

【表紙】

| | |
|------------|-------------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2020年7月21日提出 |
| 【計算期間】 | 第1期(自 2020年1月24日至 2020年4月27日) |
| 【ファンド名】 | 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 |
| 【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 |
| 【連絡場所】 | 東京都港区虎ノ門一丁目17番1号 |
| 【電話番号】 | 03-6205-1649 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

| 項目 | 該当する商品分類 | 内容 |
|-------------------|----------|---|
| 単位型・追加型 | 追加型投信 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。 |
| 投資対象地域 | 内外 | 目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
| 投資対象資産 (収益の源泉) | 資産複合 | 目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2020年1月24日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

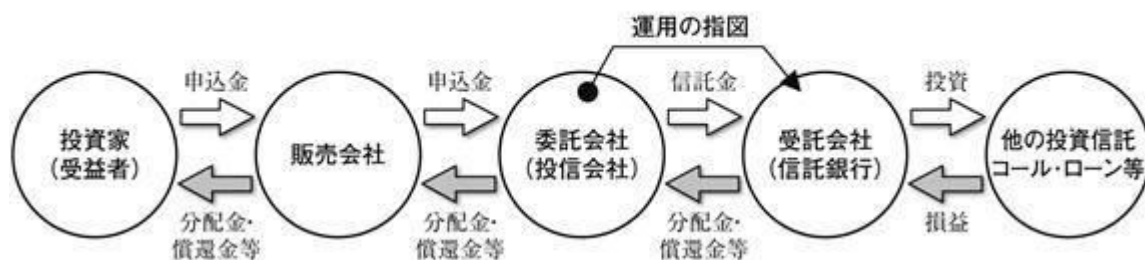
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

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

(ハ) 販売会社

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

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2020年5月29日現在)

(ロ) 会社の沿革

| | |
|------------|--|
| 1985年7月15日 | 三生投資顧問株式会社設立 |
| 1987年2月20日 | 証券投資顧問業の登録 |
| 1987年6月10日 | 投資一任契約にかかる業務の認可 |
| 1999年1月1日 | 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合 |
| 1999年2月5日 | 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更 |
| 2000年1月27日 | 証券投資信託委託業の認可取得 |

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

(八) 大株主の状況

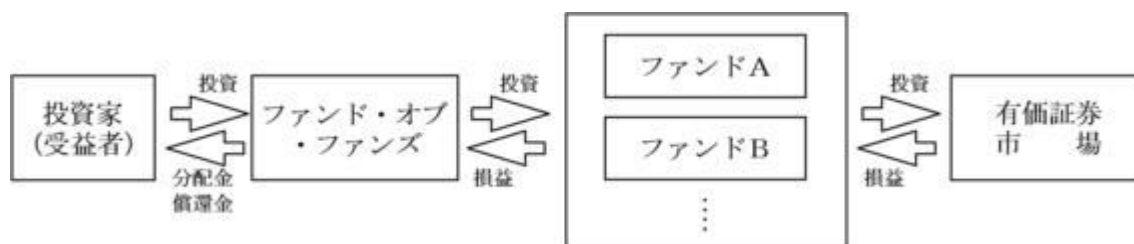
(2020年5月29日現在)

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

八 ファンドの運用形態(ファンド・オブ・ファンズによる運用)

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

「(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、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託(リート)に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託(リート)に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
- ・主として、国内株式、先進国株式(除く日本)、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券(除く日本)、新興国債券の8つの資産に投資します。
 - ・基本資産配分は、西暦2060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収益性を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い安定性を重視します。
 - ・ターゲットイヤー到達後は、信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
 - ・基本資産配分の調整は原則として年1回の決算時に行います。
 - ・家計調査のデータや各資産の期待収益率等を勘案し、ターゲットイヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率となるように、一定期間毎に検証を行い、基本資産配分を必要に応じて見直します。
 - ・基本資産配分における資産は、将来の市場構造等の変化によって見直される場合があります。
- (ロ) 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、資産毎に必要に応じて調整を行うものとします。
- (ハ) 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。
- (ニ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

■投資対象とする投資信託の投資方針等

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶株式

国内株式

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> •有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 •その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08% |

先進国株式（除く日本）

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 外国株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> •主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 •外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> •有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 •その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

新興国株式

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | エマージング株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> •主として新興国の株式、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券等に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 •外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> •有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 •その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

▶ 債券

国内債券

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 国内債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ● 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ● その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03% |

先進国債券（除く日本）

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | 外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ● 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ● その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

新興国債券

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託(米ドル建て) |
| 運用会社 | ザ・バンガード・グループ・インク |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・パークレイズ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 管理報酬等*1 | 年0.25%程度 |
| 購入の可否*2 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |
| ファンド名 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託(米ドル建て) |
| 運用会社 | ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 管理報酬等*1 | 年0.39%程度 |
| 購入の可否*2 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

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

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

▶ リート

国内リート

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | Jリート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

外国リート

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 外国リート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)などを主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

▶ 短期金融資産

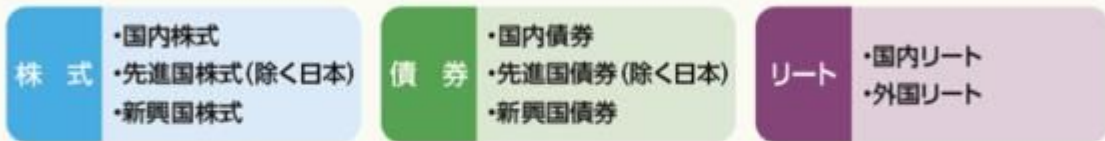
| | |
|---------|---|
| ファンド名 | マネープール・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主として、円貨建ての短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 |

ファンドの特色

1

世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資します。

□以下の8つの資産に投資します。



2

ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど収益性を重視した運用を行い、ターゲットイヤーに近づくにしたい信託財産の安定性を重視した運用を行います。
ターゲットイヤー到達後は、信託財産の安定的な成長を目指した運用を行います。

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

□ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



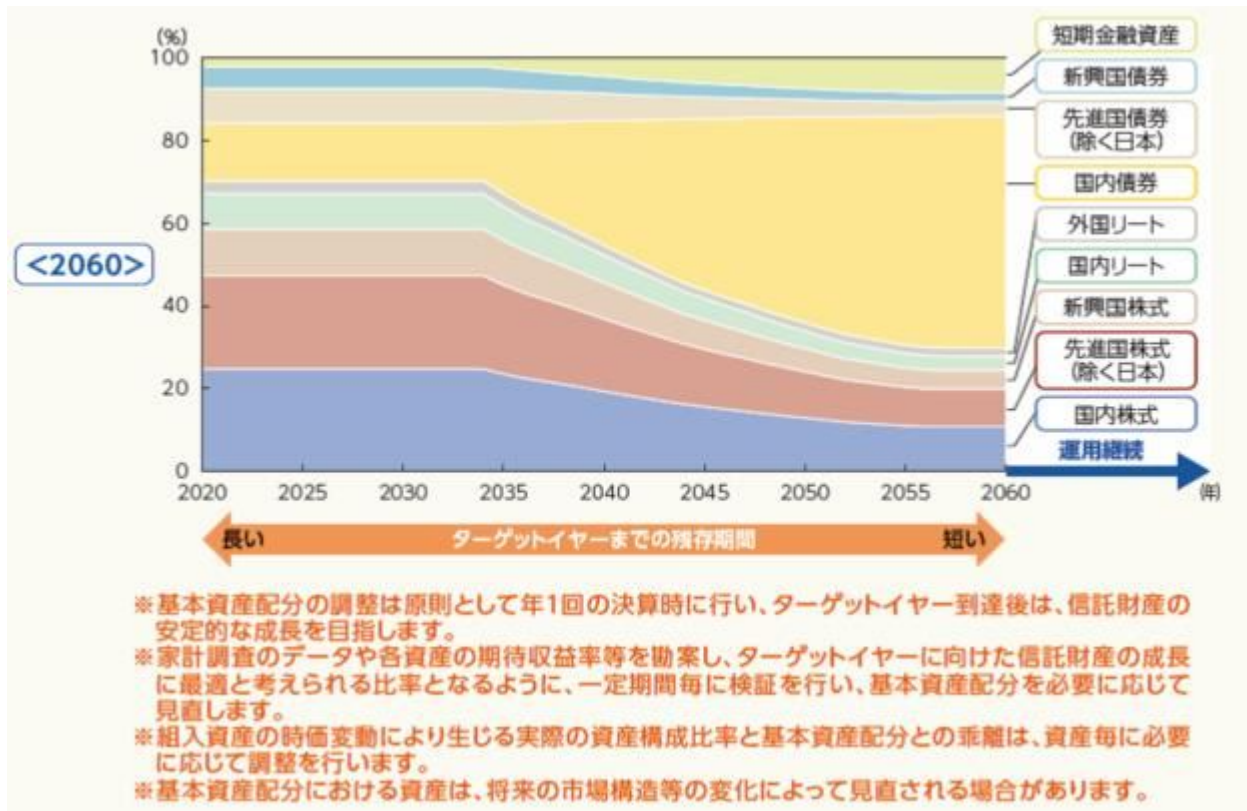
※販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

基本資産配分

基本資産配分（設定当初）

| | 国内株式 | 先進国株式 (除く日本) | 新興国株式 | 国内リート | 外国リート | 国内債券 | 先進国債券 (除く日本) | 新興国債券 | 短期 金融資産 |
|--------|-------|-----------------|-------|-------|-------|-------|-----------------|-------|------------|
| <2060> | 24.8% | 22.5% | 11.2% | 8.6% | 3.1% | 14.0% | 8.4% | 5.3% | 2.1% |

基本資産配分のイメージ



（２）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．約束手形
- 3．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。））ならびに投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。））または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有す

るも の

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

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

八 投資対象とする金融商品

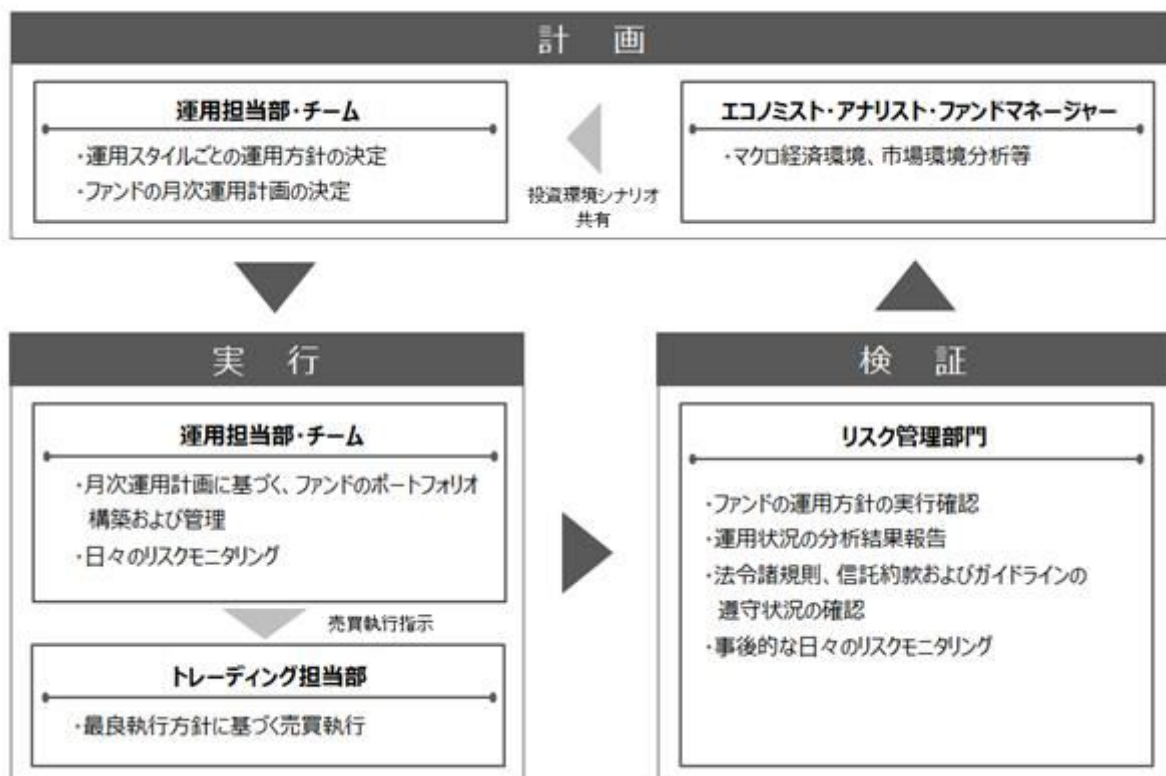
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

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

(4)【分配方針】

年1回(原則として毎年4月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日)決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

(5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 公社債の借入れの指図
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図をするものとします。
 - (ロ) 公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
 - (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。
- ト 外国為替予約取引の指図
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産(投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- チ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

(ニ) 信用リスク

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

(ホ) 為替変動リスク

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

(ヘ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ト) 市場流動性リスク

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 換金制限等に関する留意点

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

とがあります。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 〕

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

〔 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。

■<2060>

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2020年1月～2020年5月



ファンド：
該当事項はありません

他の資産クラス：
2015年6月～2020年5月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、ファンドの騰落率はありません。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

| | | | | | |
|-----------------|--|---|---------|--------|--------|
| ファンド | 純資産総額に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。 | | | | |
| | | 信託報酬率 | 配分（税抜き） | | |
| | | | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
| | 2036年の 決算日まで | 年0.396% （税抜き 0.36%） | 年0.17% | 年0.16% | 年0.03% |
| | 2036年の 決算翌日以降 2061年の 決算日まで | 年0.374% （税抜き 0.34%） | 年0.16% | 年0.15% | 年0.03% |
| | 2061年の 決算翌日以降 | 年0.33% （税抜き 0.30%） | 年0.14% | 年0.13% | 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 | | | | |
| 投資対象とする 投資信託 | 年0.02067%程度* 管理報酬等は年度によって異なります。 | | | | |
| 実質的な負担 | ファンドの純資産総額に対して年0.41667%（税抜き0.38067%）程度* 2036年の決算日までの、ファンドの信託報酬率で計算した料率です。 | | | | |

上記は直近の基本資産配分および管理報酬等の率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の調整および実際の組入状況等により変動します。

新興国債券の費用は、管理報酬等の率がより高いETFの数値を用いて試算しています。

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

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0066%（税抜き0.006%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担する

こととなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記（１）～（４）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

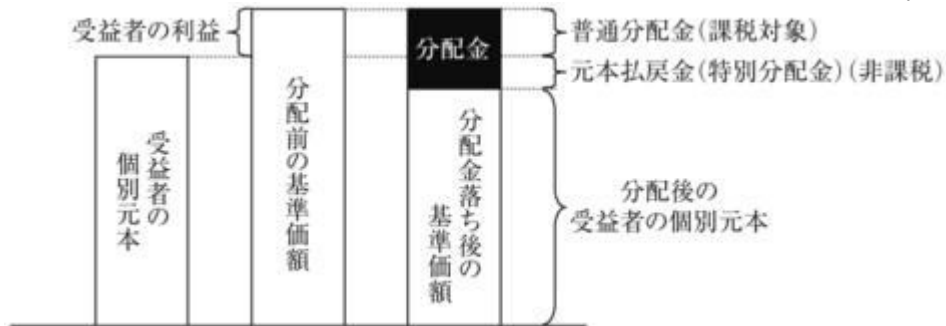
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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5月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

2020年5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-------------|-------------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 1,436,712 | 5.30 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 25,443,176 | 93.77 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 252,445 | 0.93 |
| 合計(純資産総額) | | 27,132,333 | 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DS・DCターゲットイヤーファンド2060

イ 主要投資銘柄

2020年5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|-----------|------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 2,752,764 | 2.3433 | 6,450,551 | 2.5313 | 6,968,071 | 25.68 |
| 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 | 1,731,112 | 3.3337 | 5,771,009 | 3.6029 | 6,237,023 | 22.99 |
| 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 | 2,804,988 | 1.2883 | 3,613,724 | 1.2834 | 3,599,921 | 13.27 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 2,548,148 | 1.1143 | 2,839,401 | 1.1680 | 2,976,236 | 10.97 |

| | | | | | | | | |
|------|-----------|--|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | Jリート・インデックス・マザーファンド | 1,159,286 | 1.9571 | 2,268,838 | 2.1102 | 2,446,325 | 9.02 |
| 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 | 1,121,849 | 1.8376 | 2,061,509 | 1.8576 | 2,083,946 | 7.68 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 126 | 10,532.55 | 1,327,102 | 11,402.47 | 1,436,712 | 5.30 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 450,246 | 1.6524 | 743,986 | 1.7807 | 801,753 | 2.95 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | マネーパブル・マザーファンド | 329,342 | 1.0017 | 329,901 | 1.0017 | 329,901 | 1.22 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5.30 |
| 親投資信託受益証券 | 93.77 |
| 合計 | 99.07 |

【投資不動産物件】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

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DS・DCターゲットイヤーファンド2060

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DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| 年月日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たりの 純資産額(円) | |
|-------------------|--------------|------------|--------------------|-------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第1期 (2020年 4月27日) | 25,658,045 | 25,658,045 | 8,553 | 8,553 |
| 2020年 1月末日 | 29,493,886 | | 9,831 | |
| 2月末日 | 27,870,039 | | 9,290 | |
| 3月末日 | 25,043,151 | | 8,348 | |
| 4月末日 | 26,122,454 | | 8,707 | |
| 5月末日 | 27,132,333 | | 9,044 | |

【分配の推移】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金(円) |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2020年 1月24日～2020年 4月27日 | 0 |

【収益率の推移】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| | 収益率(%) |
|-----|--------|
| 第1期 | 14.5 |

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| | 設定口数(口) | 解約口数(口) |
|-----|------------|---------|
| 第1期 | 30,000,000 | 0 |

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 株式 | 日本 | 162,942,854,240 | 97.80 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,671,303,632 | 2.20 |
| 合計(純資産総額) | | 166,614,157,872 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|----------|-----------|------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 2,634,710,000 | 1.58 |
| 合計 | 買建 | | 2,634,710,000 | 1.58 |

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|-------------|-----------------|-------------|
| 株式 | アメリカ | 137,763,354,459 | 64.86 |
| | イギリス | 9,826,237,048 | 4.63 |
| | スイス | 7,753,093,957 | 3.65 |
| | カナダ | 7,076,716,403 | 3.33 |
| | フランス | 6,941,251,314 | 3.27 |
| | ドイツ | 6,120,821,623 | 2.88 |
| | オーストラリア | 3,969,734,444 | 1.87 |
| | アイルランド | 3,743,198,877 | 1.76 |
| | オランダ | 3,738,899,804 | 1.76 |
| | スウェーデン | 1,876,100,009 | 0.88 |
| | スペイン | 1,743,070,198 | 0.82 |
| | 香港 | 1,685,024,503 | 0.79 |
| | デンマーク | 1,593,790,278 | 0.75 |
| | イタリア | 1,202,361,634 | 0.57 |
| | フィンランド | 865,507,085 | 0.41 |
| | シンガポール | 712,913,690 | 0.34 |
| バミューダ | 673,093,350 | 0.32 | |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------------|--------|
| | ジャージー | 623,606,846 | 0.29 |
| | ベルギー | 599,672,340 | 0.28 |
| | イスラエル | 452,391,827 | 0.21 |
| | ノルウェー | 391,670,075 | 0.18 |
| | ケイマン諸島 | 365,286,776 | 0.17 |
| | ニュージーランド | 218,815,131 | 0.10 |
| | ルクセンブルグ | 170,978,345 | 0.08 |
| | キュラソー | 148,392,772 | 0.07 |
| | オーストリア | 125,312,272 | 0.06 |
| | ポルトガル | 124,093,024 | 0.06 |
| | リベリア | 50,233,844 | 0.02 |
| | マン島 | 25,745,889 | 0.01 |
| | パプアニューギニア | 17,271,366 | 0.01 |
| | 英ヴァージン諸島 | 10,964,698 | 0.01 |
| | 小計 | 200,609,603,881 | 94.45 |
| 投資証券 | アメリカ | 3,912,161,316 | 1.84 |
| | オーストラリア | 540,155,606 | 0.25 |
| | フランス | 124,967,622 | 0.06 |
| | 香港 | 117,919,966 | 0.06 |
| | イギリス | 116,092,485 | 0.05 |
| | シンガポール | 95,786,612 | 0.05 |
| | カナダ | 41,846,422 | 0.02 |
| | 小計 | 4,948,930,029 | 2.33 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 6,841,800,458 | 3.22 |
| 合計(純資産総額) | | 212,400,334,368 | 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 | 5,128,984,220 | 2.41 |
| | 買建 | ドイツ | 1,130,834,377 | 0.53 |
| | 買建 | イギリス | 338,195,355 | 0.15 |
| | 買建 | オーストラリア | 261,141,000 | 0.12 |
| 合計 | 買建 | | 6,859,154,952 | 3.21 |

| 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 | | 1,182,151,100 | 0.55 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|--------|-----------|-------------|-------------|
| 株式 | ケイマン諸島 | 945,439,365 | 13.64 |
| | 台湾 | 543,641,572 | 7.84 |
| | 韓国 | 527,887,963 | 7.62 |
| | 中国 | 357,607,579 | 5.16 |
| | インド | 354,187,499 | 5.11 |
| | ブラジル | 219,294,031 | 3.16 |
| | 南アフリカ | 168,790,928 | 2.43 |
| | 香港 | 161,269,729 | 2.33 |
| | タイ | 105,059,504 | 1.52 |
| | メキシコ | 83,850,768 | 1.21 |
| | マレーシア | 82,826,975 | 1.19 |
| | インドネシア | 68,693,770 | 0.99 |
| | フィリピン | 34,986,229 | 0.50 |
| | バミューダ | 34,913,341 | 0.50 |
| | ポーランド | 34,618,127 | 0.50 |
| | チリ | 26,906,544 | 0.39 |
| | トルコ | 19,013,688 | 0.27 |
| | アメリカ | 15,862,261 | 0.23 |
| | ハンガリー | 11,103,378 | 0.16 |
| | コロンビア | 10,076,223 | 0.15 |
| | ギリシャ | 9,422,862 | 0.14 |
| | ルクセンブルグ | 5,815,001 | 0.08 |
| エジプト | 5,528,397 | 0.08 | |
| チェコ | 5,023,139 | 0.07 | |
| アルゼンチン | 2,821,058 | 0.04 | |

| | | | |
|---------------------|--------|---------------|--------|
| | マン島 | 1,665,230 | 0.02 |
| | ペルー | 1,616,106 | 0.02 |
| | シンガポール | 1,216,191 | 0.02 |
| | ベルギー | 493,389 | 0.01 |
| | 小計 | 3,839,630,847 | 55.39 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 230,064,566 | 3.32 |
| | 香港 | 198,997,500 | 2.87 |
| | 小計 | 429,062,066 | 6.19 |
| 投資証券 | アメリカ | 115,821,085 | 1.67 |
| | ブラジル | 5,899,482 | 0.09 |
| | 南アフリカ | 3,179,544 | 0.05 |
| | メキシコ | 1,957,179 | 0.03 |
| | 小計 | 126,857,290 | 1.83 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2,536,333,510 | 36.59 |
| 合計(純資産総額) | | 6,931,883,713 | 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 | 2,554,705,267 | 36.85 |
| 合計 | 買建 | | 2,554,705,267 | 36.85 |

