
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	9.09	581,150.97
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	10.81	302,323.27
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	15.96	126,227.64
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.14	681,201.02
	TPG TELECOM LTD	17,758	7.30	129,633.40
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	17.47	567,635.24
	AUSNET SERVICES	85,220	1.79	152,969.90
	オーストラリアドル 小計	3,582,134		53,166,165.87 (3,645,603,993)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	65,410	3.56	232,859.60
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,175	5.75	259,756.25
	A2 MILK CO LTD	37,422	17.48	654,136.56
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,600	27.00	826,200.00
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,962	11.12	177,497.44
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.35	382,351.95
	MERCURY NZ LTD	30,223	4.25	128,447.75
	MERIDIAN ENERGY LTD	79,542	4.36	346,803.12
	ニュージーランドドル 小計	392,231		3,008,052.67 (197,779,463)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	137,424	57.80	7,943,107.20
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	8.22	571,290.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	56.85	4,007,925.00
	MTR CORPORATION	84,500	42.30	3,574,350.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	13.24	357,480.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	48.00	5,664,000.00
	SANDS CHINA LTD	116,000	30.45	3,532,200.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.48	598,400.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	12.86	910,488.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	65,000	20.80	1,352,000.00
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	27.25	1,144,500.00
	WH GROUP LIMITED	534,500	7.82	4,179,790.00
	BANK OF EAST ASIA	87,220	16.84	1,468,784.80
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	24.15	4,528,125.00
	HANG SENG BANK LTD	38,800	137.90	5,350,520.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,300	247.40	15,413,020.00	

	AIA GROUP LTD	629,800	71.60	45,093,680.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	123,924	46.50	5,762,466.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.52	1,618,960.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	32.25	2,689,134.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	22.20	610,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	339,333	8.95	3,037,030.35	
	SINO LAND CO	202,200	10.04	2,030,088.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	84,500	108.20	9,142,900.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	51.70	1,395,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	21.50	1,139,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	29.90	2,152,800.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	37,000	54.35	2,010,950.00	
	PCCW LIMITED	269,000	4.53	1,218,570.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	47.35	1,420,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	79.70	6,782,470.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.95	882,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	550,014	14.08	7,744,197.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	50.50	3,610,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	81.55	1,003,065.00	
	香港ドル 小計	4,697,599		159,941,890.47 (2,232,788,790)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	5.72	399,828.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	43,720	1.58	69,077.60	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	3.26	323,066.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	197,100	0.92	181,332.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	1.50	175,050.00	
	SATS LTD	26,800	3.20	85,760.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	6.13	153,654.58	
	GENTING SINGAPORE LTD	260,600	0.72	188,935.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	1.54	106,337.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	20.42	95,974.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	3.43	353,976.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	95,000	19.14	1,818,300.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	179,100	8.95	1,602,945.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,900	20.17	1,288,863.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	9.70	345,320.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	2.95	402,970.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.72	199,176.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.76	146,692.00	
	VENTURE CORP LTD	15,200	15.22	231,344.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	441,915	2.71	1,197,589.65	
		2,030,751		9,366,189.83	

シンガポールドル 小計				(715,670,564)
イスラエルシケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	11.65	334,483.15
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	440.00	611,160.00
	BANK HAPOLIM BM	52,321	20.85	1,090,892.85
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	18.92	1,327,238.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	10.74	587,198.76
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	65.00	601,185.00
	AZRIELI GROUP	2,140	182.40	390,336.00
	NICE LTD	3,251	557.00	1,810,807.00
イスラエルシケル 小計		221,885		6,753,300.76 (204,422,414)
合 計		57,121,710		187,233,126,027 (187,233,126,027)

(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 610銘柄	68.6%	71.2%
カナダドル	株式 84銘柄	3.4%	3.5%
ユーロ	株式 237銘柄	10.3%	10.7%
英ポンド	株式 93銘柄	5.1%	5.3%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.6%	3.7%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	0.9%	0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.8%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	1.9%	1.9%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 35銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 20銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシケル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	310,524.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,338	1,000,136.40	
		AMERICAN TOWER CORP	23,225	6,029,210.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,789	405,409.23	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,591	1,270,429.76	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	830,510.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	436,719.18	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,726	2,035,428.54
	DUKE REALTY CORP	20,741	737,549.96
	EQUINIX INC	4,423	3,038,335.62
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	547,304.88
	EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,365,560.82
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	822,870.72
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	665,107.33
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,613	310,718.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,237	687,118.95
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	447,446.79
	INVITATION HOMES INC	30,462	740,531.22
	IRON MOUNTAIN INC	14,204	385,070.44
	KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	228,193.80
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,595	468,132.55
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	674,237.00
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	291,849.62
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,454	361,603.86
	PROLOGIS INC	38,188	3,502,985.24
	PUBLIC STORAGE	8,249	1,720,658.91
	REALTY INCOME CORPORATION	17,798	1,008,790.64
	REGENCY CENTERS CORP	8,289	365,710.68
	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,756	1,142,256.52
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	213,700.65
	SUN COMMUNITIES INC	4,598	612,591.54
	UDR INC	16,633	683,948.96
	VENTAS INC	21,118	713,788.40
	VEREIT INC	54,273	286,561.44
	VICI PROPERTIES INC	23,498	403,225.68
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	378,536.88
	WELLTOWER INC	20,071	1,136,018.60
	WEYERHAEUSER CO	37,766	793,463.66
	WP CAREY INC	8,640	604,800.00
	米ドル 小計	688,913	37,657,037.19 (4,075,621,135)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	181,633.54
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	95,375.22
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,144	72,868.80
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	132,226.57
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	83,136.15
	カナダドル 小計	28,687	565,240.28