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----------|------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 2,585,477,089 | 37.29 |
| | 売建 | | 1,595,250,462 | 23.01 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|------|---------------|-------------|
| 投資証券 | 日本 | 4,396,017,480 | 97.85 |

| | | | |
|---------------------|--|---------------|--------|
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 96,484,288 | 2.15 |
| 合計(純資産総額) | | 4,492,501,768 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|------------|-----------|------|------------|-----------------|
| REIT指数先物取引 | 買建 | 日本 | 68,040,000 | 1.51 |
| 合計 | 買建 | | 68,040,000 | 1.51 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|----------|---------------|-------------|
| 投資証券 | アメリカ | 5,067,794,708 | 75.90 |
| | オーストラリア | 431,026,062 | 6.46 |
| | イギリス | 342,240,641 | 5.13 |
| | シンガポール | 277,820,820 | 4.16 |
| | フランス | 154,871,238 | 2.32 |
| | カナダ | 125,530,161 | 1.88 |
| | 香港 | 110,121,974 | 1.65 |
| | ベルギー | 90,147,902 | 1.35 |
| | スペイン | 30,247,240 | 0.45 |
| | ニュージーランド | 26,569,298 | 0.40 |
| | ドイツ | 18,805,052 | 0.28 |
| | オランダ | 14,614,844 | 0.22 |
| | ガーンジー | 12,461,601 | 0.19 |
| | アイルランド | 6,474,732 | 0.10 |
| | イスラエル | 3,712,380 | 0.06 |
| | イタリア | 1,319,484 | 0.02 |
| | 韓国 | 1,096,504 | 0.02 |
| | マン島 | 765,281 | 0.01 |
| 小計 | | 6,715,619,922 | 100.59 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 39,120,757 | 0.59 |

| | | |
|-----------|---------------|--------|
| 合計(純資産総額) | 6,676,499,165 | 100.00 |
|-----------|---------------|--------|

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建/ 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----------|------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 148,775,604 | 2.22 |

国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|---------|-----------------|-------------|
| 国債証券 | 日本 | 111,410,426,650 | 80.20 |
| 地方債証券 | 日本 | 8,497,135,505 | 6.12 |
| 特殊債券 | 日本 | 13,019,040,048 | 9.37 |
| 社債券 | 日本 | 4,972,351,000 | 3.58 |
| | オーストラリア | 199,988,000 | 0.14 |
| | フランス | 198,942,000 | 0.14 |
| | 小計 | 5,371,281,000 | 3.87 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 613,578,657 | 0.44 |
| 合計(純資産総額) | | 138,911,461,860 | 100.00 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|---------|----------------|-------------|
| 国債証券 | アメリカ | 71,524,372,147 | 45.08 |
| | フランス | 15,555,770,138 | 9.80 |
| | イタリア | 14,390,631,262 | 9.07 |
| | イギリス | 10,329,526,852 | 6.51 |
| | ドイツ | 10,319,263,789 | 6.50 |
| | スペイン | 9,248,903,318 | 5.83 |
| | ベルギー | 4,180,937,574 | 2.64 |
| | オーストラリア | 3,210,510,577 | 2.02 |
| | カナダ | 3,018,389,677 | 1.90 |

| | | | |
|--|---------------------|-----------------|--------|
| | オランダ | 2,866,795,310 | 1.81 |
| | オーストリア | 2,487,673,791 | 1.57 |
| | メキシコ | 1,218,145,998 | 0.77 |
| | アイルランド | 1,155,583,277 | 0.73 |
| | フィンランド | 1,123,788,315 | 0.71 |
| | ポーランド | 916,626,443 | 0.58 |
| | デンマーク | 778,109,186 | 0.49 |
| | マレーシア | 748,008,185 | 0.47 |
| | シンガポール | 741,249,823 | 0.47 |
| | イスラエル | 601,406,822 | 0.38 |
| | スウェーデン | 428,095,913 | 0.27 |
| | ノルウェー | 367,920,851 | 0.23 |
| | 小計 | 155,211,709,248 | 97.83 |
| | 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 3,447,844,591 | 2.17 |
| | 合計(純資産総額) | 158,659,553,839 | 100.00 |

マネープール・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 国債証券 | 日本 | 20,004,780,000 | 5.64 |
| 地方債証券 | 日本 | 86,195,626,072 | 24.32 |
| 特殊債券 | 日本 | 30,630,217,366 | 8.64 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 217,601,582,756 | 61.40 |
| 合計(純資産総額) | | 354,432,206,194 | 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 5月29日現在

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

| | | | | | | | | | |
|----|----|-------------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 827,800 | 7,616.65 | 6,305,062,870 | 6,755.00 | 5,591,789,000 | 3.36 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 464,700 | 6,910.82 | 3,211,458,054 | 6,874.00 | 3,194,347,800 | 1.92 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 67,200 | 37,389.92 | 2,512,602,624 | 44,350.00 | 2,980,320,000 | 1.79 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 577,600 | 4,194.04 | 2,422,477,504 | 4,832.00 | 2,790,963,200 | 1.68 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 617,000 | 4,382.59 | 2,704,058,030 | 4,191.00 | 2,585,847,000 | 1.55 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 973,100 | 2,759.77 | 2,685,532,187 | 2,444.00 | 2,378,256,400 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 5,002,300 | 567.18 | 2,837,204,514 | 444.20 | 2,222,021,660 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 212,200 | 6,917.79 | 1,467,955,038 | 10,085.00 | 2,140,037,000 | 1.28 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 45,500 | 42,552.05 | 1,936,118,275 | 43,540.00 | 1,981,070,000 | 1.19 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 507,500 | 3,893.95 | 1,976,179,625 | 3,710.00 | 1,882,825,000 | 1.13 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 542,300 | 3,130.49 | 1,697,664,727 | 3,136.00 | 1,700,652,800 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 583,400 | 3,039.99 | 1,773,530,166 | 2,784.00 | 1,624,185,600 | 0.97 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 506,200 | 3,900.29 | 1,974,326,798 | 3,119.00 | 1,578,837,800 | 0.95 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 124,600 | 11,724.26 | 1,460,842,796 | 12,620.00 | 1,572,452,000 | 0.94 |
| 日本 | 株式 | NTTドコモ | 情報・通信業 | 520,400 | 3,002.23 | 1,562,360,492 | 2,951.50 | 1,535,960,600 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 177,600 | 8,620.47 | 1,530,995,472 | 8,647.00 | 1,535,707,200 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 148,200 | 9,921.26 | 1,470,330,732 | 10,110.00 | 1,498,302,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 94,400 | 15,495.93 | 1,462,815,792 | 15,850.00 | 1,496,240,000 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 70,500 | 20,666.30 | 1,456,974,150 | 19,215.00 | 1,354,657,500 | 0.81 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 9,940,200 | 165.27 | 1,642,816,854 | 134.50 | 1,336,956,900 | 0.80 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 217,700 | 6,400.97 | 1,393,491,169 | 6,015.00 | 1,309,465,500 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 512,900 | 2,858.43 | 1,466,088,747 | 2,515.00 | 1,289,943,500 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | S M C | 機械 | 23,300 | 49,085.02 | 1,143,680,966 | 54,370.00 | 1,266,821,000 | 0.76 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 356,300 | 4,196.59 | 1,495,245,017 | 3,455.00 | 1,231,016,500 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 642,200 | 1,867.22 | 1,199,128,684 | 1,914.50 | 1,229,491,900 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | 中外製薬 | 医薬品 | 77,200 | 9,896.73 | 764,027,556 | 15,890.00 | 1,226,708,000 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 258,700 | 5,896.04 | 1,525,305,548 | 4,668.00 | 1,207,611,600 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 178,600 | 7,961.78 | 1,421,973,908 | 6,622.00 | 1,182,689,200 | 0.71 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|-----------|-------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 509,900 | 2,408.42 | 1,228,053,358 | 2,310.00 | 1,177,869,000 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 75,400 | 14,988.93 | 1,130,165,322 | 15,615.00 | 1,177,371,000 | 0.71 |

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----------|---------|----------|-------------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.10 |
| | | 鉱業 | 0.21 |
| | | 建設業 | 2.56 |
| | | 食料品 | 3.90 |
| | | 繊維製品 | 0.51 |
| | | パルプ・紙 | 0.24 |
| | | 化学 | 7.11 |
| | | 医薬品 | 6.99 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.44 |
| | | ゴム製品 | 0.62 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.77 |
| | | 鉄鋼 | 0.56 |
| | | 非鉄金属 | 0.68 |
| | | 金属製品 | 0.53 |
| | | 機械 | 5.00 |
| | | 電気機器 | 14.21 |
| | | 輸送用機器 | 7.13 |
| | | 精密機器 | 2.56 |
| | | その他製品 | 2.33 |
| | | 電気・ガス業 | 1.56 |
| | | 陸運業 | 4.24 |
| | | 海運業 | 0.13 |
| | | 空運業 | 0.36 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.18 | | |
| 情報・通信業 | 9.33 | | |
| 卸売業 | 4.55 | | |
| 小売業 | 4.83 | | |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 銀行業 | 4.97 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.75 |
| | 保険業 | 2.02 |
| | その他金融業 | 1.12 |
| | 不動産業 | 2.07 |
| | サービス業 | 5.26 |
| 合計 | | 97.80 |

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 5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 投資比率(%) |
|------|----|------------------------------|------------------------|---------|------------|---------------|------------|---------------|---------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 228,505 | 28,608.35 | 6,537,152,502 | 34,221.42 | 7,819,766,148 | 3.68 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 372,892 | 16,268.21 | 6,066,286,743 | 19,505.94 | 7,273,609,724 | 3.42 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 21,665 | 194,100.25 | 4,205,181,968 | 258,190.28 | 5,593,692,481 | 2.63 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | メディア・娯楽 | 124,019 | 21,332.87 | 2,645,682,036 | 24,243.71 | 3,006,681,142 | 1.42 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 15,938 | 138,812.62 | 2,212,395,659 | 152,340.97 | 2,428,010,490 | 1.14 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 15,446 | 138,673.91 | 2,141,957,274 | 152,503.34 | 2,355,566,701 | 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 | 14,693.97 | 1,993,222,946 | 15,803.68 | 2,143,753,944 | 1.01 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC | ソフトウェア・サービス | 88,048 | 19,610.24 | 1,726,642,949 | 20,888.77 | 1,839,215,108 | 0.87 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 153,361 | 11,497.71 | 1,763,300,610 | 11,468.71 | 1,758,853,877 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 161,245 | 13,792.87 | 2,224,031,823 | 10,737.94 | 1,731,440,071 | 0.82 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 128,483 | 12,979.94 | 1,667,702,440 | 12,479.93 | 1,603,459,077 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 48,895 | 29,754.62 | 1,454,852,453 | 32,685.89 | 1,598,176,792 | 0.75 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 46,151 | 30,989.07 | 1,430,176,602 | 32,506.31 | 1,500,199,128 | 0.71 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 223,631 | 6,180.82 | 1,382,223,941 | 6,634.60 | 1,483,702,456 | 0.70 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 56,079 | 23,425.41 | 1,313,673,596 | 26,359.90 | 1,478,237,068 | 0.70 |
| 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 | 34,183.11 | 1,233,463,356 | 38,056.20 | 1,373,219,921 | 0.65 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 67,565 | 23,325.40 | 1,575,981,165 | 19,903.80 | 1,344,800,450 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 電気通信サービス | 213,529 | 6,399.11 | 1,366,395,623 | 5,991.57 | 1,279,374,292 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 375,942 | 3,952.80 | 1,486,024,591 | 3,339.88 | 1,255,601,844 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 440,243 | 3,467.84 | 1,526,693,386 | 2,673.19 | 1,176,855,739 | 0.55 |
| 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 | 4,066.78 | 1,162,937,725 | 4,105.49 | 1,174,007,465 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO. | メディア・娯楽 | 92,661 | 15,813.36 | 1,465,281,917 | 12,554.12 | 1,163,278,008 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 131,546 | 9,241.12 | 1,215,633,451 | 8,499.17 | 1,118,031,975 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 29,890 | 23,577.02 | 704,717,361 | 36,504.28 | 1,091,113,061 | 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 | 4,796.91 | 1,046,173,212 | 4,902.83 | 1,069,272,979 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 210,391 | 5,651.77 | 1,189,082,973 | 5,063.58 | 1,065,333,280 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORPORATION | エネルギー | 217,519 | 7,049.66 | 1,533,436,473 | 4,843.15 | 1,053,477,406 | 0.50 |
| スイス | 株式 | NOVARTIS AG-REG SHS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 110,441 | 10,072.48 | 1,112,415,470 | 9,298.53 | 1,026,939,791 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 食品・飲料・タバコ | 72,083 | 14,446.65 | 1,041,358,268 | 14,225.14 | 1,025,391,033 | 0.48 |
| アメリカ | 株式 | ADOBE INC | ソフトウェア・サービス | 24,886 | 33,228.92 | 826,934,918 | 40,843.11 | 1,016,421,882 | 0.48 |

□ 種別・業種別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|---------|-------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 3.61 |
| | | 素材 | 4.08 |
| | | 資本財 | 6.01 |
| | | 商業・専門サービス | 1.21 |
| | | 運輸 | 1.72 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.06 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.76 |
| | | 消費者サービス | 1.50 |
| | | メディア・娯楽 | 6.46 |
| | | 小売 | 5.61 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.54 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 4.59 |

| | | |
|------|------------------------|-------|
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 2.10 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 5.26 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.87 |
| | 銀行 | 5.57 |
| | 各種金融 | 4.17 |
| | 保険 | 3.07 |
| | 不動産 | 0.71 |
| | ソフトウェア・サービス | 11.17 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.19 |
| | 電気通信サービス | 2.13 |
| | 公益事業 | 3.48 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 3.60 |
| 投資証券 | | 2.33 |
| 合計 | | 96.78 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|--------------|---|--------------------------------|---------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------------|
| ケイマン 諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR | 小売 | 13,616 | 21,559.89 | 293,559,505 | 21,451.15 | 292,078,991 | 4.21 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LIMITED | メディア・ 娯楽 | 45,000 | 4,673.98 | 210,329,355 | 5,661.73 | 254,778,030 | 3.68 |
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 半導体・半 導体製造装 置 | 193,000 | 1,095.00 | 211,335,534 | 1,052.52 | 203,136,360 | 2.93 |
| 香港 | 投資信託受 益証券 | CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF | | 338,000 | 589.75 | 199,337,637 | 588.75 | 198,997,500 | 2.87 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロ ジー・ハ ードウェア および機器 | 37,472 | 4,408.49 | 165,195,129 | 4,379.76 | 164,118,367 | 2.37 |
| アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | | 43,987 | 4,440.98 | 195,345,784 | 3,699.03 | 162,709,321 | 2.35 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | | 41,158 | 3,139.87 | 129,231,016 | 2,814.06 | 115,821,085 | 1.67 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 756,000 | 86.64 | 65,504,544 | 85.71 | 64,801,750 | 0.93 |
| 南アフリ カ | 株式 | NASPERS LIMITED-N SHS | 小売 | 3,498 | 13,140.89 | 45,966,848 | 17,987.63 | 62,920,734 | 0.91 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | エネルギー | 22,471 | 2,180.41 | 48,996,159 | 2,105.31 | 47,308,590 | 0.68 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT | 保険 | 44,000 | 1,230.18 | 54,128,053 | 1,061.05 | 46,686,420 | 0.67 |
| アメリカ | 投資信託受 益証券 | ISHARES MSCI QATAR ETF | | 24,355 | 1,876.39 | 45,699,685 | 1,722.50 | 41,951,525 | 0.61 |
| 香港 | 株式 | CHINA MOBILE LTD | 電気通信 サービス | 48,500 | 822.92 | 39,912,075 | 750.36 | 36,392,800 | 0.53 |
| 中国 | 株式 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA | 銀行 | 513,000 | 77.28 | 39,649,044 | 69.76 | 35,790,009 | 0.52 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | JD.COM INC-ADR | 小売 | 5,781 | 3,557.37 | 20,565,213 | 5,486.18 | 31,715,610 | 0.46 |

| | | | | | | | | | |
|--------|----------|---|--------------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 韓国 | 株式 | HYNIX SEMICONDUCTOR INC | 半導体・半導体製造装置 | 4,308 | 7,108.57 | 30,623,742 | 7,290.90 | 31,409,240 | 0.45 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION | 銀行 | 12,937 | 3,284.14 | 42,487,007 | 2,321.89 | 30,038,304 | 0.43 |
| インド | 株式 | INFOSYS LIMITED | ソフトウェア・サービス | 26,905 | 1,004.87 | 27,036,061 | 1,011.58 | 27,216,614 | 0.39 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 97,800 | 315.08 | 30,815,011 | 269.57 | 26,364,337 | 0.38 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 25,000 | 985.41 | 24,635,265 | 995.28 | 24,882,207 | 0.36 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD | 銀行 | 628,000 | 43.58 | 27,369,913 | 39.52 | 24,824,526 | 0.36 |
| ケイマン諸島 | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | メディア・娯楽 | 2,151 | 12,754.61 | 27,435,181 | 11,432.58 | 24,591,500 | 0.35 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6,448 | 3,588.87 | 23,141,056 | 3,780.14 | 24,374,407 | 0.35 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | ISHARES MSCI UAE ETF | | 22,076 | 1,455.95 | 32,141,688 | 1,097.88 | 24,236,827 | 0.35 |
| 韓国 | 株式 | NAVER CORPORATION | メディア・娯楽 | 1,113 | 15,015.14 | 16,711,853 | 20,899.45 | 23,261,088 | 0.34 |
| ケイマン諸島 | 株式 | NETEASE.COM INC -ADR | メディア・娯楽 | 557 | 33,951.29 | 18,910,870 | 39,382.86 | 21,936,254 | 0.32 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVS LTD | ソフトウェア・サービス | 7,057 | 2,941.25 | 20,756,467 | 2,866.14 | 20,226,413 | 0.29 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INCORPORATION | 半導体・半導体製造装置 | 12,000 | 1,490.94 | 17,891,336 | 1,646.80 | 19,761,600 | 0.29 |
| メキシコ | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE C.V. | 電気通信サービス | 266,500 | 72.81 | 19,405,249 | 72.98 | 19,451,089 | 0.28 |
| インド | 株式 | HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 家庭用品・パーソナル用品 | 6,440 | 3,007.24 | 19,366,662 | 2,874.22 | 18,510,032 | 0.27 |

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|---------|--------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 2.60 |
| | | 素材 | 3.39 |
| | | 資本財 | 1.62 |
| | | 商業・専門サービス | 0.17 |
| | | 運輸 | 0.94 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.15 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 0.76 |
| | | 消費者サービス | 0.90 |
| | | メディア・娯楽 | 5.54 |
| | | 小売 | 6.87 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 0.92 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 1.85 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.81 |

| | | |
|----------|------------------------|-------|
| | ヘルスケア機器・サービス | 0.66 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1.43 |
| | 銀行 | 7.24 |
| | 各種金融 | 1.09 |
| | 保険 | 2.03 |
| | 不動産 | 1.40 |
| | ソフトウェア・サービス | 1.13 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.93 |
| | 電気通信サービス | 2.34 |
| | 公益事業 | 1.39 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.22 |
| 投資信託受益証券 | | 6.19 |
| 投資証券 | | 1.83 |
| 合計 | | 63.41 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 5月29日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|------|--------------------|-------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 484 | 857,996.76 | 415,270,435 | 676,000 | 327,184,000 | 7.28 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 500 | 779,901.76 | 389,950,880 | 588,000 | 294,000,000 | 6.54 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 753 | 312,167.4 | 235,062,059 | 304,000 | 228,912,000 | 5.10 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 1,614 | 188,337.4 | 303,976,572 | 132,500 | 213,855,000 | 4.76 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 713 | 293,584.54 | 209,325,780 | 266,400 | 189,943,200 | 4.23 |
| 日本 | 投資証券 | G L P 投資法人 | 1,245 | 148,976.27 | 185,475,460 | 143,700 | 178,906,500 | 3.98 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 474 | 337,683.1 | 160,061,793 | 335,500 | 159,027,000 | 3.54 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 997 | 223,271.29 | 222,601,484 | 155,800 | 155,332,600 | 3.46 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 | 945 | 221,972.91 | 209,764,405 | 142,200 | 134,379,000 | 2.99 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,122 | 179,813.78 | 201,751,065 | 114,200 | 128,132,400 | 2.85 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 644 | 181,255.88 | 116,728,789 | 176,700 | 113,794,800 | 2.53 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 166 | 710,025.78 | 117,864,280 | 653,000 | 108,398,000 | 2.41 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 329 | 474,759.04 | 156,195,727 | 329,000 | 108,241,000 | 2.41 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 1,460 | 90,829.24 | 132,610,700 | 67,100 | 97,966,000 | 2.18 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 327 | 287,051.92 | 93,865,980 | 286,500 | 93,685,500 | 2.09 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 155 | 858,203.71 | 133,021,576 | 598,000 | 92,690,000 | 2.06 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 251 | 544,465.53 | 136,660,849 | 366,500 | 91,991,500 | 2.05 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 574 | 181,821.47 | 104,365,526 | 145,500 | 83,517,000 | 1.86 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 465 | 176,586.99 | 82,112,952 | 160,700 | 74,725,500 | 1.66 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 116 | 864,413.45 | 100,271,961 | 629,000 | 72,964,000 | 1.62 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1,612 | 64,817.35 | 104,485,579 | 44,850 | 72,298,200 | 1.61 |

| | | | | | | | | |
|----|------|-------------------------|-------|------------|-------------|---------|------------|------|
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 218 | 349,699.47 | 76,234,485 | 326,000 | 71,068,000 | 1.58 |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 142 | 510,284.29 | 72,460,370 | 469,000 | 66,598,000 | 1.48 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 178 | 428,043.81 | 76,191,799 | 350,000 | 62,300,000 | 1.39 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人 | 464 | 189,173.44 | 87,776,479 | 133,300 | 61,851,200 | 1.38 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 539 | 141,138.34 | 76,073,568 | 114,000 | 61,446,000 | 1.37 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人 | 162 | 498,009.38 | 80,677,521 | 378,500 | 61,317,000 | 1.36 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 610 | 108,034.77 | 65,901,214 | 98,900 | 60,329,000 | 1.34 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 2,191 | 47,530.41 | 104,139,139 | 27,280 | 59,770,480 | 1.33 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 327 | 205,005.48 | 67,036,794 | 181,300 | 59,285,100 | 1.32 |

ロ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.85 |
| 合計 | 97.85 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 投資比率(%) |
|---------|------|---------------------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|---------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 44,056 | 10,049.76 | 442,752,652 | 10,005.66 | 440,809,643 | 6.60 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 5,267 | 69,475.16 | 365,925,670 | 74,555.92 | 392,686,060 | 5.88 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 15,727 | 14,588.40 | 229,431,793 | 15,704.75 | 246,988,705 | 3.70 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 8,752 | 23,721.39 | 207,609,683 | 21,633.96 | 189,340,424 | 2.84 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 8,338 | 22,977.85 | 191,589,378 | 17,100.49 | 142,583,935 | 2.14 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 21,119 | 8,638.66 | 182,440,066 | 6,545.35 | 138,231,270 | 2.07 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 23,462 | 8,506.21 | 199,572,880 | 5,520.59 | 129,524,087 | 1.94 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORPORATION | 19,851 | 8,051.38 | 159,828,052 | 5,989.42 | 118,895,996 | 1.78 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 7,072 | 17,702.04 | 125,188,872 | 16,682.20 | 117,976,548 | 1.77 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 18,286 | 13,346.67 | 244,057,388 | 6,424.91 | 117,486,041 | 1.76 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,840 | 33,179.53 | 127,409,400 | 26,759.91 | 102,758,077 | 1.54 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 93,037 | 1,131.58 | 105,279,149 | 1,099.50 | 102,294,507 | 1.53 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 125,300 | 1,014.93 | 127,171,219 | 790.59 | 99,060,927 | 1.48 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 32,881 | 3,180.26 | 104,570,302 | 2,817.28 | 92,635,181 | 1.39 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 22,396 | 6,184.00 | 138,496,876 | 3,952.80 | 88,526,972 | 1.33 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC | 8,810 | 14,026.46 | 123,573,166 | 9,436.83 | 83,138,497 | 1.25 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 5,572 | 17,568.84 | 97,893,623 | 14,896.13 | 83,001,241 | 1.24 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 29,783 | 3,771.10 | 112,314,911 | 2,751.69 | 81,953,664 | 1.23 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 6,472 | 14,992.98 | 97,034,584 | 12,651.97 | 81,883,613 | 1.23 |
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 20,918 | 3,918.30 | 81,963,157 | 3,745.26 | 78,343,556 | 1.17 |

| | | | | | | | | |
|------|------|-----------------------------------|--------|-----------|-------------|-----------|------------|------|
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 7,380 | 11,404.84 | 84,167,723 | 10,454.06 | 77,151,012 | 1.16 |
| イギリス | 投資証券 | SEGR0 PLC | 65,522 | 1,162.78 | 76,187,814 | 1,123.85 | 73,637,188 | 1.10 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 17,705 | 5,185.51 | 91,809,491 | 4,134.52 | 73,201,827 | 1.10 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 10,684 | 7,893.98 | 84,339,317 | 6,720.62 | 71,803,158 | 1.08 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 10,415 | 8,960.24 | 93,320,905 | 6,696.96 | 69,748,926 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 31,463 | 2,448.74 | 77,044,836 | 1,951.66 | 61,405,377 | 0.92 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 5,904 | 12,130.41 | 71,617,954 | 9,951.90 | 58,756,026 | 0.88 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 28,078 | 2,743.74 | 77,038,735 | 2,083.93 | 58,512,626 | 0.88 |
| アメリカ | 投資証券 | CYRUSONE INC | 6,860 | 7,318.23 | 50,203,069 | 7,907.75 | 54,247,208 | 0.81 |
| フランス | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 8,585 | 12,251.12 | 105,175,933 | 6,075.63 | 52,159,284 | 0.78 |

ロ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 100.59 |
| 合計 | 100.59 |

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 5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|----------------|---------------|---------|---------------|----------|---------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 第143回利付国債(5年) | 2,630,000,000 | 101.12 | 2,659,537,700 | 101.11 | 2,659,193,000 | 0.100 | 2025/3/20 | 1.91 |
| 日本 | 国債証券 | 第142回利付国債(5年) | 2,090,000,000 | 101.10 | 2,113,052,700 | 101.07 | 2,112,488,400 | 0.100 | 2024/12/20 | 1.52 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 2,030,000,000 | 103.02 | 2,091,366,900 | 102.96 | 2,090,088,000 | 0.800 | 2023/6/20 | 1.50 |
| 日本 | 国債証券 | 第411回利付国債(2年) | 1,810,000,000 | 100.51 | 1,819,393,900 | 100.49 | 1,818,977,600 | 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 | 101.05 | 1,652,216,550 | 101.05 | 1,652,183,850 | 0.100 | 2029/12/20 | 1.19 |
| 日本 | 国債証券 | 第59回利付国債(20年) | 1,455,000,000 | 104.85 | 1,525,611,150 | 104.78 | 1,524,578,100 | 1.700 | 2022/12/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債(10年) | 1,285,000,000 | 103.23 | 1,326,621,150 | 103.18 | 1,325,965,800 | 0.800 | 2023/9/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 1,265,000,000 | 102.28 | 1,293,879,950 | 102.23 | 1,293,222,150 | 0.800 | 2022/9/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第61回利付国債(20年) | 1,215,000,000 | 103.34 | 1,255,581,000 | 103.27 | 1,254,815,550 | 1.000 | 2023/3/20 | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第343回利付国債(10年) | 1,110,000,000 | 101.43 | 1,125,950,700 | 101.37 | 1,125,229,200 | 0.100 | 2026/6/20 | 0.81 |
| 日本 | 国債証券 | 第69回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 108.65 | 1,108,301,400 | 108.57 | 1,107,495,600 | 2.100 | 2024/3/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第64回利付国債(20年) | 1,025,000,000 | 106.89 | 1,095,663,500 | 106.82 | 1,094,946,000 | 1.900 | 2023/9/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第65回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 107.39 | 1,095,439,200 | 107.32 | 1,094,694,600 | 1.900 | 2023/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第354回利付国債(10年) | 1,035,000,000 | 101.37 | 1,049,210,550 | 101.28 | 1,048,258,350 | 0.100 | 2029/3/20 | 0.75 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 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 | 101.36 | 1,013,620,000 | 101.34 | 1,013,490,000 | 1.200 | 2021/6/30 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第344回利付国債(10年) | 981,000,000 | 101.49 | 995,695,380 | 101.42 | 995,018,490 | 0.100 | 2026/9/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 980,000,000 | 101.61 | 995,827,000 | 101.53 | 995,013,600 | 0.100 | 2028/3/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第321回利付国債(10年) | 960,000,000 | 102.14 | 980,553,600 | 102.09 | 980,102,400 | 1.000 | 2022/3/20 | 0.71 |
| 日本 | 国債証券 | 第14回利付国債(30年) | 742,000,000 | 130.27 | 966,670,180 | 130.15 | 965,757,520 | 2.400 | 2034/3/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債(10年) | 938,000,000 | 101.52 | 952,295,120 | 101.45 | 951,629,140 | 0.100 | 2026/12/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第84回利付国債(20年) | 850,000,000 | 111.98 | 951,838,500 | 111.88 | 951,005,500 | 2.000 | 2025/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第342回利付国債(10年) | 890,000,000 | 101.37 | 902,255,300 | 101.31 | 901,694,600 | 0.100 | 2026/3/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債証券 | 第341回利付国債(10年) | 857,000,000 | 102.47 | 878,167,900 | 102.40 | 877,610,850 | 0.300 | 2025/12/20 | 0.63 |
| 日本 | 国債証券 | 第355回利付国債(10年) | 860,000,000 | 101.27 | 870,956,400 | 101.22 | 870,535,000 | 0.100 | 2029/6/20 | 0.63 |
| 日本 | 国債証券 | 第70回利付国債(20年) | 780,000,000 | 110.43 | 861,416,400 | 110.35 | 860,730,000 | 2.400 | 2024/6/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第356回利付国債(10年) | 850,000,000 | 101.16 | 859,919,500 | 101.11 | 859,503,000 | 0.100 | 2029/9/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第56回利付国債(20年) | 818,000,000 | 104.52 | 855,022,680 | 104.45 | 854,458,260 | 2.000 | 2022/6/20 | 0.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第351回利付国債(10年) | 840,000,000 | 101.58 | 853,314,000 | 101.49 | 852,591,600 | 0.100 | 2028/6/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債証券 | 第88回利付国債(20年) | 742,000,000 | 114.86 | 852,283,460 | 114.75 | 851,467,260 | 2.300 | 2026/6/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債証券 | 第92回利付国債(20年) | 734,000,000 | 114.73 | 842,176,920 | 114.62 | 841,354,840 | 2.100 | 2026/12/20 | 0.61 |

□ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 80.20 |
| 地方債証券 | 6.12 |
| 特殊債券 | 9.37 |
| 社債券 | 3.87 |
| 合計 | 99.56 |

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 5月29日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|----------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|-----------|---------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.75 | 11,800,000 | 10,761.40 | 1,269,845,292 | 11,388.09 | 1,343,795,689 | 1.750 | 2024/6/30 | 0.85 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.625 | 6,300,000 | 11,420.86 | 719,514,316 | 12,555.80 | 791,015,882 | 2.625 | 2029/2/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3 | 5,400,000 | 12,302.50 | 664,335,394 | 14,603.91 | 788,611,579 | 3.000 | 2048/8/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 6,500,000 | 10,928.57 | 710,357,464 | 11,509.91 | 748,144,178 | 2.125 | 2024/3/31 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.25 | 6,300,000 | 11,005.86 | 693,369,404 | 11,666.16 | 734,968,393 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.875 | 5,500,000 | 11,613.24 | 638,728,200 | 12,700.30 | 698,516,560 | 2.875 | 2028/8/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.625 | 6,050,000 | 10,629.50 | 643,085,269 | 11,484.70 | 694,824,840 | 1.625 | 2026/5/15 | 0.44 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 3.5 | 4,900,000 | 14,028.70 | 687,406,785 | 14,123.57 | 692,055,237 | 3.500 | 2030/3/1 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 5,700,000 | 11,099.95 | 632,697,282 | 11,688.00 | 666,216,399 | 2.500 | 2024/5/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 5,600,000 | 11,053.74 | 619,009,886 | 11,682.12 | 654,199,079 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 5,200,000 | 11,200.32 | 582,416,890 | 12,360.90 | 642,767,296 | 2.375 | 2029/5/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.625 | 5,450,000 | 10,497.07 | 572,090,783 | 11,677.92 | 636,446,970 | 1.625 | 2029/8/15 | 0.40 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3 | 5,000,000 | 12,940.49 | 647,024,812 | 12,719.39 | 635,969,548 | 3.000 | 2022/4/25 | 0.40 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 4.5 | 2,900,000 | 21,456.38 | 622,235,170 | 21,483.18 | 623,012,493 | 4.500 | 2041/4/25 | 0.39 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 0.25 | 4,900,000 | 12,351.22 | 605,209,944 | 12,327.92 | 604,068,560 | 0.250 | 2026/11/25 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.75 | 4,800,000 | 11,478.82 | 550,983,720 | 12,512.96 | 600,622,258 | 2.750 | 2028/2/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.75 | 5,100,000 | 11,192.36 | 570,810,406 | 11,737.57 | 598,616,150 | 2.750 | 2024/2/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 4,900,000 | 11,158.75 | 546,779,132 | 12,105.52 | 593,170,763 | 2.375 | 2027/5/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2 | 5,000,000 | 10,871.28 | 543,564,150 | 11,772.85 | 588,642,742 | 2.000 | 2026/11/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.625 | 4,800,000 | 11,258.39 | 540,402,768 | 12,056.80 | 578,726,460 | 2.625 | 2025/12/31 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 5,000,000 | 11,052.90 | 552,645,397 | 11,530.07 | 576,503,616 | 2.500 | 2023/8/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 4,900,000 | 10,948.73 | 536,488,174 | 11,681.28 | 572,383,032 | 2.125 | 2025/5/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2 | 5,000,000 | 10,876.99 | 543,849,777 | 11,233.52 | 561,676,235 | 2.000 | 2022/11/30 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 3,600,000 | 13,391.68 | 482,100,675 | 15,591.00 | 561,276,358 | 3.625 | 2044/2/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000 | 11,931.62 | 477,265,187 | 14,012.50 | 560,500,125 | 2.875 | 2045/8/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3 | 3,800,000 | 12,320.58 | 468,182,260 | 14,647.60 | 556,608,883 | 3.000 | 2049/2/15 | 0.35 |
| ドイツ | 国債証券 | DEUTSCHLAND REP 4.75 | 2,700,000 | 20,775.98 | 560,951,601 | 20,535.62 | 554,461,994 | 4.750 | 2034/7/4 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.125 | 3,800,000 | 12,409.63 | 471,566,095 | 14,519.07 | 551,724,671 | 3.125 | 2044/8/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.125 | 4,200,000 | 11,849.88 | 497,695,212 | 12,965.76 | 544,562,163 | 3.125 | 2028/11/15 | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 4,100,000 | 11,152.87 | 457,267,965 | 13,190.90 | 540,827,175 | 2.500 | 2046/5/15 | 0.34 |

□ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.83 |
| 合計 | 97.83 |

マネープール・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 5月29日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|-------|----------------------------|----------------|-------------|----------------|------------------|----------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 国債証券 | 第911回国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 100.02 | 10,002,700,000 | 100.02 | 10,002,490,000 | | 2020/8/31 | 2.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第904回国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 100.02 | 10,002,450,000 | 100.02 | 10,002,290,000 | | 2020/8/3 | 2.82 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第2回福岡県公募公債 | 6,500,000,000 | 100.08 | 6,505,224,000 | 100.01 | 6,501,235,000 | 0.162 | 2020/7/22 | 1.83 |
| 日本 | 地方債証券 | 第22回名古屋市公募公債(5年) | 6,400,000,000 | 100.10 | 6,406,464,000 | 100.03 | 6,402,112,000 | 0.101 | 2020/11/20 | 1.81 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第8回福岡県公募公債 | 5,870,000,000 | 100.12 | 5,877,572,300 | 100.04 | 5,872,641,500 | 0.101 | 2021/1/20 | 1.66 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第9回静岡県公募公債(5年) | 5,510,000,000 | 100.08 | 5,514,848,800 | 100.02 | 5,511,157,100 | 0.101 | 2020/9/18 | 1.55 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第10回埼玉県公募公債(5年) | 5,200,000,000 | 100.07 | 5,204,000,000 | 100.01 | 5,200,884,000 | 0.053 | 2021/2/25 | 1.47 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第7回大阪市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 100.13 | 5,006,550,000 | 100.04 | 5,002,350,000 | 0.101 | 2021/1/26 | 1.41 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第5回大阪市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 100.11 | 5,005,650,000 | 100.03 | 5,001,700,000 | 0.101 | 2020/11/25 | 1.41 |
| 日本 | 地方債証券 | 第43回横浜市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 100.10 | 5,005,150,000 | 100.03 | 5,001,650,000 | 0.101 | 2020/11/17 | 1.41 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第6回広島県公募公債(5年) | 4,310,000,000 | 100.08 | 4,313,534,200 | 100.01 | 4,310,732,700 | 0.053 | 2021/2/25 | 1.22 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第3回京都市公募公債 | 3,900,000,000 | 100.11 | 3,904,290,000 | 100.03 | 3,901,365,000 | 0.136 | 2020/9/29 | 1.10 |
| 日本 | 特殊債券 | 第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 3,669,200,000 | 100.95 | 3,704,119,492 | 100.39 | 3,683,730,032 | 0.900 | 2020/10/30 | 1.04 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第1回奈良県公募公債 | 3,440,000,000 | 100.11 | 3,443,921,600 | 100.03 | 3,441,204,000 | 0.101 | 2020/11/30 | 0.97 |
| 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 | 3,325,000,000 | 100.91 | 3,355,490,250 | 100.19 | 3,331,517,000 | 1.100 | 2020/7/31 | 0.94 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第6回神戸市公募公債(5年) | 3,200,000,000 | 100.09 | 3,202,976,000 | 100.02 | 3,200,864,000 | 0.101 | 2020/10/19 | 0.90 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第6回京都市公募公債 | 3,200,000,000 | 100.04 | 3,201,504,000 | 99.99 | 3,199,744,000 | 0.021 | 2021/3/25 | 0.90 |
| 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 | 3,121,000,000 | 100.92 | 3,149,931,670 | 100.26 | 3,129,333,070 | 1.000 | 2020/8/31 | 0.88 |
| 日本 | 特殊債券 | 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2,966,300,000 | 100.96 | 2,994,806,143 | 100.11 | 2,969,770,571 | 1.300 | 2020/6/30 | 0.84 |
| 日本 | 地方債証券 | 第11回2号宮城県公募公債(5年) | 2,580,000,000 | 100.11 | 2,582,915,400 | 100.03 | 2,580,903,000 | 0.101 | 2020/11/27 | 0.73 |
| 日本 | 特殊債券 | 第344回政府保証道路債券 | 2,200,000,000 | 100.75 | 2,216,584,000 | 100.21 | 2,204,642,000 | 1.600 | 2020/7/15 | 0.62 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-------|----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 特殊債券 | 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2,038,500,000 | 101.26 | 2,064,287,715 | 100.72 | 2,053,238,355 | 1.200 | 2020/12/28 | 0.58 |
| 日本 | 地方債証券 | 第42回横浜市公募債(5年) | 2,000,000,000 | 100.03 | 2,000,620,000 | 100.01 | 2,000,320,000 | 0.172 | 2020/7/10 | 0.56 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第3回福井県公募債 | 1,900,000,000 | 100.10 | 1,901,957,000 | 100.03 | 1,900,665,000 | 0.101 | 2020/11/27 | 0.54 |
| 日本 | 特殊債券 | 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,533,000,000 | 101.01 | 1,548,544,620 | 100.35 | 1,538,411,490 | 1.000 | 2020/9/30 | 0.43 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成22年度第11回静岡県公募債 | 1,523,910,000 | 101.02 | 1,539,563,686 | 100.48 | 1,531,255,246 | 1.008 | 2020/11/25 | 0.43 |
| 日本 | 地方債証券 | 第694回東京都公募債 | 1,210,600,000 | 101.35 | 1,227,058,400 | 101.06 | 1,223,468,678 | 1.350 | 2021/3/19 | 0.35 |
| 日本 | 特殊債券 | 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,121,000,000 | 100.97 | 1,131,976,530 | 100.47 | 1,126,335,960 | 0.900 | 2020/11/30 | 0.32 |
| 日本 | 地方債証券 | 第2回京都市公募債(7年) | 1,000,000,000 | 100.42 | 1,004,270,000 | 100.24 | 1,002,410,000 | 0.449 | 2020/12/25 | 0.28 |
| 日本 | 特殊債券 | 第32回政府保証日本政策金融公庫債券 | 1,000,000,000 | 100.09 | 1,000,960,000 | 100.06 | 1,000,600,000 | 0.160 | 2020/9/16 | 0.28 |

ロ 種類別の投資比率

2020年 5月29日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 5.64 |
| 地方債証券 | 24.32 |
| 特殊債券 | 8.64 |
| 合計 | 38.61 |

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネープール・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 5月29日現在

| 種類 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|-------|----------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | 東証株価指数先物 | 買建 | 169 | 日本円 | 2,527,545,900 | 2,634,710,000 | 1.58 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 種類 | 地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価 (円) | 評価額 | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|-----------------|--------------------------------|-------------|-----------|-----|-------------------|-------------|---------------|------------|---------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | シカゴ商業 取引所 | SPMINI 2006 | 買建 | 314 | 米ドル | 46,271,792 | 4,975,605,794 | 47,698,170 | 5,128,984,220 | 2.41 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所 | DJ EUR 2006 | 買建 | 307 | ユーロ | 9,007,004 | 1,073,004,386 | 9,492,440 | 1,130,834,377 | 0.53 |
| | オース トラリ ア | シドニー先 物取引所 | SPI200 2006 | 買建 | 25 | オースト ラリアド ル | 3,495,337.5 | 249,392,331 | 3,660,000 | 261,141,000 | 0.12 |
| | 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 | 41 | 英ポンド | 2,462,657 | 326,375,932 | 2,551,840 | 338,195,355 | 0.15 |

(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 5月29日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-------|-----------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 買建 | 8,000,000.00 | 862,840,000 | 860,160,000 | 0.40 |
| | カナダドル | 買建 | 580,000.00 | 45,473,400 | 45,240,000 | 0.02 |
| | ユーロ | 買建 | 1,110,000.00 | 132,004,500 | 132,234,300 | 0.06 |
| | 英ポンド | 買建 | 490,000.00 | 64,861,400 | 64,934,800 | 0.03 |

| | | | | | |
|------------|----|--------------|------------|------------|------|
| スイスフラン | 買建 | 50,000.00 | 5,574,450 | 5,576,000 | 0.00 |
| スウェーデンクローナ | 買建 | 1,210,000.00 | 13,619,300 | 13,648,800 | 0.00 |
| ノルウェークローネ | 買建 | 50,000.00 | 549,000 | 549,500 | 0.00 |
| デンマーククローネ | 買建 | 60,000.00 | 958,200 | 958,800 | 0.00 |
| オーストラリアドル | 買建 | 440,000.00 | 31,432,000 | 31,389,600 | 0.01 |
| 香港ドル | 買建 | 1,090,000.00 | 15,151,900 | 15,107,400 | 0.00 |
| シンガポールドル | 買建 | 70,000.00 | 5,322,000 | 5,311,600 | 0.00 |
| イスラエルシェケル | 買建 | 230,000.00 | 7,062,900 | 7,040,300 | 0.00 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 種類 | 地域 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価 (円) | 評価額 | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|----------|----------------------------|------------|-----------|-----|-----|------------|---------------|------------|---------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリ カ | インターコ ンチネン タル取引 所 | MSCIE 2006 | 買建 | 518 | 米ドル | 22,928,638 | 2,465,516,444 | 23,758,070 | 2,554,705,267 | 36.85 |