				(43,834,383)
ユーロ	COVIVIO		2,388	154,145.40
	GECINA SA		2,189	278,440.80
	ICADE		2,061	159,212.25
	KLEPIERRE		9,305	179,400.40
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED		7,176	468,879.84
ユーロ 小計			23,119	1,240,078.69 (146,664,106)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC		44,962	184,434.12
	LAND SECURITIES GROUP PLC		32,703	221,399.31
	SEGRO PLC		59,061	488,080.10
英ポンド 小計			136,726	893,913.53 (120,499,543)
オーストラリアドル	APA GROUP		68,168	747,802.96
	DEXUS		54,256	514,346.88
	GOODMAN GROUP		86,301	1,196,131.86
	GPT GROUP		97,296	395,021.76
	LENLEASE GROUP		36,404	424,106.60
	MIRVAC GROUP		200,053	460,121.90
	SCENTRE GROUP		275,200	572,416.00
	STOCKLAND		127,393	384,726.86
	SYDNEY AIRPORT		49,760	284,627.20
	TRANSURBAN GROUP		145,680	1,788,950.40
	VICINITY CENTRES		146,656	206,784.96
オーストラリアドル 小計			1,287,167	6,975,037.38 (478,278,313)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD		197,000	2,340,360.00
	LINK REIT		110,100	7,431,750.00
香港ドル 小計			307,100	9,772,110.00 (136,418,655)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		150,400	419,616.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,400	190,384.00
	CAPITALAND MALL TRUST		120,700	202,776.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		104,900	176,232.00
	SUNTEC REIT		102,700	132,483.00
シンガポールドル 小計			609,100	1,121,491.00 (85,693,127)
合計				5,087,009,262 (5,087,009,262)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 39銘柄	2.1%	80.1%
カナダドル	投資証券 5銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	2.9%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.4%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.2%	9.4%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.7%
シンガポールドル	投資証券 5銘柄	0.0%	1.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
預金	166,448,781	308,581,281
金銭信託	205,805,781	597,505,503
コール・ローン	17,472,436	415,356,115
国債証券	165,139,623,462	154,165,757,446
未収利息	1,415,982,651	1,166,031,411
前払費用	50,568,010	26,718,180
流動資産合計	166,995,901,121	156,679,949,936
資産合計	166,995,901,121	156,679,949,936
負債の部		
流動負債		
未払解約金	167,798,612	346,702,542
未払利息	50	1,126
その他未払費用	13,633	127,850
流動負債合計	167,812,295	346,831,518
負債合計	167,812,295	346,831,518
純資産の部		
元本等		
元本	93,585,617,520	84,556,952,355
剰余金		
剰余金又は欠損金()	73,242,471,306	71,776,166,063
元本等合計	166,828,088,826	156,333,118,418
純資産合計	166,828,088,826	156,333,118,418
負債純資産合計	166,995,901,121	156,679,949,936

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	93,585,617,520口	84,556,952,355口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7826円 (10,000口当たりの純資産額 17,826円)	1口当たり純資産額 1.8488円 (10,000口当たりの純資産額 18,488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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 4月13日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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)

(2019年 4月15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	105,069,479,839円
同期中における追加設定元本額	8,099,962,176円
同期中における一部解約元本額	19,583,824,495円
2019年 4月15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	11,021,480,564円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	591,416,375円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,617,781,954円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	814,098,767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)	95,754,367円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,428,957円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	33,808,342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)	88,960,450円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	104,480,752円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	54,396,352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)	129,190,063円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,379,266円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	542,375,605円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	503,674,596円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	451,944,331円
イオン・バランス戦略ファンド	51,896,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,457,849円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	52,161,177円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,492,093円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	74,985,318円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,290,016円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,751,100円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,974,112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>	1,737,705,491円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,656,536,009円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,806,225,886円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,090,969,135円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	42,432,859円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	106,870,983円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,437円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	762,181,383円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,280,990,905円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,583,991,812円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,066,370,289円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,711,878,991円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,272,452円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,146,218,597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)	567,678,098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)	1,335,742,996円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	190,341,823円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	270,520,585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)	1,697,062,565円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	154,601,447円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,886,445円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	149,017,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	563,081,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	177,236,275円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	170,901,923円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	53,384,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,651,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,365,424,865円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,153,877円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	3,715,575,678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 >	1,636,072,898円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	6,196,835,258円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	704,570,800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 >	44,399,157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 >	40,044,700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 >	410,598,751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 >	196,656,702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 >	484,437,893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 >	824,402,719円
合計	93,585,617,520円