(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 5月29日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|--------|-----------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 買建 | 24,053,187.05 | 2,510,777,865 | 2,585,477,089 | 37.29 |
| | 米ドル | 売建 | 14,840,198.42 | 1,600,000,000 | 1,595,172,926 | 23.01 |
| | メキシコペソ | 売建 | 6,755.83 | 32,765 | 32,630 | 0.00 |
| | 香港ドル | 売建 | 3,240.00 | 45,100 | 44,906 | 0.00 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 種類 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------------|-------|------------|-----------|----|-----|------------|------------|-----------------|
| REIT指 数先物 取引 | 大阪取引所 | 東証REIT指数先物 | 買建 | 40 | 日本円 | 72,438,300 | 68,040,000 | 1.51 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 5月29日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|------------|-----------|------------|------------|------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 買建 | 882,399.46 | 94,850,000 | 94,875,589 | 1.42 |
| | カナダドル | 買建 | 64,118.18 | 5,000,000 | 5,001,218 | 0.07 |
| | ユーロ | 買建 | 67,187.93 | 8,000,000 | 8,004,098 | 0.11 |
| | 英ポンド | 買建 | 45,296.35 | 6,000,000 | 6,002,672 | 0.08 |
| | オーストラリアドル | 買建 | 237,976.01 | 17,000,000 | 16,977,207 | 0.25 |
| | ニュージーランドドル | 買建 | 60,059.16 | 4,000,000 | 3,999,940 | 0.05 |
| | 香港ドル | 買建 | 597,276.55 | 8,300,000 | 8,278,252 | 0.12 |
| | シンガポールドル | 買建 | 74,283.46 | 5,650,000 | 5,636,628 | 0.08 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネープール・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日: 2020年5月29日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■<2060>



| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2020年4月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■<2060>

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 | 93.77 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 5.30 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 0.93 |
| 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) | 25.68 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス・マザーファンド | 22.99 |
| 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 | 13.27 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 10.97 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | リート・インデックス・マザーファンド | 9.02 |
| 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 | 7.68 |
| アメリカ | 投資信託受益証券 | iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | 5.30 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 2.95 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | マネープール・マザーファンド | 1.22 |

※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。

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|------|----|-------------------|--------|-------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.36 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 1.92 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 1.79 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 1.68 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1.55 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 1.43 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 1.28 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 1.19 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 1.13 |

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、株価指数先物取引の買建て(1.58%)を行っています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|------|----|----------------------|------------------------|-------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 3.68 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 3.42 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 2.63 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | メディア・娯楽 | 1.42 |
| 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 | 1.01 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC | ソフトウェア・サービス | 0.87 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 0.82 |

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(3.21%)を行っています。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|--------|--------------|------------------------------------|--------------------|-------|
| ケイマン諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 小売 | 4.21 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LIMITED | メディア・娯楽 | 3.68 |
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 半導体・半導体製造装置 | 2.93 |
| 香港 | 投資信託 受益証券 | CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF | — | 2.87 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.37 |
| アメリカ | 投資信託 受益証券 | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | — | 2.35 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | — | 1.67 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 0.93 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LIMITED-N SHS | 小売 | 0.91 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | エネルギー | 0.68 |

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(36.85%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|----------------|-------|------------|-------|
| 日本 | 国債証券 | 第143回利付国債(5年) | 0.100 | 2025/03/20 | 1.91 |
| 日本 | 国債証券 | 第142回利付国債(5年) | 0.100 | 2024/12/20 | 1.52 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 0.800 | 2023/06/20 | 1.50 |
| 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 | 1.19 |
| 日本 | 国債証券 | 第59回利付国債(20年) | 1.700 | 2022/12/20 | 1.10 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債(10年) | 0.800 | 2023/09/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 0.800 | 2022/09/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第61回利付国債(20年) | 1.000 | 2023/03/20 | 0.90 |
| 日本 | 国債証券 | 第343回利付国債(10年) | 0.100 | 2026/06/20 | 0.81 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|-----------------------|-------|------------|-------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.75 | 1.750 | 2024/06/30 | 0.85 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.625 | 2.625 | 2029/02/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3 | 3.000 | 2048/08/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 2.125 | 2024/03/31 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.25 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.875 | 2.875 | 2028/08/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.625 | 1.625 | 2026/05/15 | 0.44 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 3.5 | 3.500 | 2030/03/01 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 2.500 | 2024/05/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 2.375 | 2024/08/15 | 0.41 |

*比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

iシェアーズJ.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|-------|------|--|-------|------------|-------|
| ロシア連邦 | 国債証券 | RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25 06/23/47 | 5.250 | 2047/06/23 | 0.89 |
| クウェート | 国債証券 | KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) MTN RegS 3.5 03/20/27 | 3.500 | 2027/03/20 | 0.88 |
| ウルグアイ | 国債証券 | URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1 06/18/50 | 5.100 | 2050/06/18 | 0.86 |
| カタール | 国債証券 | QATAR (STATE OF) RegS 5.1 04/23/48 | 5.100 | 2048/04/23 | 0.75 |
| カタール | 国債証券 | QATAR (STATE OF) RegS 4.817 03/14/49 | 4.817 | 2049/03/14 | 0.74 |
| ペルー | 国債証券 | PERU (REPUBLIC OF) 5.625 11/18/50 | 5.625 | 2050/11/18 | 0.71 |
| ペルー | 国債証券 | PERU (REPUBLIC OF) 8.75 11/21/33 | 8.750 | 2033/11/21 | 0.65 |
| コロンビア | 国債証券 | COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5 06/15/45 | 5.000 | 2045/06/15 | 0.64 |
| ウルグアイ | 国債証券 | URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 4.975 04/20/55 | 4.975 | 2055/04/20 | 0.55 |
| パナマ | 国債証券 | PANAMA REPUBLIC OF (GOVERNMENT)4.5 04/01/56 | 4.500 | 2056/04/01 | 0.53 |

*比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

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

■リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|------|-------------------|-------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 7.28 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 6.54 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 5.10 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 4.76 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 4.23 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 3.98 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 3.54 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 3.46 |
| 日本 | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人 | 2.99 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 2.85 |

※上記のほか、リート・インデックス・マザーファンドにおいて、リート指数先物取引の買建て(1.51%)を行っています。

■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|------|---------------------------------------|-------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 6.60 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 5.88 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 3.70 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 2.84 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 2.14 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 2.07 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 1.94 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORPORATION | 1.78 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 1.77 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 1.76 |

■マネープール・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|-------|-----------------------|-------|------------|-------|
| 日本 | 国債証券 | 第911回国庫短期証券 | — | 2020/08/31 | 2.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第904回国庫短期証券 | — | 2020/08/03 | 2.82 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第2回福岡県公募公債 | 0.162 | 2020/07/22 | 1.83 |
| 日本 | 地方債証券 | 第22回名古屋市公募公債(5年) | 0.101 | 2020/11/20 | 1.81 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第8回福岡県公募公債 | 0.101 | 2021/01/20 | 1.66 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第9回静岡県公募公債(5年) | 0.101 | 2020/09/18 | 1.55 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第10回埼玉県公募公債(5年) | 0.053 | 2021/02/25 | 1.47 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第7回大阪市公募公債(5年) | 0.101 | 2021/01/26 | 1.41 |
| 日本 | 地方債証券 | 平成27年度第5回大阪市公募公債(5年) | 0.101 | 2020/11/25 | 1.41 |
| 日本 | 地方債証券 | 第43回横浜市公募公債(5年) | 0.101 | 2020/11/17 | 1.41 |

※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)



第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

ロ 申込価額

当初自己設定：1口当たり1円です。

継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

| 照会先の名称 | コールセンター | 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。

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

(イ) 当初自己設定

委託会社は、設定日(2020年1月24日)に、当初自己設定にかかる発行価額の総額を委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込みます。

(ロ) 継続申込期間

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

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

2【換金(解約)手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(借入れ公社債を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額

(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)

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

□ 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、「TYF60」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 | コールセンター | 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】

2020年1月24日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年4月27日から翌年4月26日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
 - e. 上記b~dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b~dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
- 委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- 委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
 - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
 - c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。
- (ニ) 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(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。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられま

す。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期(2020年1月24日から2020年4月27日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | | 第1期 (2020年 4月27日現在) |
|-----------------|--|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 15,089 |
| 金銭信託 | | 108,511 |
| コール・ローン | | 111,244 |
| 投資信託受益証券 | | 1,327,966 |
| 親投資信託受益証券 | | 24,023,048 |
| 未収入金 | | 100,000 |
| 流動資産合計 | | 25,685,858 |
| 資産合計 | | 25,685,858 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | | 2,283 |
| 未払委託者報酬 | | 25,098 |
| その他未払費用 | | 432 |
| 流動負債合計 | | 27,813 |
| 負債合計 | | 27,813 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 30,000,000 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | | 4,341,955 |
| 元本等合計 | | 25,658,045 |
| 純資産合計 | | 25,658,045 |
| 負債純資産合計 | | 25,685,858 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|---|---------------------------------------|
| 営業収益 | |
| 受取配当金 | 15,089 |
| 有価証券売買等損益 | 4,300,685 |
| 為替差損益 | 19,964 |
| 営業収益合計 | 4,305,560 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 23 |
| 受託者報酬 | 2,283 |
| 委託者報酬 | 25,098 |
| その他費用 | 8,991 |
| 営業費用合計 | 36,395 |
| 営業利益又は営業損失() | 4,341,955 |
| 経常利益又は経常損失() | 4,341,955 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 4,341,955 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額() | - |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | - |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | - |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - |
| 分配金 | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 4,341,955 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 第1期 | |
|----------------------------|--|--|
| | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> | |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> | |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> | |

(貸借対照表に関する注記)

| 項 目 | 第1期 | |
|--------------------------------------|-------------------|-------------|
| | (2020年 4月27日現在) | |
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | | 30,000,000口 |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 | 4,341,955円 |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 0.8553円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 8,553円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項 目 | 第1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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(164,045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(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は164,045円(1万口当たり54.68円)ではありますが、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1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

| 項目 | 第1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|---------------------------|--|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第1期 (2020年 4月27日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日）

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資信託受益証券 | 233,733円 |
| 親投資信託受益証券 | 3,972,015円 |
| 合計 | 4,205,748円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|--|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

（その他の注記）

| 項 目 | 第1期 (2020年 4月27日現在) |
|-----------|------------------------|
| 期首元本額 | 30,000,000円 |
| 期中追加設定元本額 | -円 |
| 期中一部解約元本額 | -円 |

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-------------|-----|---|------------|---------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 米ドル | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F | 126 | 12,341.70 | |
| | | 米ドル 小計 | 126 | 12,341.70 (1,327,966) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | | 1,327,966 (1,327,966) | |
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） | 2,752,764 | 6,450,551 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 1,759,348 | 5,865,138 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,121,849 | 2,061,509 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,688,392 | 3,463,724 | |
| | | Jリート・インデックス・マザーファンド | 1,159,286 | 2,268,838 | |
| | | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 450,246 | 743,986 | |
| | | マネープール・マザーファンド | 329,342 | 329,901 | |
| | | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 2,548,148 | 2,839,401 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | | 12,809,375 | 24,023,048 | |
| 合計 | | | | 25,351,014 (1,327,966) | |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資信託受益証券 時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-----|--------------|--------------------|------------|
| 米ドル | 投資信託受益証券 1銘柄 | 5.2% | 100.0% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネープール・マザーファンド」受益証券を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) | |
|-----------------|-----------------|
| (2020年 4月27日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 652,035,892 |
| コール・ローン | 667,623,445 |
| 株式 | 152,354,149,040 |
| 派生商品評価勘定 | 128,163,700 |
| 未収配当金 | 1,981,191,957 |
| 差入委託証拠金 | 62,380,000 |
| 流動資産合計 | 155,845,544,034 |
| 資産合計 | 155,845,544,034 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,797,600 |
| 前受金 | 126,530,000 |
| 未払解約金 | 75,208,007 |
| 未払利息 | 1,925 |
| その他未払費用 | 132,811 |
| 流動負債合計 | 203,670,343 |
| 負債合計 | 203,670,343 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 66,420,614,464 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 89,221,259,227 |
| 元本等合計 | 155,641,873,691 |
| 純資産合計 | 155,641,873,691 |
| 負債純資産合計 | 155,845,544,034 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|--|
| 1. 担保資産 | <p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: right;">株式 2,663,600,000円</p> |
| 2. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 66,420,614,464口 |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 2.3433円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 23,433円)</p> |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| | (1)金融商品の内容 |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権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27日現在) |
|-----|-----------------|

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

(2020年 4月27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 | 3,194,833,900 | - | 3,321,200,000 | 126,366,100 |
| | 東証株価指数先物 | 3,194,833,900 | - | 3,321,200,000 | 126,366,100 |
| | 合計 | 3,194,833,900 | - | 3,321,200,000 | 126,366,100 |

(注)1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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)

| (2020年 4月27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 | 62,955,891,614円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 9,131,832,058円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 5,667,109,208円 |
| 2020年 4月27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 | 9,930,085,411円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 1,002,421,458円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,651,519,341円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,204,800,316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) | 82,255,976円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 7,056,016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) | 25,925,290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) | 71,999,208円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 121,550,280円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 84,468,752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) | 183,080,997円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 1,807,172,658円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド | 12,989,825,879円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 348,878,578円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 402,912,826円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 297,633,454円 |
| 三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050 | 14,913,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 90,110,330円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 73,374,401円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 225,263,505円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 109,513,205円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 133,932,515円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド | 17,244,259円 |
| 三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド | 20,155,703円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型) | 628,342円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型) | 2,812,060円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型) | 1,964,032円 |
| 三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060 | 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) | 3,916,736,716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 > | 22,951,358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 > | 3,203,480,644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 > | 2,413,624,299円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 > | 8,994,664,617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 > | 898,124,937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 > | 936,340,998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 > | 2,882,119,746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 > | 80,438,386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 > | 115,926,629円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 55,415,739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 > | 71,756,055円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 968,188,755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) | 191,083,859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 > | 929,127,958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 > | 101,389,039円 |
| 合計 | 66,420,614,464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 | 2,532.00 | 9,368,400 | |
| 日本水産 | 101,000 | 471.00 | 47,571,000 | |
| マルハニチロ | 14,500 | 2,278.00 | 33,031,000 | |
| カネコ種苗 | 4,600 | 1,485.00 | 6,831,000 | |
| サカタのタネ | 11,900 | 3,570.00 | 42,483,000 | |
| ホクト | 8,300 | 1,947.00 | 16,160,100 | |
| 日鉄鉱業 | 2,300 | 4,500.00 | 10,350,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 5,600 | 834.00 | 4,670,400 | |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| 国際石油開発帝石 | 410,300 | 665.80 | 273,177,740 |
| 石油資源開発 | 13,000 | 1,861.00 | 24,193,000 |
| K & O エナジーグループ | 5,600 | 1,587.00 | 8,887,200 |
| ヒノキヤグループ | 3,600 | 1,406.00 | 5,061,600 |
| ショーボンドホールディングス | 15,600 | 4,370.00 | 68,172,000 |
| ミライト・ホールディングス | 29,300 | 1,375.00 | 40,287,500 |
| タマホーム | 6,500 | 1,178.00 | 7,657,000 |
| スペースバリューホールディングス | 17,900 | 333.00 | 5,960,700 |
| 安藤・間 | 61,200 | 660.00 | 40,392,000 |
| 東急建設 | 30,200 | 543.00 | 16,398,600 |
| コムシスホールディングス | 36,000 | 2,959.00 | 106,524,000 |
| ビーアールホールディングス | 13,400 | 483.00 | 6,472,200 |
| 高松コンストラクショングループ | 6,600 | 2,209.00 | 14,579,400 |
| 東建コーポレーション | 3,100 | 7,380.00 | 22,878,000 |
| 大成建設 | 78,100 | 3,300.00 | 257,730,000 |
| 大林組 | 231,700 | 922.00 | 213,627,400 |
| 清水建設 | 236,200 | 825.00 | 194,865,000 |
| 飛鳥建設 | 8,500 | 1,049.00 | 8,916,500 |
| 長谷工コーポレーション | 89,900 | 1,145.00 | 102,935,500 |
| 松井建設 | 11,800 | 643.00 | 7,587,400 |
| 銭高組 | 1,600 | 3,665.00 | 5,864,000 |
| 鹿島建設 | 183,200 | 1,098.00 | 201,153,600 |
| 不動テトラ | 7,600 | 1,338.00 | 10,168,800 |
| 大末建設 | 6,100 | 727.00 | 4,434,700 |
| 鉄建建設 | 5,700 | 2,121.00 | 12,089,700 |
| 西松建設 | 18,600 | 2,036.00 | 37,869,600 |
| 三井住友建設 | 59,400 | 426.00 | 25,304,400 |
| 大豊建設 | 6,000 | 2,225.00 | 13,350,000 |
| 前田建設工業 | 60,500 | 836.00 | 50,578,000 |
| 奥村組 | 13,800 | 2,262.00 | 31,215,600 |
| 東鉄工業 | 9,600 | 2,786.00 | 26,745,600 |
| 浅沼組 | 3,000 | 3,445.00 | 10,335,000 |
| 戸田建設 | 97,400 | 615.00 | 59,901,000 |
| 熊谷組 | 10,900 | 2,250.00 | 24,525,000 |
| 北野建設 | 2,200 | 2,419.00 | 5,321,800 |
| 矢作建設工業 | 12,100 | 800.00 | 9,680,000 |
| ピーエス三菱 | 10,600 | 520.00 | 5,512,000 |
| 日本ハウスホールディングス | 22,500 | 291.00 | 6,547,500 |
| 大東建託 | 28,400 | 10,445.00 | 296,638,000 |
| 新日本建設 | 10,000 | 778.00 | 7,780,000 |
| N I P P O | 18,900 | 2,406.00 | 45,473,400 |
| 東亜道路工業 | 2,000 | 2,866.00 | 5,732,000 |

| | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|
| 前田道路 | 21,300 | 1,959.00 | 41,726,700 |
| 日本道路 | 2,500 | 6,450.00 | 16,125,000 |
| 東亜建設工業 | 8,300 | 1,365.00 | 11,329,500 |
| 日本国土開発 | 18,500 | 530.00 | 9,805,000 |
| 若築建設 | 5,800 | 1,193.00 | 6,919,400 |
| 東洋建設 | 27,700 | 415.00 | 11,495,500 |
| 五洋建設 | 93,800 | 537.00 | 50,370,600 |
| 世紀東急工業 | 14,000 | 784.00 | 10,976,000 |
| 福田組 | 2,800 | 4,220.00 | 11,816,000 |
| 住友林業 | 59,400 | 1,292.00 | 76,744,800 |
| 日本基礎技術 | 13,700 | 394.00 | 5,397,800 |
| 巴コーポレーション | 16,200 | 340.00 | 5,508,000 |
| 大和ハウス工業 | 232,700 | 2,716.50 | 632,129,550 |
| ライト工業 | 13,000 | 1,318.00 | 17,134,000 |
| 積水ハウス | 257,300 | 1,808.50 | 465,327,050 |
| ユアテック | 15,200 | 590.00 | 8,968,000 |
| 中電工 | 8,100 | 2,184.00 | 17,690,400 |
| 関電工 | 30,600 | 864.00 | 26,438,400 |
| きんでん | 55,700 | 1,682.00 | 93,687,400 |
| 東京エネシス | 9,800 | 724.00 | 7,095,200 |
| トーエネック | 2,900 | 3,300.00 | 9,570,000 |
| 住友電設 | 6,400 | 2,221.00 | 14,214,400 |
| 日本電設工業 | 11,900 | 2,184.00 | 25,989,600 |
| 協和エクシオ | 35,300 | 2,626.00 | 92,697,800 |
| 新日本空調 | 6,800 | 2,151.00 | 14,626,800 |
| 九電工 | 16,300 | 2,687.00 | 43,798,100 |
| 三機工業 | 16,900 | 1,217.00 | 20,567,300 |
| 日揮ホールディングス | 73,200 | 981.00 | 71,809,200 |
| 中外炉工業 | 4,100 | 1,505.00 | 6,170,500 |
| ヤマト | 9,400 | 688.00 | 6,467,200 |
| 太平電業 | 6,100 | 2,129.00 | 12,986,900 |
| 高砂熱学工業 | 19,500 | 1,661.00 | 32,389,500 |
| 朝日工業社 | 2,200 | 3,045.00 | 6,699,000 |
| 明星工業 | 15,300 | 784.00 | 11,995,200 |
| 大気社 | 11,400 | 3,020.00 | 34,428,000 |
| ダイダン | 5,700 | 2,732.00 | 15,572,400 |
| 日比谷総合設備 | 8,100 | 1,876.00 | 15,195,600 |
| OSJBホールディングス | 42,500 | 233.00 | 9,902,500 |
| レイズネクスト | 13,600 | 1,203.00 | 16,360,800 |
| 日本製粉 | 20,400 | 1,707.00 | 34,822,800 |
| 日清製粉グループ本社 | 84,500 | 1,682.00 | 142,129,000 |
| 昭和産業 | 6,800 | 3,315.00 | 22,542,000 |

| | | | |
|--------------------------|---------|----------|-------------|
| 鳥越製粉 | 8,500 | 905.00 | 7,692,500 |
| 中部飼料 | 8,700 | 1,639.00 | 14,259,300 |
| フィード・ワン | 55,900 | 164.00 | 9,167,600 |
| 日本甜菜製糖 | 4,700 | 1,690.00 | 7,943,000 |
| 三井製糖 | 5,900 | 2,183.00 | 12,879,700 |
| 日新製糖 | 3,600 | 1,928.00 | 6,940,800 |
| 森永製菓 | 17,600 | 4,555.00 | 80,168,000 |
| 中村屋 | 2,600 | 3,885.00 | 10,101,000 |
| 江崎グリコ | 22,400 | 4,940.00 | 110,656,000 |
| 名糖産業 | 6,100 | 1,304.00 | 7,954,400 |
| 井村屋グループ | 4,000 | 1,960.00 | 7,840,000 |
| 不二家 | 4,600 | 2,086.00 | 9,595,600 |
| 山崎製パン | 56,400 | 2,324.00 | 131,073,600 |
| モロゾフ | 1,700 | 5,290.00 | 8,993,000 |
| 亀田製菓 | 4,300 | 5,250.00 | 22,575,000 |
| 寿スピリッツ | 7,100 | 4,360.00 | 30,956,000 |
| カルビー | 34,400 | 3,370.00 | 115,928,000 |
| 森永乳業 | 14,000 | 4,195.00 | 58,730,000 |
| 六甲バター | 5,800 | 1,448.00 | 8,398,400 |
| ヤクルト本社 | 51,700 | 6,660.00 | 344,322,000 |
| 明治ホールディングス | 49,600 | 7,650.00 | 379,440,000 |
| 雪印メグミルク | 17,800 | 2,477.00 | 44,090,600 |
| プリマハム | 11,200 | 2,500.00 | 28,000,000 |
| 日本ハム | 28,600 | 3,675.00 | 105,105,000 |
| 丸大食品 | 8,100 | 1,983.00 | 16,062,300 |
| S Foods | 5,800 | 2,299.00 | 13,334,200 |
| 柿安本店 | 3,200 | 2,217.00 | 7,094,400 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 42,300 | 631.00 | 26,691,300 |
| サッポロホールディングス | 25,900 | 2,030.00 | 52,577,000 |
| アサヒグループホールディングス | 157,500 | 3,732.00 | 587,790,000 |
| キリンホールディングス | 318,600 | 2,077.00 | 661,732,200 |
| 宝ホールディングス | 56,300 | 785.00 | 44,195,500 |
| オエノンホールディングス | 22,200 | 398.00 | 8,835,600 |
| 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 | 1,994.00 | 105,482,600 |
| サントリー食品インターナショナル | 50,100 | 4,110.00 | 205,911,000 |
| ダイドーグループホールディングス | 3,800 | 4,160.00 | 15,808,000 |
| 伊藤園 | 22,700 | 6,160.00 | 139,832,000 |
| キーコーヒー | 7,400 | 2,240.00 | 16,576,000 |
| 日清オイリオグループ | 9,400 | 3,570.00 | 33,558,000 |
| 不二製油グループ本社 | 18,400 | 2,549.00 | 46,901,600 |
| かどや製油 | 1,300 | 3,685.00 | 4,790,500 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|
| J - オイルミルズ | 4,000 | 4,145.00 | 16,580,000 |
| キッコーマン | 53,800 | 4,830.00 | 259,854,000 |
| 味の素 | 166,100 | 1,914.00 | 317,915,400 |
| キューピー | 41,900 | 2,192.00 | 91,844,800 |
| ハウス食品グループ本社 | 28,100 | 3,405.00 | 95,680,500 |
| カゴメ | 28,400 | 2,742.00 | 77,872,800 |
| 焼津水産化学工業 | 6,400 | 907.00 | 5,804,800 |
| アリアケジャパン | 7,000 | 6,370.00 | 44,590,000 |
| ニチレイ | 35,800 | 2,787.00 | 99,774,600 |
| 東洋水産 | 38,500 | 5,470.00 | 210,595,000 |
| イトアンド | 3,700 | 1,716.00 | 6,349,200 |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 5,100 | 899.00 | 4,584,900 |
| 日清食品ホールディングス | 31,900 | 9,130.00 | 291,247,000 |
| 永谷園ホールディングス | 4,200 | 2,259.00 | 9,487,800 |
| 一正蒲鉾 | 5,900 | 999.00 | 5,894,100 |
| フジッコ | 8,200 | 1,988.00 | 16,301,600 |
| ロック・フィールド | 8,200 | 1,321.00 | 10,832,200 |
| 日本たばこ産業 | 433,800 | 2,016.00 | 874,540,800 |
| ケンコーマヨネーズ | 4,800 | 1,989.00 | 9,547,200 |
| わらべや日洋ホールディングス | 5,500 | 1,558.00 | 8,569,000 |
| なとり | 5,400 | 1,735.00 | 9,369,000 |
| ピクルスコーポレーション | 2,000 | 2,325.00 | 4,650,000 |
| 北の達人コーポレーション | 26,400 | 470.00 | 12,408,000 |
| ユーグレナ | 33,800 | 630.00 | 21,294,000 |
| ミヨシ油脂 | 4,300 | 1,069.00 | 4,596,700 |
| 理研ビタミン | 7,300 | 2,140.00 | 15,622,000 |
| 片倉工業 | 12,400 | 1,002.00 | 12,424,800 |
| ゲンゼ | 5,500 | 3,685.00 | 20,267,500 |
| 東洋紡 | 30,000 | 1,231.00 | 36,930,000 |
| ユニチカ | 25,200 | 297.00 | 7,484,400 |
| 富士紡ホールディングス | 4,000 | 2,818.00 | 11,272,000 |
| 倉敷紡績 | 7,500 | 2,476.00 | 18,570,000 |
| 日本毛織 | 23,900 | 938.00 | 22,418,200 |
| ガイドーリミテッド | 25,600 | 195.00 | 4,992,000 |
| 帝国繊維 | 8,600 | 2,178.00 | 18,730,800 |
| 帝人 | 59,400 | 1,744.00 | 103,593,600 |
| 東レ | 533,100 | 489.40 | 260,899,140 |
| 住江織物 | 2,600 | 1,775.00 | 4,615,000 |
| アツギ | 10,600 | 622.00 | 6,593,200 |
| ダイニック | 6,400 | 733.00 | 4,691,200 |
| セーレン | 18,200 | 1,276.00 | 23,223,200 |
| 小松マテーレ | 13,500 | 749.00 | 10,111,500 |

| | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|
| ワコールホールディングス | 19,500 | 2,163.00 | 42,178,500 |
| ホギメディカル | 8,600 | 3,405.00 | 29,283,000 |
| T S Iホールディングス | 27,600 | 412.00 | 11,371,200 |
| マツオカコーポレーション | 3,200 | 1,772.00 | 5,670,400 |
| ワールド | 10,700 | 1,226.00 | 13,118,200 |
| 三陽商会 | 5,100 | 857.00 | 4,370,700 |
| オンワードホールディングス | 46,200 | 348.00 | 16,077,600 |
| ゴールドウイン | 13,400 | 5,630.00 | 75,442,000 |
| デサント | 15,100 | 1,340.00 | 20,234,000 |
| 特種東海製紙 | 4,600 | 4,180.00 | 19,228,000 |
| 王子ホールディングス | 303,100 | 559.00 | 169,432,900 |
| 日本製紙 | 33,000 | 1,551.00 | 51,183,000 |
| 三菱製紙 | 12,500 | 340.00 | 4,250,000 |
| 北越コーポレーション | 48,500 | 410.00 | 19,885,000 |
| 中越パルプ工業 | 4,800 | 1,371.00 | 6,580,800 |
| 大王製紙 | 32,200 | 1,465.00 | 47,173,000 |
| レンゴー | 70,300 | 851.00 | 59,825,300 |
| トモク | 5,300 | 1,523.00 | 8,071,900 |
| ザ・パック | 5,800 | 3,530.00 | 20,474,000 |
| クラレ | 114,400 | 1,069.00 | 122,293,600 |
| 旭化成 | 485,900 | 748.30 | 363,598,970 |
| 昭和電工 | 51,800 | 2,353.00 | 121,885,400 |
| 住友化学 | 527,700 | 322.00 | 169,919,400 |
| 住友精化 | 3,500 | 2,860.00 | 10,010,000 |
| 日産化学 | 40,900 | 4,005.00 | 163,804,500 |
| ラサ工業 | 3,300 | 1,229.00 | 4,055,700 |
| クレハ | 6,000 | 4,230.00 | 25,380,000 |
| 多木化学 | 2,500 | 5,390.00 | 13,475,000 |
| テイカ | 5,800 | 1,515.00 | 8,787,000 |
| 石原産業 | 14,300 | 596.00 | 8,522,800 |
| 日本曹達 | 11,000 | 2,843.00 | 31,273,000 |
| 東ソー | 112,600 | 1,322.00 | 148,857,200 |
| トクヤマ | 21,100 | 2,196.00 | 46,335,600 |
| セントラル硝子 | 15,600 | 1,830.00 | 28,548,000 |
| 東亜合成 | 46,000 | 991.00 | 45,586,000 |
| 大阪ソーダ | 7,300 | 2,462.00 | 17,972,600 |
| 関東電化工業 | 18,400 | 837.00 | 15,400,800 |
| デンカ | 26,500 | 2,555.00 | 67,707,500 |
| 信越化学工業 | 125,900 | 11,800.00 | 1,485,620,000 |
| 日本カーバイド工業 | 4,500 | 1,015.00 | 4,567,500 |
| 堺化学工業 | 5,300 | 1,739.00 | 9,216,700 |
| 第一稀元素化学工業 | 9,400 | 736.00 | 6,918,400 |

| | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|
| エア・ウォーター | 68,100 | 1,467.00 | 99,902,700 |
| 大陽日酸 | 70,900 | 1,647.00 | 116,772,300 |
| 日本化学工業 | 2,800 | 2,195.00 | 6,146,000 |
| 日本パーカラライジング | 37,400 | 1,098.00 | 41,065,200 |
| 高压ガス工業 | 13,000 | 741.00 | 9,633,000 |
| チタン工業 | 2,100 | 1,644.00 | 3,452,400 |
| 四国化成工業 | 10,700 | 1,079.00 | 11,545,300 |
| ステラ ケミファ | 4,200 | 2,267.00 | 9,521,400 |
| 保土谷化学工業 | 3,000 | 3,345.00 | 10,035,000 |
| 日本触媒 | 11,500 | 5,180.00 | 59,570,000 |
| 大日精化工業 | 6,300 | 2,243.00 | 14,130,900 |
| カネカ | 18,700 | 2,765.00 | 51,705,500 |
| 三菱瓦斯化学 | 68,000 | 1,312.00 | 89,216,000 |
| 三井化学 | 65,800 | 2,062.00 | 135,679,600 |
| J S R | 68,600 | 1,964.00 | 134,730,400 |
| 東京応化工業 | 12,600 | 4,410.00 | 55,566,000 |
| 大阪有機化学工業 | 6,700 | 1,693.00 | 11,343,100 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 489,400 | 650.50 | 318,354,700 |
| K Hネオケム | 13,200 | 1,781.00 | 23,509,200 |
| ダイセル | 100,100 | 847.00 | 84,784,700 |
| 住友ベークライト | 11,900 | 2,648.00 | 31,511,200 |
| 積水化学工業 | 155,600 | 1,385.00 | 215,506,000 |
| 日本ゼオン | 66,600 | 825.00 | 54,945,000 |
| アイカ工業 | 22,000 | 3,005.00 | 66,110,000 |
| 宇部興産 | 36,000 | 1,812.00 | 65,232,000 |
| 積水樹脂 | 13,200 | 2,059.00 | 27,178,800 |
| タキロンシーアイ | 17,400 | 593.00 | 10,318,200 |
| 旭有機材 | 4,800 | 1,294.00 | 6,211,200 |
| 日立化成 | 34,100 | 4,610.00 | 157,201,000 |
| ニチバン | 4,600 | 1,496.00 | 6,881,600 |
| リケンテクノス | 19,800 | 447.00 | 8,850,600 |
| 大倉工業 | 3,900 | 1,556.00 | 6,068,400 |
| 積水化成成品工業 | 10,900 | 628.00 | 6,845,200 |
| 群栄化学工業 | 2,400 | 2,537.00 | 6,088,800 |
| ミライアル | 3,800 | 1,046.00 | 3,974,800 |
| ダイキョーニシカワ | 15,400 | 525.00 | 8,085,000 |
| 森六ホールディングス | 5,300 | 1,450.00 | 7,685,000 |
| 日本化薬 | 46,500 | 1,021.00 | 47,476,500 |
| カーリットホールディングス | 11,500 | 500.00 | 5,750,000 |
| 日本精化 | 6,700 | 1,549.00 | 10,378,300 |
| 扶桑化学工業 | 7,300 | 3,150.00 | 22,995,000 |
| トリケミカル研究所 | 1,700 | 9,680.00 | 16,456,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| A D E K A | 33,600 | 1,350.00 | 45,360,000 |
| 日油 | 27,600 | 3,700.00 | 102,120,000 |
| ハリマ化成グループ | 6,500 | 994.00 | 6,461,000 |
| 花王 | 179,400 | 8,764.00 | 1,572,261,600 |
| 第一工業製薬 | 2,900 | 4,535.00 | 13,151,500 |
| 三洋化成工業 | 4,300 | 4,250.00 | 18,275,000 |
| 大日本塗料 | 9,100 | 954.00 | 8,681,400 |
| 日本ペイントホールディングス | 60,600 | 6,150.00 | 372,690,000 |
| 関西ペイント | 82,700 | 2,001.00 | 165,482,700 |
| 中国塗料 | 21,800 | 836.00 | 18,224,800 |
| 日本特殊塗料 | 6,100 | 870.00 | 5,307,000 |
| 藤倉化成 | 13,200 | 500.00 | 6,600,000 |
| 太陽ホールディングス | 5,400 | 4,215.00 | 22,761,000 |
| D I C | 30,600 | 2,450.00 | 74,970,000 |
| サカタインクス | 15,800 | 934.00 | 14,757,200 |
| 東洋インキS Cホールディングス | 13,800 | 2,074.00 | 28,621,200 |
| T & K T O K A | 7,600 | 740.00 | 5,624,000 |
| 富士フィルムホールディングス | 143,800 | 5,226.00 | 751,498,800 |
| 資生堂 | 148,900 | 6,530.00 | 972,317,000 |
| ライオン | 97,300 | 2,379.00 | 231,476,700 |
| 高砂香料工業 | 5,200 | 2,143.00 | 11,143,600 |
| マンダム | 17,300 | 2,086.00 | 36,087,800 |
| ミルボン | 10,000 | 4,930.00 | 49,300,000 |
| ファンケル | 30,500 | 2,669.00 | 81,404,500 |
| コーセー | 14,100 | 14,300.00 | 201,630,000 |
| コタ | 5,700 | 1,228.00 | 6,999,600 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 31,900 | 2,115.00 | 67,468,500 |
| ノエビアホールディングス | 7,000 | 5,180.00 | 36,260,000 |
| エステー | 5,600 | 1,528.00 | 8,556,800 |
| アグロ カネショウ | 3,400 | 1,562.00 | 5,310,800 |
| コニシ | 12,100 | 1,406.00 | 17,012,600 |
| 長谷川香料 | 10,300 | 2,212.00 | 22,783,600 |
| 小林製薬 | 20,900 | 11,070.00 | 231,363,000 |
| 荒川化学工業 | 7,000 | 1,274.00 | 8,918,000 |
| メック | 5,800 | 1,602.00 | 9,291,600 |
| タカラバイオ | 19,800 | 2,441.00 | 48,331,800 |
| J C U | 9,200 | 2,374.00 | 21,840,800 |
| デクセリアルズ | 20,700 | 701.00 | 14,510,700 |
| アース製薬 | 5,800 | 6,300.00 | 36,540,000 |
| 北興化学工業 | 9,100 | 575.00 | 5,232,500 |
| 大成ラミック | 3,600 | 2,610.00 | 9,396,000 |
| クミアイ化学工業 | 31,400 | 893.00 | 28,040,200 |