(2020年 4月13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	93,585,617,520円
同期中における追加設定元本額	19,007,917,668円
同期中における一部解約元本額	28,036,582,833円
2020年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国債券インデックスファンド S	21,722,757,217円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	620,743,841円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,623,582,446円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	762,999,674円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	59,334,732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)	8,595,523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)	31,127,149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)	88,259,689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)	122,049,060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)	67,678,112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)	141,427,020円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	22,354,389円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,833,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	139,221,474円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	105,757,710円
イオン・バランス戦略ファンド	11,543,568円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	5,928,646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)	60,159,644円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	118,132,027円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	42,972,475円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,521,125円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	39,747,781円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	1,305,631円

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	96,216円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	393,028円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	205,854円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,121,849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>	1,979,767,666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>	65,167,979円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,428,559,138円
S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,852,730,810円
S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,719,433,443円
S M A M・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,972,335円
S M A M・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	89,375,303円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	383,602円
S M A M・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	615,393,737円
S M A M・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	107,986,579円
S M A M・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,121,811,212円
S M A M・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,345,145,307円
S M A M・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,687,191,656円
S M A M・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,414,915,975円
S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,474,614円
S M A M・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,314,565,021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)	360,272,280円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	155,841,347円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	102,843,371円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,912,561円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,525,068円
S M A M・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	128,196,997円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	486,454,418円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	145,459,904円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,950,132円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,161,186円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,197,268,688円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,121,083円
S M A M・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>	1,870,186,532円
S M A M・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>	1,211,426,201円
S M A M・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,740,964,036円
S M A M・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	515,138,509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>	119,634,570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>	40,310,514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>	34,933,875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>	37,467,680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>	519,383,116円
合計	84,556,952,355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	3,000,000.00	3,034,804.68	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,554,667.98	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,734,804.70	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,128,300.77	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,638,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25	4,500,000.00	4,572,421.87	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,092,812.50	
		US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,430,468.74	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,054,375.00	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,111,875.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,093,164.07	
		US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,619,355.46	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,589,453.12	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,108,632.82	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,046,210.94	
		US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,733,453.13	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,068,789.07	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,606,230.46	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,104,648.43	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,108,281.25	
		US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,102,734.38	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,588,242.19	
		US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,061,015.63	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,758,398.45	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,064,218.76	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,510,765.64	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,622,910.16	
		US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,144,531.24	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,120,937.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,123,984.39	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,137,343.75	
		US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,553,750.00	
		US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,446,322.25	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,336,523.45			

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,204,609.39
US TREASURY N/B 1.625	5,450,000.00	5,901,753.93
US TREASURY N/B 1.75	10,500,000.00	10,713,281.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,075,351.57
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,086,015.64
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,853,789.05
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,475,187.51
US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,230,687.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,096,210.93
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,101,132.82
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,110,390.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,122,343.75
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,820,128.91
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,483,570.34
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	900,103.51
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,584,687.51
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,385,000.00
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,471,250.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,064,531.26
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,100,546.89
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,104,765.64
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,763,152.34
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,985,250.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,123,632.82
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,916,648.44
US TREASURY N/B 1.875	3,500,000.00	3,785,468.75
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,462,624.99
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,060,937.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,074,882.82
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,083,085.93
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,423,960.95
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,606,777.33
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,201,476.57
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,120,585.93
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,655,859.37
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,227,148.45
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,985,101.57
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,131,328.12
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,521,718.75
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,670,019.52
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,765,917.96
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,649,542.95

US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,462,109.40
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,160,234.38
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,740,773.44
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,103,125.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,084,492.18
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,097,617.18
US TREASURY N/B 2.125	4,500,000.00	4,676,835.96
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,125,273.43
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,200,625.00
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,300,410.16
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,137,109.38
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,952,968.75
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,760,585.95
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,307,656.24
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,942,242.19
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,316,882.83
US TREASURY N/B 2.125	3,900,000.00	4,274,156.25
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,061,171.89
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,598,261.73
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,874,812.50
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,473,343.75
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,213,046.89
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,573,953.11
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,088,710.92
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,625,625.00
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,830,824.20
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,367,375.00
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,389,062.52
US TREASURY N/B 2.25	2,700,000.00	2,975,695.32
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,891,218.77
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,697,765.64
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,933,156.27
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	3,437,144.54
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	4,262,343.75
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	3,061,171.89
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,044,531.26
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,748,218.76
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,270,171.87
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,988,628.89
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	6,081,031.26
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,508,289.08
US TREASURY N/B 2.375	5,200,000.00	5,965,781.27
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,499,625.00

US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,975,406.25	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,646,289.08	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,364,648.45	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,194,074.23	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,739,867.19	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,561,382.81	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,137,492.20	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,649,695.32	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,168,562.50	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	513,281.25	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,115,156.24	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,122,812.52	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,120,820.32	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,268,906.24	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,549,675.78	
US TREASURY N/B 2.625	4,800,000.00	5,376,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	7,346,390.62	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,137,031.24	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,450,640.63	
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,116,253.89	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,160,234.38	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,111,273.42	
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,562,250.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,566,570.33	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,225,859.38	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,595,312.50	
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,355,691.40	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,577,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,580,156.26	
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,613,312.50	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	5,030,250.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,988,320.32	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,168,906.24	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,359,687.52	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,183,515.62	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,468,554.68	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,236,125.00	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,831,738.27	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,700,937.52	
US TREASURY N/B 2.875	5,500,000.00	6,486,562.50	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,957,187.50	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	5,353,437.52	

US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,865,062.50
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,231,804.69
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,546,093.76
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,528,550.78
US TREASURY N/B 3	800,000.00	1,071,875.00
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,751,796.87
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	4,089,609.39
US TREASURY N/B 3	3,700,000.00	5,066,976.58
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,458,593.75
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	3,043,046.88
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	4,300,039.07
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	7,511,484.40
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	5,304,562.50
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,096,445.32
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	6,864,046.87
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,497,546.87
US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,364,375.00
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	3,146,328.12
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	5,251,125.00
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	3,403,500.00
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	5,727,812.52
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,605,921.87
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,133,875.00
US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,540,937.51
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	5,333,062.50
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	2,221,054.69
US TREASURY N/B 3.75	2,700,000.00	4,062,656.25
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	2,235,703.12
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,543,671.88
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	937,781.25
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	776,132.81
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	1,098,562.50
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	2,206,531.25
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,874,093.75
US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,147,382.81
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	315,234.37
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,590,234.38
US TREASURY N/B 4.625	1,600,000.00	2,589,875.00
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,493,164.07
US TREASURY N/B 5	500,000.00	817,968.75
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	692,109.37
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	474,075.00
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	697,070.31

	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,317,343.75
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,410,390.63
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	958,500.00
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	692,968.75
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,460,722.65
	米ドル 小計	640,870,000.00	719,223,665.39 (77,841,577,305)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,003,500.00
	CANADA-GOV'T 0.75	500,000.00	500,770.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,006,380.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,009,340.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,042,510.00
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,333,553.00
	CANADA-GOV'T 1.25	300,000.00	314,373.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,064,520.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,039,540.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,053,500.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,140,524.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	996,210.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,065,120.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,518,524.00
	CANADA-GOV'T 2.25	600,000.00	682,782.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,266,299.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,889,766.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,470,117.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	741,350.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,032,150.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,206,515.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,255,985.00
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,312,924.00
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	361,357.50
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	797,375.00
	CANADA-GOV'T 8	700,000.00	1,058,561.00
	カナダドル 小計	32,500,000.00	37,163,545.50 (2,882,032,953)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,781,440.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	19,246,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	52,000,000.00	52,611,000.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,959,002.50
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,170,100.00
	MEXICAN BONOS 7.75	11,000,000.00	11,195,140.00
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	28,663,483.50

	MEXICAN BONOS 8.5	16,000,000.00	17,418,560.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	41,853,600.00
	メキシコペソ 小計	229,000,000.00	239,898,926.00 (1,108,333,038)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,008,882.00
	BELGIAN 0.8	800,000.00	840,800.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	740,866.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	530,885.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,873,760.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,662,272.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	761,516.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,042,712.00
	BELGIAN 0321 4.25	2,300,000.00	2,458,286.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,275,850.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,897,523.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,626,675.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	560,595.00
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	954,744.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,033,100.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	713,150.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	460,464.00
	BELGIAN 0347 0.9	800,000.00	858,040.00
	BELGIAN 0348 1.7	300,000.00	370,074.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,493,744.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,084,950.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	448,536.00
	BELGIAN 1.6	850,000.00	1,024,870.50
	BELGIAN 1.9	500,000.00	615,205.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	723,225.00
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,360,432.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	995,830.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,494,720.00
	BTPS 0.35	500,000.00	483,600.00
	BTPS 0.45	1,500,000.00	1,498,815.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,988,800.00
	BTPS 0.85	700,000.00	679,987.00
	BTPS 0.9	2,250,000.00	2,260,080.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,009,120.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,010,660.00
	BTPS 1	1,000,000.00	1,006,930.00
	BTPS 1.2	1,000,000.00	1,010,210.00
	BTPS 1.25	1,600,000.00	1,600,960.00
	BTPS 1.35	2,000,000.00	2,025,840.00