| | | | |
|------------|---------|-----------|---------------|
| 日本農薬 | 16,100 | 432.00 | 6,955,200 |
| アキレス | 5,800 | 1,682.00 | 9,755,600 |
| 有沢製作所 | 12,800 | 838.00 | 10,726,400 |
| 日東電工 | 51,300 | 5,060.00 | 259,578,000 |
| レック | 8,800 | 1,166.00 | 10,260,800 |
| 三光合成 | 13,900 | 263.00 | 3,655,700 |
| 藤森工業 | 6,200 | 3,105.00 | 19,251,000 |
| 前澤化成工業 | 7,500 | 1,052.00 | 7,890,000 |
| 未来工業 | 5,000 | 1,944.00 | 9,720,000 |
| J S P | 5,000 | 1,368.00 | 6,840,000 |
| エフピコ | 8,500 | 8,230.00 | 69,955,000 |
| 天馬 | 5,400 | 1,535.00 | 8,289,000 |
| 信越ポリマー | 13,400 | 814.00 | 10,907,600 |
| 東リ | 23,100 | 260.00 | 6,006,000 |
| ニフコ | 26,800 | 1,968.00 | 52,742,400 |
| バルカー | 6,200 | 1,770.00 | 10,974,000 |
| ユニ・チャーム | 144,800 | 4,071.00 | 589,480,800 |
| 協和キリン | 75,100 | 2,446.00 | 183,694,600 |
| 武田薬品工業 | 623,400 | 3,986.00 | 2,484,872,400 |
| アステラス製薬 | 648,600 | 1,798.00 | 1,166,182,800 |
| 大日本住友製薬 | 55,900 | 1,461.00 | 81,669,900 |
| 塩野義製薬 | 95,600 | 5,790.00 | 553,524,000 |
| あすか製薬 | 9,800 | 1,120.00 | 10,976,000 |
| 日本新薬 | 19,700 | 7,640.00 | 150,508,000 |
| 中外製薬 | 78,000 | 13,215.00 | 1,030,770,000 |
| 科研製薬 | 12,900 | 5,800.00 | 74,820,000 |
| エーザイ | 89,600 | 7,182.00 | 643,507,200 |
| ロート製薬 | 38,600 | 3,265.00 | 126,029,000 |
| 小野薬品工業 | 172,100 | 2,580.00 | 444,018,000 |
| 久光製薬 | 19,700 | 5,060.00 | 99,682,000 |
| 持田製薬 | 10,500 | 4,160.00 | 43,680,000 |
| 参天製薬 | 139,400 | 1,898.00 | 264,581,200 |
| 扶桑薬品工業 | 4,100 | 2,255.00 | 9,245,500 |
| 日本ケミファ | 2,000 | 2,421.00 | 4,842,000 |
| ツムラ | 23,300 | 2,983.00 | 69,503,900 |
| 日医工 | 21,500 | 1,403.00 | 30,164,500 |
| キッセイ薬品工業 | 13,500 | 2,569.00 | 34,681,500 |
| 生化学工業 | 14,900 | 1,099.00 | 16,375,100 |
| 栄研化学 | 13,400 | 2,003.00 | 26,840,200 |
| 鳥居薬品 | 5,000 | 2,964.00 | 14,820,000 |
| J C R ファーマ | 5,300 | 10,790.00 | 57,187,000 |
| 東和薬品 | 9,600 | 2,222.00 | 21,331,200 |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|
| 富士製薬工業 | 5,900 | 1,185.00 | 6,991,500 |
| 沢井製薬 | 15,300 | 6,020.00 | 92,106,000 |
| ゼリア新薬工業 | 13,900 | 2,104.00 | 29,245,600 |
| 第一三共 | 214,200 | 7,487.00 | 1,603,715,400 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 16,800 | 2,335.00 | 39,228,000 |
| 大幸薬品 | 9,900 | 1,765.00 | 17,473,500 |
| ダイト | 4,700 | 3,595.00 | 16,896,500 |
| 大塚ホールディングス | 142,600 | 4,274.00 | 609,472,400 |
| 大正製薬ホールディングス | 15,700 | 6,760.00 | 106,132,000 |
| ペプチドリーム | 38,200 | 3,990.00 | 152,418,000 |
| 日本コークス工業 | 90,100 | 55.00 | 4,955,500 |
| ニチレキ | 9,400 | 1,419.00 | 13,338,600 |
| ユシロ化学工業 | 6,400 | 1,181.00 | 7,558,400 |
| 富士石油 | 29,000 | 182.00 | 5,278,000 |
| 出光興産 | 83,700 | 2,411.00 | 201,800,700 |
| J X T Gホールディングス | 1,131,100 | 376.10 | 425,406,710 |
| コスモエネルギーホールディングス | 22,100 | 1,553.00 | 34,321,300 |
| 横浜ゴム | 43,000 | 1,362.00 | 58,566,000 |
| TOYO TIRE | 44,000 | 1,215.00 | 53,460,000 |
| ブリヂストン | 215,700 | 3,273.00 | 705,986,100 |
| 住友ゴム工業 | 66,900 | 1,014.00 | 67,836,600 |
| オカモト | 4,700 | 4,410.00 | 20,727,000 |
| ニッタ | 8,100 | 1,887.00 | 15,284,700 |
| 住友理工 | 16,100 | 570.00 | 9,177,000 |
| 三ツ星ベルト | 10,200 | 1,450.00 | 14,790,000 |
| バンドー化学 | 14,400 | 621.00 | 8,942,400 |
| 日東紡績 | 11,200 | 5,220.00 | 58,464,000 |
| A G C | 73,800 | 2,591.00 | 191,215,800 |
| 日本板硝子 | 11,500 | 318.00 | 3,657,000 |
| 日本山村硝子 | 5,400 | 848.00 | 4,579,200 |
| 日本電気硝子 | 30,600 | 1,466.00 | 44,859,600 |
| オハラ | 4,000 | 907.00 | 3,628,000 |
| 住友大阪セメント | 14,700 | 3,590.00 | 52,773,000 |
| 太平洋セメント | 47,500 | 2,110.00 | 100,225,000 |
| 日本ヒューム | 10,600 | 630.00 | 6,678,000 |
| 日本コンクリート工業 | 22,200 | 250.00 | 5,550,000 |
| 三谷セキサン | 3,600 | 4,895.00 | 17,622,000 |
| アジアパイルホールディングス | 15,000 | 407.00 | 6,105,000 |
| 東海カーボン | 78,700 | 890.00 | 70,043,000 |
| 日本カーボン | 3,900 | 3,300.00 | 12,870,000 |
| 東洋炭素 | 4,900 | 1,406.00 | 6,889,400 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 4,200 | 3,435.00 | 14,427,000 |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|
| TOTO | 53,500 | 3,640.00 | 194,740,000 |
| 日本碍子 | 91,000 | 1,336.00 | 121,576,000 |
| 日本特殊陶業 | 58,100 | 1,548.00 | 89,938,800 |
| MARUWA | 2,900 | 6,710.00 | 19,459,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 2,400 | 2,154.00 | 5,169,600 |
| 黒崎播磨 | 1,700 | 3,745.00 | 6,366,500 |
| ヨータイ | 8,200 | 605.00 | 4,961,000 |
| 東京窯業 | 16,500 | 293.00 | 4,834,500 |
| フジミインコーポレーテッド | 6,900 | 2,905.00 | 20,044,500 |
| ニチアス | 20,100 | 2,061.00 | 41,426,100 |
| ニチハ | 10,400 | 1,913.00 | 19,895,200 |
| 日本製鉄 | 331,900 | 877.70 | 291,308,630 |
| 神戸製鋼所 | 137,400 | 350.00 | 48,090,000 |
| 中山製鋼所 | 13,000 | 380.00 | 4,940,000 |
| 合同製鐵 | 4,600 | 1,952.00 | 8,979,200 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 198,700 | 699.00 | 138,891,300 |
| 東京製鐵 | 36,600 | 686.00 | 25,107,600 |
| 共英製鋼 | 8,700 | 1,336.00 | 11,623,200 |
| 大和工業 | 16,300 | 2,114.00 | 34,458,200 |
| 東京鐵鋼 | 4,300 | 1,064.00 | 4,575,200 |
| 大阪製鐵 | 4,500 | 1,158.00 | 5,211,000 |
| 淀川製鋼所 | 9,700 | 1,691.00 | 16,402,700 |
| 丸一鋼管 | 24,000 | 2,444.00 | 58,656,000 |
| モリ工業 | 2,600 | 2,296.00 | 5,969,600 |
| 大同特殊鋼 | 12,100 | 3,445.00 | 41,684,500 |
| 日本冶金工業 | 6,300 | 1,586.00 | 9,991,800 |
| 山陽特殊製鋼 | 6,300 | 898.00 | 5,657,400 |
| 愛知製鋼 | 4,200 | 2,814.00 | 11,818,800 |
| 日立金属 | 80,600 | 1,067.00 | 86,000,200 |
| 大平洋金属 | 5,500 | 1,720.00 | 9,460,000 |
| 新日本電工 | 53,400 | 147.00 | 7,849,800 |
| 栗本鐵工所 | 4,300 | 1,845.00 | 7,933,500 |
| 三菱製鋼 | 6,700 | 810.00 | 5,427,000 |
| シンニッタン | 15,600 | 247.00 | 3,853,200 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 11,000 | 559.00 | 6,149,000 |
| 日本輕金属ホールディングス | 191,100 | 169.00 | 32,295,900 |
| 三井金属鉱業 | 20,400 | 1,983.00 | 40,453,200 |
| 東邦亜鉛 | 4,600 | 1,267.00 | 5,828,200 |
| 三菱マテリアル | 49,100 | 2,222.00 | 109,100,200 |
| 住友金属鉱山 | 94,900 | 2,680.00 | 254,332,000 |
| DOWAホールディングス | 18,700 | 2,933.00 | 54,847,100 |
| 古河機械金属 | 13,100 | 1,065.00 | 13,951,500 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 9,100 | 911.00 | 8,290,100 |
| 東邦チタニウム | 14,700 | 595.00 | 8,746,500 |
| U A C J | 11,400 | 1,707.00 | 19,459,800 |
| C Kサンエツ | 2,000 | 2,758.00 | 5,516,000 |
| 古河電気工業 | 22,700 | 1,996.00 | 45,309,200 |
| 住友電気工業 | 276,100 | 1,079.50 | 298,049,950 |
| フジクラ | 92,900 | 304.00 | 28,241,600 |
| 昭和電線ホールディングス | 9,600 | 1,061.00 | 10,185,600 |
| タツタ電線 | 16,300 | 510.00 | 8,313,000 |
| リョービ | 8,800 | 1,216.00 | 10,700,800 |
| アーレスティ | 13,200 | 362.00 | 4,778,400 |
| アサヒホールディングス | 13,500 | 2,348.00 | 31,698,000 |
| 稲葉製作所 | 6,500 | 1,288.00 | 8,372,000 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 3,300 | 1,559.00 | 5,144,700 |
| トーカロ | 20,700 | 996.00 | 20,617,200 |
| アルファC o | 4,300 | 928.00 | 3,990,400 |
| S U M C O | 88,800 | 1,490.00 | 132,312,000 |
| 川田テクノロジーズ | 1,800 | 4,870.00 | 8,766,000 |
| R S Technologies | 2,600 | 2,518.00 | 6,546,800 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 48,000 | 1,119.00 | 53,712,000 |
| ホッカンホールディングス | 4,800 | 1,571.00 | 7,540,800 |
| コロナ | 5,900 | 943.00 | 5,563,700 |
| 横河ブリッジホールディングス | 14,000 | 1,879.00 | 26,306,000 |
| 三和ホールディングス | 70,800 | 802.00 | 56,781,600 |
| 文化シャッター | 22,500 | 769.00 | 17,302,500 |
| 三協立山 | 10,500 | 837.00 | 8,788,500 |
| アルインコ | 7,700 | 990.00 | 7,623,000 |
| L I X I Lグループ | 109,600 | 1,249.00 | 136,890,400 |
| ノーリツ | 15,700 | 1,196.00 | 18,777,200 |
| 長府製作所 | 7,300 | 2,337.00 | 17,060,100 |
| リンナイ | 14,600 | 8,140.00 | 118,844,000 |
| 日東精工 | 12,400 | 466.00 | 5,778,400 |
| 岡部 | 15,400 | 750.00 | 11,550,000 |
| ジーテクト | 8,900 | 1,067.00 | 9,496,300 |
| 東プレ | 13,600 | 1,228.00 | 16,700,800 |
| 高周波熱錬 | 15,000 | 592.00 | 8,880,000 |
| 東京製綱 | 7,900 | 541.00 | 4,273,900 |
| パイオラックス | 10,100 | 1,567.00 | 15,826,700 |
| エイチワン | 9,300 | 505.00 | 4,696,500 |
| 日本発條 | 79,600 | 705.00 | 56,118,000 |
| 三益半導体工業 | 5,700 | 2,065.00 | 11,770,500 |
| 日本製綱所 | 23,300 | 1,265.00 | 29,474,500 |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|
| 三浦工業 | 32,200 | 4,440.00 | 142,968,000 |
| タクマ | 24,900 | 1,165.00 | 29,008,500 |
| ツガミ | 15,600 | 892.00 | 13,915,200 |
| オークマ | 8,500 | 3,670.00 | 31,195,000 |
| 芝浦機械 | 8,800 | 2,076.00 | 18,268,800 |
| アマダ | 92,700 | 934.00 | 86,581,800 |
| アイダエンジニアリング | 18,800 | 741.00 | 13,930,800 |
| F U J I | 30,600 | 1,756.00 | 53,733,600 |
| 牧野フライス製作所 | 8,600 | 2,894.00 | 24,888,400 |
| オーエスジー | 35,000 | 1,335.00 | 46,725,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 20,300 | 480.00 | 9,744,000 |
| D M G 森精機 | 46,600 | 1,017.00 | 47,392,200 |
| ソディック | 18,100 | 728.00 | 13,176,800 |
| ディスコ | 10,000 | 24,090.00 | 240,900,000 |
| 日東工器 | 4,500 | 1,849.00 | 8,320,500 |
| 日進工具 | 2,600 | 2,702.00 | 7,025,200 |
| パンチ工業 | 10,100 | 345.00 | 3,484,500 |
| 豊和工業 | 5,700 | 745.00 | 4,246,500 |
| 島精機製作所 | 12,100 | 1,567.00 | 18,960,700 |
| オプトラン | 8,500 | 2,829.00 | 24,046,500 |
| イワキポンプ | 4,900 | 946.00 | 4,635,400 |
| フリー | 9,200 | 816.00 | 7,507,200 |
| ヤマシンフィルタ | 16,300 | 817.00 | 13,317,100 |
| 日阪製作所 | 10,600 | 751.00 | 7,960,600 |
| やまびこ | 14,000 | 822.00 | 11,508,000 |
| 平田機工 | 3,500 | 4,865.00 | 17,027,500 |
| ペガサスミシン製造 | 13,700 | 324.00 | 4,438,800 |
| マルマエ | 4,200 | 868.00 | 3,645,600 |
| タツモ | 3,900 | 1,099.00 | 4,286,100 |
| ナブテスコ | 43,400 | 2,939.00 | 127,552,600 |
| 三井海洋開発 | 8,200 | 1,442.00 | 11,824,400 |
| レオン自動機 | 7,700 | 1,166.00 | 8,978,200 |
| S M C | 23,500 | 48,900.00 | 1,149,150,000 |
| ホソカワミクロン | 2,600 | 4,950.00 | 12,870,000 |
| ユニオンツール | 3,000 | 2,758.00 | 8,274,000 |
| オイレス工業 | 9,700 | 1,397.00 | 13,550,900 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 2,800 | 2,882.00 | 8,069,600 |
| サトーホールディングス | 10,800 | 2,143.00 | 23,144,400 |
| 技研製作所 | 6,800 | 3,965.00 | 26,962,000 |
| 日精樹脂工業 | 7,700 | 980.00 | 7,546,000 |
| 小松製作所 | 338,700 | 1,978.00 | 669,948,600 |
| 住友重機械工業 | 42,300 | 2,185.00 | 92,425,500 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|
| 日立建機 | 29,400 | 2,459.00 | 72,294,600 |
| 日工 | 13,400 | 568.00 | 7,611,200 |
| 巴工業 | 4,200 | 1,993.00 | 8,370,600 |
| 井関農機 | 8,100 | 1,177.00 | 9,533,700 |
| T O W A | 8,800 | 883.00 | 7,770,400 |
| 北川鉄工所 | 3,700 | 1,533.00 | 5,672,100 |
| ローツェ | 3,400 | 4,300.00 | 14,620,000 |
| クボタ | 397,400 | 1,298.00 | 515,825,200 |
| 荏原実業 | 2,600 | 2,229.00 | 5,795,400 |
| 三菱化工機 | 3,700 | 1,595.00 | 5,901,500 |
| 月島機械 | 14,300 | 1,210.00 | 17,303,000 |
| 帝国電機製作所 | 7,300 | 1,252.00 | 9,139,600 |
| 新東工業 | 17,200 | 730.00 | 12,556,000 |
| 澁谷工業 | 6,600 | 2,639.00 | 17,417,400 |
| アイチ コーポレーション | 14,100 | 720.00 | 10,152,000 |
| 小森コーポレーション | 19,000 | 748.00 | 14,212,000 |
| 鶴見製作所 | 6,000 | 1,993.00 | 11,958,000 |
| 住友精密工業 | 2,100 | 2,229.00 | 4,680,900 |
| 酒井重工業 | 1,900 | 2,026.00 | 3,849,400 |
| 荏原製作所 | 31,300 | 2,287.00 | 71,583,100 |
| 西島製作所 | 10,400 | 751.00 | 7,810,400 |
| 北越工業 | 9,300 | 993.00 | 9,234,900 |
| ダイキン工業 | 95,400 | 13,455.00 | 1,283,607,000 |
| オルガノ | 2,700 | 5,570.00 | 15,039,000 |
| トーヨーカネツ | 4,200 | 1,910.00 | 8,022,000 |
| 栗田工業 | 40,200 | 2,884.00 | 115,936,800 |
| 椿本チエイン | 9,800 | 2,462.00 | 24,127,600 |
| 大同工業 | 6,800 | 630.00 | 4,284,000 |
| アネスト岩田 | 11,900 | 842.00 | 10,019,800 |
| ダイフク | 38,000 | 6,990.00 | 265,620,000 |
| 加藤製作所 | 6,000 | 1,252.00 | 7,512,000 |
| タダノ | 37,200 | 817.00 | 30,392,400 |
| フジテック | 26,300 | 1,536.00 | 40,396,800 |
| C K D | 21,000 | 1,736.00 | 36,456,000 |
| キトー | 7,500 | 1,035.00 | 7,762,500 |
| 平和 | 21,100 | 1,805.00 | 38,085,500 |
| 理想科学工業 | 6,900 | 1,481.00 | 10,218,900 |
| S A N K Y O | 17,100 | 2,961.00 | 50,633,100 |
| 日本金銭機械 | 10,700 | 544.00 | 5,820,800 |
| 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 | 3,160.00 | 14,220,000 |
| ダイコク電機 | 5,300 | 1,127.00 | 5,973,100 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|---------------|
| 竹内製作所 | 12,400 | 1,479.00 | 18,339,600 |
| アマノ | 19,700 | 2,210.00 | 43,537,000 |
| JUKI | 11,900 | 581.00 | 6,913,900 |
| マックス | 11,500 | 1,588.00 | 18,262,000 |
| グローリー | 19,300 | 2,349.00 | 45,335,700 |
| 新晃工業 | 7,200 | 1,371.00 | 9,871,200 |
| 大和冷機工業 | 11,200 | 913.00 | 10,225,600 |
| セガサミーホールディングス | 75,000 | 1,279.00 | 95,925,000 |
| 日本ピストンリング | 4,400 | 1,202.00 | 5,288,800 |
| リケン | 3,700 | 2,965.00 | 10,970,500 |
| T P R | 9,000 | 1,236.00 | 11,124,000 |
| ツバキ・ナカシマ | 16,500 | 707.00 | 11,665,500 |
| ホシザキ | 21,900 | 8,040.00 | 176,076,000 |
| 大豊工業 | 8,200 | 533.00 | 4,370,600 |
| 日本精工 | 138,200 | 711.00 | 98,260,200 |
| NTN | 174,500 | 198.00 | 34,551,000 |
| ジェイテクト | 69,200 | 758.00 | 52,453,600 |
| 不二越 | 7,000 | 3,005.00 | 21,035,000 |
| 日本トムソン | 24,300 | 363.00 | 8,820,900 |
| THK | 43,400 | 2,445.00 | 106,113,000 |
| ユーシン精機 | 7,700 | 653.00 | 5,028,100 |
| 前澤給装工業 | 3,700 | 2,045.00 | 7,566,500 |
| イーグル工業 | 9,600 | 668.00 | 6,412,800 |
| 日本ピラー工業 | 8,000 | 1,310.00 | 10,480,000 |
| キッツ | 31,300 | 659.00 | 20,626,700 |
| マキタ | 97,400 | 3,380.00 | 329,212,000 |
| 日立造船 | 60,300 | 346.00 | 20,863,800 |
| 三菱重工業 | 125,500 | 2,709.00 | 339,979,500 |
| I H I | 54,200 | 1,277.00 | 69,213,400 |
| スター精密 | 11,800 | 1,128.00 | 13,310,400 |
| 日清紡ホールディングス | 50,400 | 715.00 | 36,036,000 |
| イビデン | 45,800 | 2,444.00 | 111,935,200 |
| コニカミノルタ | 166,300 | 404.00 | 67,185,200 |
| ブラザー工業 | 90,600 | 1,748.00 | 158,368,800 |
| ミネベアミツミ | 137,900 | 1,673.00 | 230,706,700 |
| 日立製作所 | 359,800 | 3,047.00 | 1,096,310,600 |
| 三菱電機 | 748,200 | 1,307.50 | 978,271,500 |
| 富士電機 | 44,900 | 2,484.00 | 111,531,600 |
| 東洋電機製造 | 4,200 | 1,240.00 | 5,208,000 |
| 安川電機 | 80,300 | 3,270.00 | 262,581,000 |
| シンフォニアテクノロジー | 11,000 | 943.00 | 10,373,000 |
| 明電舎 | 14,000 | 1,616.00 | 22,624,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|
| オリジン | 3,400 | 1,433.00 | 4,872,200 |
| 山洋電気 | 3,700 | 4,500.00 | 16,650,000 |
| デンヨー | 6,700 | 2,014.00 | 13,493,800 |
| 東芝テック | 9,500 | 3,420.00 | 32,490,000 |
| 芝浦メカトロニクス | 1,700 | 2,537.00 | 4,312,900 |
| マブチモーター | 20,500 | 3,230.00 | 66,215,000 |
| 日本電産 | 180,300 | 5,686.00 | 1,025,185,800 |
| トレックス・セミコンダクター | 5,500 | 1,044.00 | 5,742,000 |
| 東光高岳 | 6,500 | 888.00 | 5,772,000 |
| 宮越ホールディングス | 4,300 | 545.00 | 2,343,500 |
| ダイヘン | 8,000 | 2,917.00 | 23,336,000 |
| ヤーマン | 13,800 | 696.00 | 9,604,800 |
| JVCケンウッド | 65,300 | 176.00 | 11,492,800 |
| ミマキエンジニアリング | 11,300 | 404.00 | 4,565,200 |
| 第一精工 | 3,900 | 2,199.00 | 8,576,100 |
| 日新電機 | 18,100 | 989.00 | 17,900,900 |
| 大崎電気工業 | 18,000 | 527.00 | 9,486,000 |
| オムロン | 66,800 | 6,390.00 | 426,852,000 |
| 日東工業 | 10,900 | 1,795.00 | 19,565,500 |
| I D E C | 11,300 | 1,515.00 | 17,119,500 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 25,500 | 1,466.00 | 37,383,000 |
| サクサホールディングス | 3,000 | 1,740.00 | 5,220,000 |
| メルコホールディングス | 3,200 | 2,800.00 | 8,960,000 |
| 日本電気 | 90,800 | 4,195.00 | 380,906,000 |
| 富士通 | 72,300 | 10,350.00 | 748,305,000 |
| 沖電気工業 | 31,000 | 997.00 | 30,907,000 |
| 電気興業 | 4,000 | 2,460.00 | 9,840,000 |
| サンケン電気 | 8,600 | 2,123.00 | 18,257,800 |
| アイホン | 5,100 | 1,533.00 | 7,818,300 |
| ルネサスエレクトロニクス | 360,100 | 480.00 | 172,848,000 |
| セイコーエプソン | 91,900 | 1,113.00 | 102,284,700 |
| ワコム | 54,900 | 377.00 | 20,697,300 |
| アルバック | 14,000 | 2,893.00 | 40,502,000 |
| E I Z O | 5,900 | 3,270.00 | 19,293,000 |
| 日本信号 | 19,400 | 995.00 | 19,303,000 |
| 京三製作所 | 19,700 | 494.00 | 9,731,800 |
| 能美防災 | 10,100 | 2,050.00 | 20,705,000 |
| ホーチキ | 5,800 | 1,352.00 | 7,841,600 |
| エレコム | 8,300 | 4,455.00 | 36,976,500 |
| パナソニック | 855,400 | 773.60 | 661,737,440 |
| シャープ | 86,600 | 1,153.00 | 99,849,800 |
| アンリツ | 48,400 | 2,165.00 | 104,786,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| 富士通ゼネラル | 20,700 | 1,691.00 | 35,003,700 |
| ソニー | 473,700 | 6,779.00 | 3,211,212,300 |
| T D K | 36,000 | 8,850.00 | 318,600,000 |
| 帝国通信工業 | 5,800 | 1,189.00 | 6,896,200 |
| タムラ製作所 | 26,300 | 411.00 | 10,809,300 |
| アルプスアルパイン | 66,900 | 994.00 | 66,498,600 |
| 日本トリム | 1,600 | 2,856.00 | 4,569,600 |
| ローランド ディー . ジー . | 5,300 | 1,277.00 | 6,768,100 |
| フォスター電機 | 8,700 | 1,151.00 | 10,013,700 |
| S M K | 2,400 | 2,413.00 | 5,791,200 |
| ヨコオ | 5,000 | 2,346.00 | 11,730,000 |
| ホシデン | 20,000 | 947.00 | 18,940,000 |
| ヒロセ電機 | 11,500 | 11,250.00 | 129,375,000 |
| 日本航空電子工業 | 17,200 | 1,385.00 | 23,822,000 |
| T O A | 9,600 | 694.00 | 6,662,400 |
| マクセルホールディングス | 16,500 | 969.00 | 15,988,500 |
| 古野電気 | 11,000 | 795.00 | 8,745,000 |
| ユニデンホールディングス | 2,800 | 1,795.00 | 5,026,000 |
| スミダコーポレーション | 6,900 | 677.00 | 4,671,300 |
| アイコム | 4,600 | 2,600.00 | 11,960,000 |
| リオン | 3,800 | 2,250.00 | 8,550,000 |
| 船井電機 | 10,700 | 427.00 | 4,568,900 |
| 横河電機 | 69,000 | 1,394.00 | 96,186,000 |
| 新電元工業 | 3,000 | 2,373.00 | 7,119,000 |
| アズビル | 47,000 | 2,776.00 | 130,472,000 |
| 東亜ディーケーケー | 5,500 | 884.00 | 4,862,000 |
| 日本光電工業 | 31,300 | 3,985.00 | 124,730,500 |
| チノー | 4,200 | 1,286.00 | 5,401,200 |
| 共和電業 | 15,200 | 380.00 | 5,776,000 |
| 堀場製作所 | 14,900 | 5,370.00 | 80,013,000 |
| アドバンテスト | 55,600 | 5,180.00 | 288,008,000 |
| エスペック | 7,000 | 1,693.00 | 11,851,000 |
| キーエンス | 67,900 | 37,930.00 | 2,575,447,000 |
| 日置電機 | 4,200 | 3,000.00 | 12,600,000 |
| シスメックス | 53,600 | 7,380.00 | 395,568,000 |
| 日本マイクロニクス | 14,100 | 822.00 | 11,590,200 |
| メガチップス | 7,800 | 1,593.00 | 12,425,400 |
| O B A R A G R O U P | 4,100 | 2,791.00 | 11,443,100 |
| コーセル | 11,700 | 910.00 | 10,647,000 |
| イリソ電子工業 | 6,500 | 2,832.00 | 18,408,000 |
| オブテックスグループ | 13,100 | 1,189.00 | 15,575,900 |
| 千代田インテグレ | 4,500 | 1,720.00 | 7,740,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| レーザーテック | 32,800 | 6,140.00 | 201,392,000 |
| スタンレー電気 | 52,300 | 2,443.00 | 127,768,900 |
| 岩崎電気 | 4,400 | 1,356.00 | 5,966,400 |
| ウシオ電機 | 42,400 | 1,110.00 | 47,064,000 |
| ハリオス テクノ ホールディング | 13,100 | 330.00 | 4,323,000 |
| 日本セラミック | 8,000 | 1,937.00 | 15,496,000 |
| 山一電機 | 6,000 | 1,390.00 | 8,340,000 |
| 図研 | 5,200 | 2,372.00 | 12,334,400 |
| 日本電子 | 14,800 | 3,025.00 | 44,770,000 |
| カシオ計算機 | 66,500 | 1,672.00 | 111,188,000 |
| ファナック | 71,200 | 16,630.00 | 1,184,056,000 |
| 日本シイエムケイ | 19,300 | 406.00 | 7,835,800 |
| エンプラス | 4,700 | 2,185.00 | 10,269,500 |
| ローム | 33,100 | 6,400.00 | 211,840,000 |
| 浜松ホトニクス | 53,600 | 4,710.00 | 252,456,000 |
| 三井ハイテック | 9,000 | 1,163.00 | 10,467,000 |
| 新光電気工業 | 25,200 | 1,275.00 | 32,130,000 |
| 京セラ | 105,200 | 5,953.00 | 626,255,600 |
| 太陽誘電 | 33,100 | 2,866.00 | 94,864,600 |
| 村田製作所 | 219,900 | 5,783.00 | 1,271,681,700 |
| 双葉電子工業 | 12,300 | 1,035.00 | 12,730,500 |
| 北陸電気工業 | 4,900 | 935.00 | 4,581,500 |
| ニチコン | 26,600 | 666.00 | 17,715,600 |
| 日本ケミコン | 6,500 | 1,131.00 | 7,351,500 |
| K O A | 11,900 | 888.00 | 10,567,200 |
| 市光工業 | 12,000 | 451.00 | 5,412,000 |
| 小糸製作所 | 44,400 | 3,855.00 | 171,162,000 |
| ミツバ | 14,400 | 428.00 | 6,163,200 |
| S C R E E Nホールディングス | 13,200 | 4,900.00 | 64,680,000 |
| キャノン電子 | 8,100 | 1,569.00 | 12,708,900 |
| キャノン | 402,700 | 2,219.00 | 893,591,300 |
| リコー | 190,200 | 720.00 | 136,944,000 |
| 象印マホービン | 22,400 | 1,537.00 | 34,428,800 |
| 東京エレクトロン | 47,500 | 21,885.00 | 1,039,537,500 |
| トヨタ紡織 | 22,100 | 1,293.00 | 28,575,300 |
| ユニプレス | 14,900 | 917.00 | 13,663,300 |
| 豊田自動織機 | 60,200 | 5,270.00 | 317,254,000 |
| モリタホールディングス | 13,600 | 1,629.00 | 22,154,400 |
| 三櫻工業 | 10,700 | 666.00 | 7,126,200 |
| デンソー | 164,800 | 3,668.00 | 604,486,400 |
| 東海理化電機製作所 | 19,500 | 1,335.00 | 26,032,500 |
| 川崎重工業 | 58,400 | 1,555.00 | 90,812,000 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 名村造船所 | 29,600 | 179.00 | 5,298,400 | |
| 日本車輛製造 | 3,300 | 2,713.00 | 8,952,900 | |
| 三菱ロジスネクスト | 10,700 | 946.00 | 10,122,200 | |
| 日産自動車 | 885,400 | 360.50 | 319,186,700 | |
| いすゞ自動車 | 219,600 | 757.40 | 166,325,040 | |
| トヨタ自動車 | 835,800 | 6,659.00 | 5,565,592,200 | 代用有価証券 400,000株 |
| 日野自動車 | 95,100 | 600.00 | 57,060,000 | |
| 三菱自動車工業 | 279,100 | 294.00 | 82,055,400 | |
| エフテック | 7,600 | 452.00 | 3,435,200 | |
| 武蔵精密工業 | 17,300 | 836.00 | 14,462,800 | |
| 日産車体 | 15,300 | 845.00 | 12,928,500 | |
| 新明和工業 | 20,400 | 1,079.00 | 22,011,600 | |
| 極東開発工業 | 13,900 | 1,295.00 | 18,000,500 | |
| 日信工業 | 15,700 | 2,214.00 | 34,759,800 | |
| トピー工業 | 6,800 | 1,238.00 | 8,418,400 | |
| ティラド | 4,100 | 1,305.00 | 5,350,500 | |
| タチエス | 12,300 | 947.00 | 11,648,100 | |
| N O K | 41,100 | 1,218.00 | 50,059,800 | |
| フタバ産業 | 21,700 | 497.00 | 10,784,900 | |
| K Y B | 8,300 | 2,061.00 | 17,106,300 | |
| 大同メタル工業 | 17,200 | 529.00 | 9,098,800 | |
| プレス工業 | 42,100 | 252.00 | 10,609,200 | |
| 太平洋工業 | 16,300 | 875.00 | 14,262,500 | |
| ケーヒン | 17,700 | 2,563.00 | 45,365,100 | |
| 河西工業 | 11,400 | 494.00 | 5,631,600 | |
| アイシン精機 | 61,500 | 2,877.00 | 176,935,500 | |
| マツダ | 219,800 | 578.00 | 127,044,400 | |
| 今仙電機製作所 | 10,000 | 730.00 | 7,300,000 | |
| 本田技研工業 | 589,200 | 2,533.50 | 1,492,738,200 | |
| スズキ | 149,100 | 3,123.00 | 465,639,300 | |
| S U B A R U | 233,100 | 2,072.50 | 483,099,750 | |
| 安永 | 4,500 | 959.00 | 4,315,500 | |
| ヤマハ発動機 | 97,000 | 1,318.00 | 127,846,000 | |
| ショーワ | 17,900 | 2,260.00 | 40,454,000 | |
| T B K | 13,100 | 467.00 | 6,117,700 | |
| エクセディ | 10,200 | 1,646.00 | 16,789,200 | |
| 豊田合成 | 24,500 | 1,898.00 | 46,501,000 | |
| 愛三工業 | 14,100 | 547.00 | 7,712,700 | |
| 日本プラスト | 8,800 | 418.00 | 3,678,400 | |
| ヨロズ | 8,200 | 1,096.00 | 8,987,200 | |
| エフ・シー・シー | 12,500 | 1,446.00 | 18,075,000 | |
| シマノ | 28,000 | 16,020.00 | 448,560,000 | |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|
| テイ・エス テック | 17,500 | 2,796.00 | 48,930,000 |
| ジャムコ | 5,800 | 637.00 | 3,694,600 |
| テルモ | 212,200 | 3,610.00 | 766,042,000 |
| 日機装 | 22,800 | 807.00 | 18,399,600 |
| 日本エム・ディ・エム | 5,200 | 1,530.00 | 7,956,000 |
| 島津製作所 | 88,900 | 2,722.00 | 241,985,800 |
| JMS | 8,300 | 803.00 | 6,664,900 |
| 長野計器 | 7,800 | 794.00 | 6,193,200 |
| ブイ・テクノロジー | 3,500 | 3,540.00 | 12,390,000 |
| 東京計器 | 6,400 | 747.00 | 4,780,800 |
| インターアクション | 4,400 | 2,375.00 | 10,450,000 |
| 東京精密 | 13,500 | 3,270.00 | 44,145,000 |
| マニー | 30,200 | 2,306.00 | 69,641,200 |
| ニコン | 121,300 | 974.00 | 118,146,200 |
| トプコン | 39,100 | 835.00 | 32,648,500 |
| オリンパス | 415,700 | 1,714.00 | 712,509,800 |
| 理研計器 | 6,400 | 2,060.00 | 13,184,000 |
| タムロン | 6,300 | 1,712.00 | 10,785,600 |
| HOYA | 149,700 | 9,920.00 | 1,485,024,000 |
| ノーリツ鋼機 | 5,600 | 1,169.00 | 6,546,400 |
| エー・アンド・デイ | 8,100 | 703.00 | 5,694,300 |
| 朝日インテック | 63,800 | 2,802.00 | 178,767,600 |
| シチズン時計 | 89,400 | 362.00 | 32,362,800 |
| メニコン | 10,400 | 4,855.00 | 50,492,000 |
| 松風 | 4,300 | 1,614.00 | 6,940,200 |
| セイコーホールディングス | 10,300 | 1,744.00 | 17,963,200 |
| ニプロ | 53,700 | 1,213.00 | 65,138,100 |
| スノーピーク | 6,200 | 728.00 | 4,513,600 |
| パラマウントベッドホールディングス | 7,900 | 4,480.00 | 35,392,000 |
| トランザクション | 6,000 | 967.00 | 5,802,000 |
| ニホンフラッシュ | 7,600 | 1,178.00 | 8,952,800 |
| 前田工織 | 8,400 | 1,978.00 | 16,615,200 |
| 永大産業 | 15,600 | 283.00 | 4,414,800 |
| アートネイチャー | 10,600 | 658.00 | 6,974,800 |
| バンダイナムコホールディングス | 77,600 | 5,426.00 | 421,057,600 |
| SHOEI | 7,600 | 2,030.00 | 15,428,000 |
| フランスベッドホールディングス | 10,300 | 866.00 | 8,919,800 |
| パイロットコーポレーション | 12,400 | 3,700.00 | 45,880,000 |
| 萩原工業 | 5,200 | 1,263.00 | 6,567,600 |
| トッパン・フォームズ | 16,000 | 993.00 | 15,888,000 |
| フジシールインターナショナル | 17,100 | 1,879.00 | 32,130,900 |
| タカラトミー | 34,500 | 833.00 | 28,738,500 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|-----------|---------------|
| 廣濟堂 | 7,600 | 769.00 | 5,844,400 |
| プロネクサス | 7,400 | 1,070.00 | 7,918,000 |
| 大建工業 | 5,500 | 1,613.00 | 8,871,500 |
| 凸版印刷 | 104,100 | 1,589.00 | 165,414,900 |
| 大日本印刷 | 97,700 | 2,293.00 | 224,026,100 |
| 共同印刷 | 2,900 | 2,796.00 | 8,108,400 |
| N I S S H A | 14,600 | 753.00 | 10,993,800 |
| T A K A R A & C O M P A N Y | 4,500 | 1,794.00 | 8,073,000 |
| アシックス | 62,700 | 1,003.00 | 62,888,100 |
| 小松ウオール工業 | 3,100 | 1,780.00 | 5,518,000 |
| ヤマハ | 44,300 | 4,225.00 | 187,167,500 |
| 河合楽器製作所 | 2,800 | 2,559.00 | 7,165,200 |
| クリナップ | 9,300 | 523.00 | 4,863,900 |
| ピジョン | 45,500 | 3,915.00 | 178,132,500 |
| オリバー | 2,000 | 2,660.00 | 5,320,000 |
| キングジム | 8,200 | 861.00 | 7,060,200 |
| リンテック | 17,700 | 2,317.00 | 41,010,900 |
| イトーキ | 20,000 | 334.00 | 6,680,000 |
| 任天堂 | 45,900 | 46,840.00 | 2,149,956,000 |
| 三菱鉛筆 | 12,500 | 1,376.00 | 17,200,000 |
| タカラスタンド | 14,500 | 1,620.00 | 23,490,000 |
| コクヨ | 36,000 | 1,387.00 | 49,932,000 |
| ナカバヤシ | 9,900 | 545.00 | 5,395,500 |
| グローブライド | 4,000 | 1,698.00 | 6,792,000 |
| オカムラ | 26,000 | 784.00 | 20,384,000 |
| 美津濃 | 7,000 | 1,825.00 | 12,775,000 |
| 東京電力ホールディングス | 592,600 | 365.00 | 216,299,000 |
| 中部電力 | 228,900 | 1,516.00 | 347,012,400 |
| 関西電力 | 284,100 | 1,146.00 | 325,578,600 |
| 中国電力 | 107,900 | 1,485.00 | 160,231,500 |
| 北陸電力 | 69,900 | 740.00 | 51,726,000 |
| 東北電力 | 184,600 | 1,054.00 | 194,568,400 |
| 四国電力 | 68,300 | 820.00 | 56,006,000 |
| 九州電力 | 153,200 | 876.00 | 134,203,200 |
| 北海道電力 | 70,500 | 405.00 | 28,552,500 |
| 沖縄電力 | 14,200 | 1,952.00 | 27,718,400 |
| 電源開発 | 59,100 | 2,156.00 | 127,419,600 |
| イーレックス | 11,200 | 1,451.00 | 16,251,200 |
| レノバ | 13,400 | 1,058.00 | 14,177,200 |
| 東京瓦斯 | 144,800 | 2,403.50 | 348,026,800 |
| 大阪瓦斯 | 144,500 | 2,068.00 | 298,826,000 |
| 東邦瓦斯 | 36,800 | 5,630.00 | 207,184,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| 北海道瓦斯 | 5,600 | 1,572.00 | 8,803,200 |
| 広島ガス | 22,700 | 365.00 | 8,285,500 |
| 西部瓦斯 | 8,600 | 2,670.00 | 22,962,000 |
| 静岡ガス | 21,100 | 989.00 | 20,867,900 |
| メタウォーター | 3,900 | 4,090.00 | 15,951,000 |
| SBSホールディングス | 6,800 | 1,826.00 | 12,416,800 |
| 東武鉄道 | 78,200 | 3,675.00 | 287,385,000 |
| 相鉄ホールディングス | 24,200 | 2,775.00 | 67,155,000 |
| 東急 | 187,500 | 1,632.00 | 306,000,000 |
| 京浜急行電鉄 | 95,700 | 1,826.00 | 174,748,200 |
| 小田急電鉄 | 110,500 | 2,430.00 | 268,515,000 |
| 京王電鉄 | 38,800 | 6,210.00 | 240,948,000 |
| 京成電鉄 | 51,900 | 3,125.00 | 162,187,500 |
| 富士急行 | 10,500 | 2,888.00 | 30,324,000 |
| 新京成電鉄 | 3,300 | 2,088.00 | 6,890,400 |
| 東日本旅客鉄道 | 131,800 | 8,237.00 | 1,085,636,600 |
| 西日本旅客鉄道 | 66,900 | 6,688.00 | 447,427,200 |
| 東海旅客鉄道 | 62,300 | 17,325.00 | 1,079,347,500 |
| 西武ホールディングス | 100,900 | 1,251.00 | 126,225,900 |
| 鴻池運輸 | 11,500 | 1,155.00 | 13,282,500 |
| 西日本鉄道 | 21,000 | 2,649.00 | 55,629,000 |
| ハマキョウレックス | 5,800 | 2,862.00 | 16,599,600 |
| サカイ引越センター | 3,900 | 5,460.00 | 21,294,000 |
| 近鉄グループホールディングス | 70,500 | 5,140.00 | 362,370,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 93,900 | 3,720.00 | 349,308,000 |
| 南海電気鉄道 | 34,200 | 2,345.00 | 80,199,000 |
| 京阪ホールディングス | 31,600 | 4,885.00 | 154,366,000 |
| 神戸電鉄 | 2,600 | 3,810.00 | 9,906,000 |
| 名古屋鉄道 | 57,800 | 3,115.00 | 180,047,000 |
| 山陽電気鉄道 | 6,000 | 2,070.00 | 12,420,000 |
| 日本通運 | 25,000 | 5,080.00 | 127,000,000 |
| ヤマトホールディングス | 124,700 | 1,883.00 | 234,810,100 |
| 山九 | 19,700 | 4,015.00 | 79,095,500 |
| 丸全昭和運輸 | 6,200 | 2,325.00 | 14,415,000 |
| センコーグループホールディングス | 38,800 | 859.00 | 33,329,200 |
| トナミホールディングス | 1,900 | 5,200.00 | 9,880,000 |
| ニッコンホールディングス | 25,300 | 2,039.00 | 51,586,700 |
| 福山通運 | 8,900 | 3,705.00 | 32,974,500 |
| セイノーホールディングス | 52,600 | 1,244.00 | 65,434,400 |
| 神奈川中央交通 | 2,300 | 3,940.00 | 9,062,000 |
| 日立物流 | 13,000 | 2,520.00 | 32,760,000 |
| 丸和運輸機関 | 7,400 | 3,275.00 | 24,235,000 |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|
| C & F ロジホールディングス | 8,200 | 1,351.00 | 11,078,200 |
| 九州旅客鉄道 | 62,400 | 2,925.00 | 182,520,000 |
| S Gホールディングス | 74,700 | 3,035.00 | 226,714,500 |
| 日本郵船 | 60,200 | 1,435.00 | 86,387,000 |
| 商船三井 | 45,100 | 1,871.00 | 84,382,100 |
| 川崎汽船 | 12,800 | 1,041.00 | 13,324,800 |
| N S ユナイテッド海運 | 5,000 | 1,426.00 | 7,130,000 |
| 飯野海運 | 38,200 | 323.00 | 12,338,600 |
| 乾汽船 | 6,100 | 1,181.00 | 7,204,100 |
| 日本航空 | 128,300 | 1,872.50 | 240,241,750 |
| A N Aホールディングス | 130,300 | 2,365.50 | 308,224,650 |
| トランコム | 2,100 | 7,050.00 | 14,805,000 |
| 日新 | 6,200 | 1,597.00 | 9,901,400 |
| 三菱倉庫 | 23,100 | 2,333.00 | 53,892,300 |
| 三井倉庫ホールディングス | 8,700 | 1,478.00 | 12,858,600 |
| 住友倉庫 | 25,100 | 1,234.00 | 30,973,400 |
| 澁澤倉庫 | 4,900 | 2,200.00 | 10,780,000 |
| 東陽倉庫 | 20,900 | 327.00 | 6,834,300 |
| 日本トランスシティ | 18,500 | 499.00 | 9,231,500 |
| 川西倉庫 | 4,000 | 984.00 | 3,936,000 |
| 安田倉庫 | 8,000 | 867.00 | 6,936,000 |
| 東洋埠頭 | 4,900 | 1,320.00 | 6,468,000 |
| 上組 | 39,000 | 1,866.00 | 72,774,000 |
| 近鉄エクスプレス | 14,800 | 1,531.00 | 22,658,800 |
| エーアイティー | 8,200 | 725.00 | 5,945,000 |
| 日本コンセプト | 3,700 | 1,410.00 | 5,217,000 |
| N E C ネットズエスアイ | 7,000 | 4,580.00 | 32,060,000 |
| システナ | 26,000 | 1,439.00 | 37,414,000 |
| デジタルアーツ | 3,800 | 6,410.00 | 24,358,000 |
| 日鉄ソリューションズ | 11,000 | 2,847.00 | 31,317,000 |
| キューブシステム | 7,700 | 669.00 | 5,151,300 |
| コア | 4,100 | 1,227.00 | 5,030,700 |
| ソリトンシステムズ | 4,200 | 1,307.00 | 5,489,400 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 4,100 | 1,876.00 | 7,691,600 |
| T I S | 73,600 | 2,011.00 | 148,009,600 |
| 電算システム | 3,800 | 2,416.00 | 9,180,800 |
| グリー | 47,600 | 413.00 | 19,658,800 |
| コーエーテクモホールディングス | 14,900 | 2,825.00 | 42,092,500 |
| 三菱総合研究所 | 3,300 | 3,610.00 | 11,913,000 |
| ファインデックス | 8,200 | 855.00 | 7,011,000 |
| ブレインパッド | 2,100 | 5,120.00 | 10,752,000 |
| K L a b | 15,500 | 739.00 | 11,454,500 |