BTPS 1.45	2,000,000.00	2,034,780.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,834,182.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,016,400.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,751,516.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,227,564.00	
BTPS 1.65	1,700,000.00	1,688,202.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,035,860.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,359,683.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,671,584.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,571,970.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,050,600.00	
BTPS 2.15	500,000.00	512,630.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,058,270.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,238,508.00	
BTPS 2.3	600,000.00	615,090.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,175,438.00	
BTPS 2.45	400,000.00	401,108.00	
BTPS 2.5	600,000.00	638,820.00	
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,180,003.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,641,357.00	
BTPS 2.8	300,000.00	331,620.00	
BTPS 2.8	900,000.00	944,253.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,114,810.00	
BTPS 3	3,500,000.00	3,937,500.00	
BTPS 3.1	700,000.00	793,674.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,740,765.00	
BTPS 3.35	850,000.00	997,475.00	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,681,372.00	
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,226,078.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,067,280.00	
BTPS 3.75	2,200,000.00	2,289,760.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,230,920.00	
BTPS 3.85	400,000.00	515,780.00	
BTPS 4	2,100,000.00	2,651,124.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,555,139.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,405,240.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,135,322.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,748,434.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,817,950.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,143,925.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,283,776.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,161,940.00	

BTPS 5	1,000,000.00	1,185,260.00
BTPS 5	2,070,000.00	2,846,436.30
BTPS 5	1,800,000.00	2,578,068.00
BTPS 5	1,700,000.00	2,443,546.00
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,334,328.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,237,940.00
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,445,807.00
BTPS 6	2,200,000.00	3,139,378.00
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,315,434.00
BTPS 7.25	400,000.00	549,436.00
BTPS 9	300,000.00	384,795.00
BUNDESÖBL-173 0	2,200,000.00	2,213,112.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,029,460.00
BUNDESÖBL-176 0	2,000,000.00	2,031,800.00
DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,483,016.00
DEUTSCHLAND REP 0	500,000.00	518,175.00
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	294,792.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,896,264.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,070,549.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,013,962.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,634,950.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,400,000.00	1,487,948.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,610,910.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,153,980.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,392,287.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,225,295.50
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,250,000.00	1,677,050.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	500,000.00	530,775.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,386,385.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,175,640.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,317,392.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	3,000,000.00	3,277,140.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,633,530.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,456,196.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,552,714.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,474,828.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,090,136.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,070,188.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,755,818.50
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,295,040.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,200,000.00	3,785,342.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,150,000.00	2,291,628.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,473,813.00

DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,478,350.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,509,360.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	827,685.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,513,600.00	
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	404,308.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	416,960.00	
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	833,160.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	534,960.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	224,246.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,057,920.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,051,520.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,095,490.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	743,035.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	736,920.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,040,470.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,223,800.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,400,000.00	2,413,536.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,019,680.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,223,826.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,027,560.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,059,880.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,216,224.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	1,980,940.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,457,672.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,015,507.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,500,000.00	1,560,555.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,300,000.00	3,432,792.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,655,625.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,806,998.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,188,785.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,690,525.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,908,335.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,698,968.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,184,469.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	1,400,000.00	1,665,860.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,207,210.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,300,000.00	2,521,490.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,500,000.00	1,831,470.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,062,536.00	
FRANCE O.A.T. 2	1,900,000.00	2,495,137.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,033,038.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,768,764.00	

FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,341,330.00
FRANCE O.A.T. 2.75	2,550,000.00	3,092,640.00
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,359,400.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,645,925.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,494,634.00
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,054,800.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,549,090.00
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,233,680.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,688,679.80
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,883,790.00
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,500,850.00
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,143,672.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,612,378.00
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,104,485.00
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,531,339.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,037,310.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	763,758.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	403,404.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	716,121.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	742,959.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,058,900.00
IRISH GOVT 1.1	600,000.00	648,222.00
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	463,628.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	351,576.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,281,080.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	726,858.00
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	570,470.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	561,580.00
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	1,015,128.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,817,172.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,018,780.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,034,910.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,300,000.00	1,348,841.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,200,000.00	1,263,252.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	322,338.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	900,000.00	967,536.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,079,380.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,719,568.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,106,050.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,595,745.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,324,880.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,007,300.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	838,296.00

NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	783,622.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,313,051.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,825,758.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,014,293.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,114,179.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	832,088.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	884,552.50	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	951,390.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	740,936.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,078,690.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	269,710.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	400,000.00	502,120.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,197,482.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,075,750.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	777,348.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	981,360.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,211,727.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,057,420.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,084,270.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,518,097.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,127,346.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	650,275.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,456,390.00	
SPANISH GOV'T 0	500,000.00	492,510.00	
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	999,760.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,018,560.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	505,480.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,023,640.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,836,107.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,116,100.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,695,824.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	636,126.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,088,239.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,276,728.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,340,426.00	
SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	440,564.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,200,000.00	1,308,516.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,892,933.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,194,160.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,700,000.00	1,984,920.00	
SPANISH GOV'T 2.7	850,000.00	1,074,400.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,333,667.00	

	SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,823,402.00
	SPANISH GOV'T 3.45	900,000.00	1,372,626.00
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,173,125.00
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,415,682.50
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,299,540.00
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,205,774.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,426,025.00
	SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,761,330.00
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,460,495.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,057,745.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,111,448.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,582,325.00
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,856,708.00
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,347,275.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,434,872.00
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	667,715.00
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,196,072.00
	ユーロ 小計	392,140,000.00	465,464,530.10 (55,050,489,974)
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,819,494.00
	UK TSY GILT 0.625	1,000,000.00	1,025,960.00
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	766,980.00
	UK TSY GILT 0.875	2,000,000.00	2,115,100.00
	UK TSY GILT 1	1,300,000.00	1,349,023.00
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,081,130.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,087,620.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	2,060,264.00
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	849,755.50
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,246,680.00
	UK TSY GILT 1.625	300,000.00	397,443.00
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,249,224.00
	UK TSY GILT 1.75	1,500,000.00	1,783,530.00
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	965,625.00
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,215,291.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,900,772.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,885,072.00
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,452,841.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,506,592.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,716,972.50
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	3,317,469.50
	UK TSY GILT 3.75	1,500,000.00	1,577,700.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	3,081,168.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,613,100.00

	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,824,354.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,441,132.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,307,403.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,644,258.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,150,000.00	1,917,475.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,210,000.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,815,200.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,775,322.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,727,080.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,715,208.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,445,592.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,685,497.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	2,084,916.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,609,413.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	974,142.00	
	UK TSY GILT 8	820,000.00	894,652.80	
	英bond 小計	51,720,000.00	74,136,452.80 (9,993,593,837)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,262,760.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	4,400,000.00	4,730,528.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,450,590.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,691,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,661,200.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,219,424.00	
	スウェーデンクローナ 小計	33,000,000.00	38,016,402.00 (413,618,453)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,131,520.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,716,545.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,333,950.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,968,380.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,313,860.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,446,440.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,417,240.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,235,260.00	
	ノルウェークローネ 小計	33,200,000.00	35,563,195.00 (375,547,339)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	8,100,000.00	8,562,429.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,346,400.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,711,240.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,385,910.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	19,298,895.00	
	デンマーククローネ 小計	36,600,000.00	47,304,874.00	

ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,042,960.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,028,280.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,844,925.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,245,130.00
	POLAND GOVT BOND 2.75	1,000,000.00	1,115,330.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,654,446.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,997,837.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,308,400.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,689,104.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,903,132.00
ポーランドズロチ 小計		30,900,000.00	33,829,544.00 (879,229,848)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1,400,000.00	1,473,220.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,029,760.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,577,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	2,233,060.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,556,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,739,450.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,700,000.00	1,956,071.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,090,052.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,524,328.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	959,840.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,758,498.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,164,024.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,538,984.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	850,000.00	1,078,097.50
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,607,220.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,150,000.00	2,621,237.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,986,614.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,949,152.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,314,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	1,800,000.00	1,907,496.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,808,452.00	
オーストラリアドル 小計		34,950,000.00	40,874,475.50 (2,802,762,785)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,120,322.94
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,277,743.44
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	495,433.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	884,478.21
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	466,201.84
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	767,784.50
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	846,770.56

	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	812,467.50
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,757,246.10
	シンガポールドル 小計	7,450,000.00	8,428,448.09 (644,017,718)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,134,522.50
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,005,429.45
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,559,545.77
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,348,322.50
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,303,093.30
	マレーシアリングgit 小計	28,200,000.00	29,350,913.52 (735,533,892)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	36,180,000.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	16,204,000.00
	REP SOUTH AFRICA 7	59,000,000.00	43,949,100.00
	REP SOUTH AFRICA 8	22,500,000.00	18,618,750.00
	南アフリカランド 小計	157,500,000.00	114,951,850.00 (689,711,100)
	合計		154,165,757,446 (154,165,757,446)