| | | | |
|---------------------------|---------|----------|-------------|
| ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス | 10,600 | 862.00 | 9,137,200 |
| ネクソン | 205,300 | 1,765.00 | 362,354,500 |
| エムアップホールディングス | 2,500 | 2,429.00 | 6,072,500 |
| エイチーム | 7,800 | 688.00 | 5,366,400 |
| エニグモ | 6,600 | 902.00 | 5,953,200 |
| コロプラ | 25,100 | 894.00 | 22,439,400 |
| ブロードリーフ | 39,000 | 487.00 | 18,993,000 |
| デジタルハーツホールディングス | 6,100 | 752.00 | 4,587,200 |
| システム情報 | 5,000 | 815.00 | 4,075,000 |
| メディアドゥホールディングス | 2,800 | 4,005.00 | 11,214,000 |
| じげん | 22,900 | 300.00 | 6,870,000 |
| ブイキューブ | 5,300 | 1,267.00 | 6,715,100 |
| フィックスターズ | 9,300 | 1,023.00 | 9,513,900 |
| C A R T A H O L D I N G S | 5,300 | 806.00 | 4,271,800 |
| オブティム | 4,700 | 2,261.00 | 10,626,700 |
| セレス | 4,000 | 758.00 | 3,032,000 |
| S H I F T | 2,000 | 9,100.00 | 18,200,000 |
| ティーガイア | 6,400 | 2,089.00 | 13,369,600 |
| セック | 1,600 | 3,015.00 | 4,824,000 |
| テクマトリックス | 5,500 | 2,698.00 | 14,839,000 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 18,100 | 1,680.00 | 30,408,000 |
| G M O ペイメントゲートウェイ | 12,200 | 9,530.00 | 116,266,000 |
| システムリサーチ | 2,900 | 1,500.00 | 4,350,000 |
| インターネットイニシアティブ | 11,200 | 3,835.00 | 42,952,000 |
| さくらインターネット | 10,600 | 644.00 | 6,826,400 |
| G M O クラウド | 1,900 | 2,895.00 | 5,500,500 |
| S R A ホールディングス | 4,400 | 2,173.00 | 9,561,200 |
| e B A S E | 9,800 | 1,059.00 | 10,378,200 |
| アバント | 6,200 | 894.00 | 5,542,800 |
| アドソル日進 | 3,200 | 2,381.00 | 7,619,200 |
| フリービット | 5,500 | 732.00 | 4,026,000 |
| コムチュア | 8,300 | 2,263.00 | 18,782,900 |
| アステリア | 8,900 | 457.00 | 4,067,300 |
| マークライنز | 4,800 | 1,732.00 | 8,313,600 |
| メディカル・データ・ビジョン | 7,400 | 775.00 | 5,735,000 |
| g u m i | 10,900 | 664.00 | 7,237,600 |
| モバイルファクトリー | 2,700 | 933.00 | 2,519,100 |
| テラスカイ | 3,000 | 2,468.00 | 7,404,000 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 4,500 | 1,278.00 | 5,751,000 |
| ダブルスタンダード | 1,300 | 3,990.00 | 5,187,000 |
| オープンドア | 5,300 | 907.00 | 4,807,100 |
| アカツキ | 2,800 | 4,000.00 | 11,200,000 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|-------------|
| U b i c o mホールディングス | 2,600 | 1,245.00 | 3,237,000 |
| L I N E | 16,800 | 5,280.00 | 88,704,000 |
| チェンジ | 1,800 | 4,085.00 | 7,353,000 |
| オークネット | 6,400 | 1,090.00 | 6,976,000 |
| A O I T Y O H o l d i n g s | 9,500 | 423.00 | 4,018,500 |
| マクロミル | 16,900 | 654.00 | 11,052,600 |
| オロ | 2,300 | 3,050.00 | 7,015,000 |
| サインポスト | 1,800 | 1,385.00 | 2,493,000 |
| ソルクシーズ | 4,700 | 593.00 | 2,787,100 |
| プロトコーポレーション | 8,400 | 878.00 | 7,375,200 |
| 野村総合研究所 | 104,000 | 2,604.00 | 270,816,000 |
| サイバネットシステム | 8,000 | 623.00 | 4,984,000 |
| インテージホールディングス | 11,100 | 747.00 | 8,291,700 |
| ソースネクスト | 38,700 | 307.00 | 11,880,900 |
| インフォコム | 8,200 | 2,583.00 | 21,180,600 |
| H E R O Z | 900 | 3,570.00 | 3,213,000 |
| ラクスル | 4,400 | 2,411.00 | 10,608,400 |
| アルテリア・ネットワークス | 8,500 | 2,204.00 | 18,734,000 |
| フォーカスシステムズ | 6,600 | 797.00 | 5,260,200 |
| クレスコ | 5,500 | 1,333.00 | 7,331,500 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 70,800 | 1,053.00 | 74,552,400 |
| オービック | 25,500 | 16,300.00 | 415,650,000 |
| ジャストシステム | 11,900 | 6,470.00 | 76,993,000 |
| T D C ソフト | 7,400 | 838.00 | 6,201,200 |
| Zホールディングス | 1,011,800 | 415.00 | 419,897,000 |
| トレンドマイクロ | 32,800 | 5,390.00 | 176,792,000 |
| I Dホールディングス | 3,900 | 1,427.00 | 5,565,300 |
| 日本オラクル | 14,900 | 11,140.00 | 165,986,000 |
| アルファシステムズ | 2,700 | 3,000.00 | 8,100,000 |
| フューチャー | 9,100 | 1,520.00 | 13,832,000 |
| C A C H o l d i n g s | 6,100 | 1,080.00 | 6,588,000 |
| S Bテクノロジー | 3,000 | 2,664.00 | 7,992,000 |
| オービックビジネスコンサルタント | 7,500 | 4,860.00 | 36,450,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 33,300 | 3,325.00 | 110,722,500 |
| アイティフォー | 10,900 | 642.00 | 6,997,800 |
| 大塚商会 | 39,600 | 4,925.00 | 195,030,000 |
| サイボウズ | 9,300 | 2,048.00 | 19,046,400 |
| ソフトブレーン | 6,800 | 446.00 | 3,032,800 |
| 電通国際情報サービス | 4,400 | 4,200.00 | 18,480,000 |
| デジタルガレージ | 13,600 | 3,790.00 | 51,544,000 |
| E Mシステムズ | 11,600 | 839.00 | 9,732,400 |
| ウェザーニューズ | 3,100 | 3,550.00 | 11,005,000 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|-----------|---------------|
| C I J | 7,500 | 798.00 | 5,985,000 |
| WOWOW | 3,800 | 2,510.00 | 9,538,000 |
| スカラ | 8,400 | 495.00 | 4,158,000 |
| I M A G I C A G R O U P | 8,700 | 350.00 | 3,045,000 |
| ネットワンシステムズ | 28,400 | 3,045.00 | 86,478,000 |
| アルゴグラフィックス | 6,000 | 3,375.00 | 20,250,000 |
| マーベラス | 14,900 | 522.00 | 7,777,800 |
| エイベックス | 13,500 | 795.00 | 10,732,500 |
| 日本ユニシス | 23,300 | 3,040.00 | 70,832,000 |
| 兼松エレクトロニクス | 4,000 | 3,430.00 | 13,720,000 |
| 東京放送ホールディングス | 44,800 | 1,632.00 | 73,113,600 |
| 日本テレビホールディングス | 61,300 | 1,190.00 | 72,947,000 |
| 朝日放送グループホールディングス | 10,800 | 692.00 | 7,473,600 |
| テレビ朝日ホールディングス | 20,700 | 1,585.00 | 32,809,500 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 49,700 | 401.00 | 19,929,700 |
| テレビ東京ホールディングス | 6,200 | 2,472.00 | 15,326,400 |
| ビジョン | 8,100 | 720.00 | 5,832,000 |
| U S E N - N E X T H O L D I N G S | 3,400 | 1,338.00 | 4,549,200 |
| コネクシオ | 4,800 | 1,480.00 | 7,104,000 |
| 日本通信 | 25,500 | 154.00 | 3,927,000 |
| 日本電信電話 | 981,600 | 2,522.00 | 2,475,595,200 |
| K D D I | 547,700 | 3,200.00 | 1,752,640,000 |
| ソフトバンク | 669,000 | 1,429.00 | 956,001,000 |
| 光通信 | 7,600 | 20,900.00 | 158,840,000 |
| N T T ドコモ | 542,400 | 3,286.00 | 1,782,326,400 |
| エムティーアイ | 10,300 | 545.00 | 5,613,500 |
| G M O インターネット | 29,500 | 2,334.00 | 68,853,000 |
| K A D O K A W A | 20,400 | 1,517.00 | 30,946,800 |
| 学研ホールディングス | 10,000 | 1,743.00 | 17,430,000 |
| ゼンリン | 15,300 | 1,068.00 | 16,340,400 |
| アイネット | 4,700 | 1,500.00 | 7,050,000 |
| 松竹 | 4,900 | 11,390.00 | 55,811,000 |
| 東宝 | 43,500 | 3,395.00 | 147,682,500 |
| 東映 | 2,800 | 13,250.00 | 37,100,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 194,700 | 1,053.00 | 205,019,100 |
| ピー・シー・エー | 1,500 | 3,350.00 | 5,025,000 |
| D T S | 15,900 | 1,941.00 | 30,861,900 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 31,500 | 4,530.00 | 142,695,000 |
| シーイーシー | 8,100 | 1,551.00 | 12,563,100 |
| カプコン | 35,000 | 3,335.00 | 116,725,000 |
| ジャステック | 6,400 | 1,139.00 | 7,289,600 |
| S C S K | 17,000 | 5,230.00 | 88,910,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|----------|---------------|
| 日本システムウエア | 3,100 | 1,920.00 | 5,952,000 |
| アイネス | 7,800 | 1,399.00 | 10,912,200 |
| T K C | 6,100 | 5,030.00 | 30,683,000 |
| 富士ソフト | 9,500 | 3,755.00 | 35,672,500 |
| N S D | 23,900 | 1,513.00 | 36,160,700 |
| コナミホールディングス | 26,800 | 3,370.00 | 90,316,000 |
| 福井コンピュータホールディングス | 3,600 | 2,880.00 | 10,368,000 |
| J B C Cホールディングス | 5,800 | 1,865.00 | 10,817,000 |
| ミロク情報サービス | 6,700 | 2,656.00 | 17,795,200 |
| ソフトバンクグループ | 583,200 | 4,592.00 | 2,678,054,400 |
| 伊藤忠食品 | 2,100 | 4,610.00 | 9,681,000 |
| エレマテック | 8,600 | 816.00 | 7,017,600 |
| J A L U X | 3,500 | 1,535.00 | 5,372,500 |
| あらた | 5,700 | 4,545.00 | 25,906,500 |
| 東京エレクトロン デバイス | 3,400 | 2,361.00 | 8,027,400 |
| フィールズ | 10,500 | 324.00 | 3,402,000 |
| 双日 | 400,100 | 252.00 | 100,825,200 |
| アルフレッサ ホールディングス | 81,800 | 2,148.00 | 175,706,400 |
| 横浜冷凍 | 22,300 | 904.00 | 20,159,200 |
| アルコニックス | 8,700 | 1,106.00 | 9,622,200 |
| 神戸物産 | 25,600 | 5,340.00 | 136,704,000 |
| あい ホールディングス | 11,500 | 1,287.00 | 14,800,500 |
| ダイワボウホールディングス | 6,200 | 6,710.00 | 41,602,000 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 18,400 | 1,422.00 | 26,164,800 |
| ラクト・ジャパン | 3,000 | 3,440.00 | 10,320,000 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 14,700 | 1,103.00 | 16,214,100 |
| 八洲電機 | 8,800 | 825.00 | 7,260,000 |
| レスターホールディングス | 8,000 | 1,683.00 | 13,464,000 |
| ジュテックホールディングス | 3,200 | 1,007.00 | 3,222,400 |
| T O K A Iホールディングス | 38,400 | 950.00 | 36,480,000 |
| 三洋貿易 | 8,700 | 815.00 | 7,090,500 |
| ウイン・パートナーズ | 6,500 | 901.00 | 5,856,500 |
| シップヘルスケアホールディングス | 12,100 | 4,935.00 | 59,713,500 |
| コメダホールディングス | 16,000 | 1,590.00 | 25,440,000 |
| 小野建 | 7,500 | 1,122.00 | 8,415,000 |
| 佐島電機 | 7,300 | 818.00 | 5,971,400 |
| 伯東 | 5,700 | 957.00 | 5,454,900 |
| コンドーテック | 7,700 | 913.00 | 7,030,100 |
| ナガイレーベン | 11,200 | 2,644.00 | 29,612,800 |
| 三菱食品 | 7,400 | 2,769.00 | 20,490,600 |
| 松田産業 | 6,500 | 1,345.00 | 8,742,500 |
| 第一興商 | 11,500 | 3,070.00 | 35,305,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|
| メディバルホールディングス | 79,000 | 2,070.00 | 163,530,000 |
| S P K | 5,400 | 1,300.00 | 7,020,000 |
| 萩原電気ホールディングス | 3,300 | 2,026.00 | 6,685,800 |
| アズワン | 4,800 | 9,620.00 | 46,176,000 |
| 尾家産業 | 3,600 | 1,476.00 | 5,313,600 |
| シモジマ | 6,100 | 1,281.00 | 7,814,100 |
| ドウシシャ | 7,700 | 1,307.00 | 10,063,900 |
| 高速 | 5,500 | 1,518.00 | 8,349,000 |
| ハピネット | 7,300 | 1,071.00 | 7,818,300 |
| 日本ライフライン | 21,900 | 1,217.00 | 26,652,300 |
| マルカ | 3,700 | 1,701.00 | 6,293,700 |
| I D O M | 22,200 | 429.00 | 9,523,800 |
| 進和 | 5,300 | 1,685.00 | 8,930,500 |
| ダイトロン | 3,900 | 1,463.00 | 5,705,700 |
| シークス | 10,100 | 846.00 | 8,544,600 |
| オーハシテクニカ | 5,700 | 1,415.00 | 8,065,500 |
| 伊藤忠商事 | 514,700 | 2,160.00 | 1,111,752,000 |
| 丸紅 | 769,100 | 516.80 | 397,470,880 |
| 長瀬産業 | 41,000 | 1,285.00 | 52,685,000 |
| 蝶理 | 5,100 | 1,638.00 | 8,353,800 |
| 豊田通商 | 81,400 | 2,468.00 | 200,895,200 |
| 三共生興 | 16,400 | 461.00 | 7,560,400 |
| 兼松 | 26,500 | 1,028.00 | 27,242,000 |
| 三井物産 | 646,800 | 1,500.00 | 970,200,000 |
| 日本紙パルプ商事 | 4,400 | 3,595.00 | 15,818,000 |
| カメイ | 9,500 | 1,040.00 | 9,880,000 |
| スターゼン | 2,900 | 4,380.00 | 12,702,000 |
| 山善 | 26,900 | 914.00 | 24,586,600 |
| 椿本興業 | 1,700 | 3,090.00 | 5,253,000 |
| 住友商事 | 464,900 | 1,221.50 | 567,875,350 |
| 内田洋行 | 3,500 | 4,670.00 | 16,345,000 |
| 三菱商事 | 516,900 | 2,229.50 | 1,152,428,550 |
| 第一実業 | 3,800 | 3,640.00 | 13,832,000 |
| キャノンマーケティングジャパン | 21,400 | 2,040.00 | 43,656,000 |
| 西華産業 | 6,200 | 1,125.00 | 6,975,000 |
| 佐藤商事 | 7,700 | 793.00 | 6,106,100 |
| 菱洋エレクトロ | 7,800 | 2,458.00 | 19,172,400 |
| 東京産業 | 9,700 | 487.00 | 4,723,900 |
| ユアサ商事 | 6,500 | 2,919.00 | 18,973,500 |
| 神鋼商事 | 2,400 | 1,784.00 | 4,281,600 |
| 阪和興業 | 13,900 | 1,647.00 | 22,893,300 |
| 正栄食品工業 | 4,900 | 3,815.00 | 18,693,500 |