(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 209銘柄	49.8%	50.5%
カナダドル	国債証券 26銘柄	1.8%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券 268銘柄	35.2%	35.7%
英ポンド	国債証券 40銘柄	6.4%	6.5%
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 8銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 9銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.4%	0.4%

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。

マネーインカム・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2019年 4月15日現在）	（2020年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	628,838,769	460,340,439
コール・ローン	53,386,960	320,005,783
特殊債券	1,809,408,010	1,854,685,360
未収利息	3,743,916	5,508,528
前払費用	442,132	1,425,751
流動資産合計	2,495,819,787	2,641,965,861
資産合計	2,495,819,787	2,641,965,861
負債の部		
流動負債		
未払解約金	70,000	470,000
未払利息	155	867
その他未払費用	17,530	79,949
流動負債合計	87,685	550,816
負債合計	87,685	550,816
純資産の部		
元本等		
元本	2,470,784,621	2,617,198,028
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	24,947,481	24,217,017
元本等合計	2,495,732,102	2,641,415,045
純資産合計	2,495,732,102	2,641,415,045
負債純資産合計	2,495,819,787	2,641,965,861

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊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	(2019年 4月15日現在)	(2020年 4月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,470,784,621口	2,617,198,028口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0101円 (10,000口当たりの純資産額 10,101円)	1口当たり純資産額 1.0093円 (10,000口当たりの純資産額 10,093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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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、特殊債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	(2020年 4月13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(特殊債券) 「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 2019年 4月16日 至 2020年 4月13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）

（2019年 4月15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	2,395,913,189円
同期中における追加設定元本額	2,164,761,637円
同期中における一部解約元本額	2,089,890,205円
2019年 4月15日現在における元本の内訳	
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）	14,875,223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）	79,155,853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）	56,665,796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）	14,490,786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）	16,880,283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）	8,805,949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）	20,734,392円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	699,943,772円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 ＜適格機関投資家限定＞	492,643,108円
S M A M ・ F G マネーファンドV A ＜適格機関投資家限定＞	1,066,192,947円
合計	2,470,784,621円

（2020年 4月13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	2,470,784,621円
同期中における追加設定元本額	1,387,344,474円
同期中における一部解約元本額	1,240,931,067円
2020年 4月13日現在における元本の内訳	
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）	13,868,252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）	94,104,342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）	75,050,091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)	17,362,669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)	22,920,681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)	12,836,318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)	27,309,935円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	782,308,395円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	468,868,961円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	1,102,171,872円
合計	2,617,198,028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
特殊債券	第25回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,109,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,292,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,670,000	
	第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,132,000	
	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,011,000	
	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	244,000,000	244,961,360	
	第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,980,000	
	第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,075,000	
	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,082,000	
	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,486,000	
	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	100,825,000	
	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,062,000	
合計		1,844,000,000	1,854,685,360	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）

2020年 4月30日現在

資産総額	681,659,910円
負債総額	143,377円
純資産総額（ - ）	681,516,533円
発行済口数	442,551,203口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5400円
（1万口当たり純資産額）	（15,400円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2020年4月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2020年4月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	749	7,160,364
単体型株式投資信託	123	569,027
追加型公社債投資信託	1	28,432
単体型公社債投資信託	183	455,190
合計	1,056	8,213,015

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785
未収投資助言報酬	285,668	299,826
未収収益	44,150	37,702
その他の流動資産	31,771	40,119
流動資産合計	22,771,504	45,664,712
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	173,517	101,609
器具備品	751,471	783,224

土地	-	710
リース資産	-	968
建設仮勘定	-	66,498
有形固定資産合計	924,988	953,010
無形固定資産		
ソフトウェア	479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定	183,528	508,733
のれん	-	34,397,824
顧客関連資産	-	17,785,166
電話加入権	44	12,739
商標権	60	54
無形固定資産合計	663,501	53,613,651
投資その他の資産		
投資有価証券	10,829,628	19,436,480
関係会社株式	10,252,067	11,246,398
長期差入保証金	2,004,451	2,523,637
長期前払費用	97,107	113,852
会員権	7,819	90,479
繰延税金資産	1,426,381	-
貸倒引当金	-	20,750
投資その他の資産合計	24,617,457	33,390,098
固定資産合計	26,205,946	87,956,760
資産合計	48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
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
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
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	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支援手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691
一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022

事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	-	778,113
受取利息	623	947
時効成立分配金・償還金	72	1,041
原稿・講演料	1,951	2,061
投資有価証券償還益	289,451	6,398
投資有価証券売却益	7,247	24,206
雑収入	36,408	53,484
営業外収益合計	335,754	866,254
営業外費用		
為替差損	15,760	72,457
投資有価証券償還損	13,668	129,006
投資有価証券売却損	14,605	12,906
雑損失	7,027	8,334
営業外費用合計	51,061	222,704
経常利益	6,292,738	2,166,469
特別利益		
過去勤務費用償却益	79,850	-
特別利益合計	79,850	
特別損失		
固定資産除却損	1 1,462	110,668
関係会社株式評価損	160,455	-
合併関連費用	2 187,140	42,800
本社移転費用	3 -	133,168
減損損失	4 -	46,417
特別損失合計	349,058	333,054
税引前当期純利益	6,023,530	1,833,414
法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	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
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等	
	利益剰余金			

	利益剰余金 合計	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

[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

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（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2016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	3～15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、当事業年度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)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「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、当事業年度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。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別利益」の「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」に表示していた7,247千円及び289,451千円は「営業外収益」として、「特別損失」の「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」に表示していた14,605千円及び13,668千円は「営業外費用」として組み替えております。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	350,176千円	466,875千円
器具備品	922,553千円	1,225,261千円
リース資産	-千円	1,452千円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020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 DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	174,854千円	132,559千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	当事業年度 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	-千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	-千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	102,695千円

2 合併関連費用

前事業年度の合併関連費用は、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。

当事業年度の合併関連費用は、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及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

3 本社移転費用

本社移転費用は、本社事務所移転に伴い解約日までに賃貸期間の残存分(2020年7月13日から2020年9月30日まで)の賃料及び共益費相当額として133,168千円支払うものであります。

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

上記事業用資産については、霞ヶ関オフィスの移転に係る意思決定をしたことに伴い将来の使用が見込めなくなった資産につき、回収可能額を零と見積もり、当該減少額を減損損失に計上しております。その内訳は、建物に計上した資産除去債務に対応する原状回復費用相当額であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	17,622,360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2018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2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019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
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019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

2019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
2019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	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	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	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060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
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25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

2020年6月29日開催の第35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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(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、経営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、次表には含まれていません（（注2）参照）。

前事業年度（2019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	-

当事業年度(2020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	33,264,545	33,264,545	-
(2)顧客分別金信託	300,021	300,021	-
(3)未収委託者報酬	8,404,880	8,404,880	-
(4)未収運用受託報酬	2,199,785	2,199,785	-
(5)未収投資助言報酬	299,826	299,826	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	19,391,111	19,391,111	-
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	-
資産計	66,383,807	66,383,807	-
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	-
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	-
負債計	3,791,158	3,791,158	-

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

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(2019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	-	-

当事業年度(2020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	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

(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(2019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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)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(2019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。

当事業年度(2020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	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(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	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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
---------	-------	--------

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,578,762	289,451	13,668

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
3,631,425	6,398	129,006

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,319,830	3,418,601
勤務費用	267,362	523,396
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	3,658	195
退職給付の支払額	85,082	349,050
過去勤務費用の発生額	79,850	-
合併による発生額	-	1,707,062
退職給付債務の期末残高	3,418,601	5,299,814

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
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	3,418,601	5,299,814

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842

確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158
-----------------	---------	---------

(注) 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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020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156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(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原因別の内訳

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,046,775	1,622,803
賞与引当金	400,242	530,059
調査費	80,983	178,573
未払金	57,192	162,557
未払事業税	54,797	46,423
ソフトウェア償却	17,501	91,937
子会社株式評価損	50,580	114,876
その他有価証券評価差額金	-	150,771
その他	32,218	88,250
繰延税金資産小計	1,740,292	2,986,254
評価性引当額(注)	51,729	193,485
繰延税金資産合計	1,688,563	2,792,768
繰延税金負債		
無形固定資産	-	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産(負債)の純額	1,426,381	2,963,538

(注) 評価性引当額が141,756千円増加しております。この増加の内容は、主として大和住銀投信投資顧問株式会社との合併によるものであります。

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 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1

その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020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	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(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

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。

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。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	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)

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

(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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09円

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
 2. 当社は、2018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。
 1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、
 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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
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)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018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、2019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

2019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 2019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 2019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. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31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

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

(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。

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

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	第46期 （平成30年3月31日）	第47期 （平成31年3月31日）
資産の部		

流動資産			
現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

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

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605
当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650

注記事項

（重要な会計方針）

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

(追加情報)

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

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

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

第47期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位：千円)

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

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

第47期（平成31年3月31日）

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

2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自平成30年4月1日 至平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

(3) 退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

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

該当ありません。

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(2020年3月末現在)

(ハ) 事業の内容

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社*
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2020年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

資本金の額は、2020年3月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(1)「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

(2)委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

(3)委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。

(4)請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

(5)目論見書の使用開始日を記載することがあります。

(6)投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきであることを記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
 - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
 - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
 - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
 - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月15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

東京事務所

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**監査意見**

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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。

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の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

2020年5月26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

東京事務所

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 松井 貴志 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)の2019年4月16日から2020年4月13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。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)の2020年4月13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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。