| | | | |
|---------------------|--------|----------|------------|
| カナデン | 7,400 | 1,252.00 | 9,264,800 |
| 菱電商事 | 6,500 | 1,329.00 | 8,638,500 |
| フルサト工業 | 5,000 | 1,391.00 | 6,955,000 |
| 岩谷産業 | 17,000 | 3,695.00 | 62,815,000 |
| 極東貿易 | 3,200 | 1,370.00 | 4,384,000 |
| イワキ | 12,900 | 433.00 | 5,585,700 |
| 三愛石油 | 17,800 | 1,092.00 | 19,437,600 |
| 稲畑産業 | 14,900 | 1,198.00 | 17,850,200 |
| 明和産業 | 9,000 | 492.00 | 4,428,000 |
| ワキタ | 16,600 | 1,000.00 | 16,600,000 |
| 東邦ホールディングス | 23,900 | 2,225.00 | 53,177,500 |
| サンゲツ | 20,200 | 1,621.00 | 32,744,200 |
| ミツウロコグループホールディングス | 11,700 | 1,112.00 | 13,010,400 |
| シナネンホールディングス | 3,800 | 2,781.00 | 10,567,800 |
| 伊藤忠エネクス | 16,100 | 782.00 | 12,590,200 |
| サンリオ | 22,400 | 1,560.00 | 34,944,000 |
| サンワテクノス | 6,800 | 819.00 | 5,569,200 |
| リョーサン | 8,300 | 2,300.00 | 19,090,000 |
| 新光商事 | 13,600 | 884.00 | 12,022,400 |
| トーヨー | 5,100 | 1,763.00 | 8,991,300 |
| 三信電気 | 5,400 | 1,462.00 | 7,894,800 |
| 東陽テクニカ | 10,400 | 1,011.00 | 10,514,400 |
| モスフードサービス | 10,100 | 2,688.00 | 27,148,800 |
| 加賀電子 | 7,700 | 1,885.00 | 14,514,500 |
| ソーダニッカ | 10,500 | 584.00 | 6,132,000 |
| 立花エレテック | 6,000 | 1,456.00 | 8,736,000 |
| PALTA C | 11,900 | 5,620.00 | 66,878,000 |
| 太平洋興発 | 6,600 | 587.00 | 3,874,200 |
| 西本Wismettacホールディングス | 2,000 | 1,786.00 | 3,572,000 |
| 国際紙パルプ商事 | 22,900 | 314.00 | 7,190,600 |
| ヤマタネ | 6,500 | 1,195.00 | 7,767,500 |
| 日鉄物産 | 4,700 | 3,220.00 | 15,134,000 |
| 泉州電業 | 3,100 | 2,487.00 | 7,709,700 |
| トラスコ中山 | 15,200 | 2,300.00 | 34,960,000 |
| オートバックスセブン | 29,600 | 1,266.00 | 37,473,600 |
| モリト | 9,300 | 665.00 | 6,184,500 |
| 加藤産業 | 11,100 | 3,600.00 | 39,960,000 |
| イノテック | 6,000 | 852.00 | 5,112,000 |
| イエローハット | 14,200 | 1,443.00 | 20,490,600 |
| J Kホールディングス | 8,700 | 739.00 | 6,429,300 |
| 日伝 | 7,000 | 2,038.00 | 14,266,000 |
| 杉本商事 | 4,900 | 1,782.00 | 8,731,800 |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|
| 因幡電機産業 | 20,600 | 2,269.00 | 46,741,400 |
| 東テク | 3,100 | 1,905.00 | 5,905,500 |
| ミスミグループ本社 | 92,400 | 2,535.00 | 234,234,000 |
| タキヒヨー | 4,000 | 1,640.00 | 6,560,000 |
| スズケン | 31,500 | 3,945.00 | 124,267,500 |
| ジェコス | 7,200 | 873.00 | 6,285,600 |
| ローソン | 18,800 | 5,790.00 | 108,852,000 |
| サンエー | 5,900 | 4,450.00 | 26,255,000 |
| カワチ薬品 | 5,800 | 2,609.00 | 15,132,200 |
| エービーシー・マート | 11,500 | 5,330.00 | 61,295,000 |
| アスクル | 7,800 | 3,340.00 | 26,052,000 |
| ゲオホールディングス | 13,000 | 1,446.00 | 18,798,000 |
| アダストリア | 10,600 | 1,443.00 | 15,295,800 |
| くら寿司 | 3,900 | 4,020.00 | 15,678,000 |
| キャンドウ | 5,000 | 1,895.00 | 9,475,000 |
| パルグループホールディングス | 8,200 | 1,180.00 | 9,676,000 |
| エディオン | 32,500 | 918.00 | 29,835,000 |
| サーラコーポレーション | 16,400 | 573.00 | 9,397,200 |
| ハローズ | 2,900 | 3,030.00 | 8,787,000 |
| フジオフードシステム | 7,700 | 1,258.00 | 9,686,600 |
| あみやき亭 | 2,300 | 2,783.00 | 6,400,900 |
| ひらまつ | 22,900 | 142.00 | 3,251,800 |
| 大黒天物産 | 2,200 | 4,430.00 | 9,746,000 |
| ハニーズホールディングス | 7,300 | 1,064.00 | 7,767,200 |
| アルペン | 6,700 | 1,596.00 | 10,693,200 |
| クオールホールディングス | 11,400 | 1,164.00 | 13,269,600 |
| ジーンズホールディングス | 4,000 | 5,380.00 | 21,520,000 |
| ビックカメラ | 42,300 | 975.00 | 41,242,500 |
| D C Mホールディングス | 40,200 | 1,038.00 | 41,727,600 |
| Monotaro | 52,600 | 3,425.00 | 180,155,000 |
| DDホールディングス | 4,200 | 750.00 | 3,150,000 |
| アークランドサービスホールディングス | 6,300 | 1,580.00 | 9,954,000 |
| J.フロント リテイリング | 87,800 | 890.00 | 78,142,000 |
| ドトール・日レスホールディングス | 10,900 | 1,592.00 | 17,352,800 |
| マツモトキヨシホールディングス | 30,100 | 3,670.00 | 110,467,000 |
| ブロンコビリー | 4,300 | 2,023.00 | 8,698,900 |
| Z O Z O | 51,400 | 1,695.00 | 87,123,000 |
| 物語コーポレーション | 2,000 | 6,050.00 | 12,100,000 |
| ココカラファイン | 7,700 | 5,090.00 | 39,193,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 129,400 | 660.00 | 85,404,000 |
| Hamee | 3,600 | 1,240.00 | 4,464,000 |
| ウエルシアホールディングス | 21,900 | 8,560.00 | 187,464,000 |

| | | | |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| クリエイティブSDホールディングス | 12,100 | 3,245.00 | 39,264,500 |
| チムニー | 3,300 | 1,568.00 | 5,174,400 |
| シュッピン | 7,100 | 685.00 | 4,863,500 |
| ネクステージ | 11,100 | 660.00 | 7,326,000 |
| ジョイフル本田 | 21,300 | 1,289.00 | 27,455,700 |
| 鳥貴族 | 3,200 | 1,469.00 | 4,700,800 |
| キリン堂ホールディングス | 3,600 | 2,159.00 | 7,772,400 |
| ホットランド | 6,500 | 984.00 | 6,396,000 |
| すかいらくホールディングス | 82,900 | 1,569.00 | 130,070,100 |
| SFPホールディングス | 4,300 | 1,360.00 | 5,848,000 |
| 綿半ホールディングス | 3,400 | 1,692.00 | 5,752,800 |
| 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 | 1,074.00 | 21,480,000 |
| B E E N O S | 3,900 | 846.00 | 3,299,400 |
| あさひ | 6,200 | 1,270.00 | 7,874,000 |
| 日本調剤 | 5,300 | 1,682.00 | 8,914,600 |
| コスモス薬品 | 3,300 | 30,150.00 | 99,495,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 288,600 | 3,611.00 | 1,042,134,600 |
| クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス | 40,100 | 539.00 | 21,613,900 |
| ツルハホールディングス | 16,000 | 14,700.00 | 235,200,000 |
| サンマルクホールディングス | 5,700 | 1,758.00 | 10,020,600 |
| トリドールホールディングス | 18,800 | 1,193.00 | 22,428,400 |
| T O K Y O B A S E | 9,800 | 267.00 | 2,616,600 |
| J Mホールディングス | 4,200 | 2,676.00 | 11,239,200 |
| パロックジャパンリミテッド | 7,400 | 562.00 | 4,158,800 |
| クスリのアオキホールディングス | 6,700 | 8,760.00 | 58,692,000 |
| 力の源ホールディングス | 4,500 | 582.00 | 2,619,000 |
| スシローグローバルホールディングス | 32,400 | 1,605.00 | 52,002,000 |
| L I X I L ビバ | 7,400 | 1,856.00 | 13,734,400 |
| メディカルシステムネットワーク | 9,200 | 472.00 | 4,342,400 |
| ノジマ | 12,800 | 1,847.00 | 23,641,600 |
| カップ・クリエイティブ | 9,800 | 1,303.00 | 12,769,400 |
| 良品計画 | 98,200 | 1,194.00 | 117,250,800 |
| アドヴァン | 12,200 | 1,072.00 | 13,078,400 |
| アルビス | 3,600 | 2,160.00 | 7,776,000 |
| コナカ | 18,000 | 326.00 | 5,868,000 |
| G - 7ホールディングス | 4,400 | 2,357.00 | 10,370,800 |
| イオン北海道 | 11,900 | 749.00 | 8,913,100 |
| コジマ | 16,100 | 380.00 | 6,118,000 |
| コーナン商事 | 9,800 | 2,444.00 | 23,951,200 |
| エコス | 3,200 | 2,120.00 | 6,784,000 |
| ワタミ | 10,100 | 996.00 | 10,059,600 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 162,300 | 2,069.00 | 335,798,700 |
| 西松屋チェーン | 16,700 | 841.00 | 14,044,700 |
| ゼンショーホールディングス | 35,800 | 2,075.00 | 74,285,000 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6,100 | 1,434.00 | 8,747,400 |
| サイゼリヤ | 12,200 | 2,065.00 | 25,193,000 |
| V Tホールディングス | 32,700 | 299.00 | 9,777,300 |
| フジ・コーポレーション | 3,000 | 1,658.00 | 4,974,000 |
| ユナイテッドアローズ | 8,000 | 1,669.00 | 13,352,000 |
| ハイデイ日高 | 10,100 | 1,588.00 | 16,038,800 |
| コロワイド | 25,200 | 1,381.00 | 34,801,200 |
| ピーシーデポコーポレーション | 13,100 | 531.00 | 6,956,100 |
| 壱番屋 | 5,300 | 4,295.00 | 22,763,500 |
| スギホールディングス | 14,800 | 6,340.00 | 93,832,000 |
| 薬王堂ホールディングス | 3,500 | 2,668.00 | 9,338,000 |
| ヴィア・ホールディングス | 13,700 | 428.00 | 5,863,600 |
| スクロール | 15,800 | 310.00 | 4,898,000 |
| ヨンドシーホールディングス | 7,800 | 1,738.00 | 13,556,400 |
| ファミリーマート | 59,200 | 1,819.00 | 107,684,800 |
| 木曽路 | 9,300 | 2,361.00 | 21,957,300 |
| S R Sホールディングス | 11,200 | 834.00 | 9,340,800 |
| 千趣会 | 17,800 | 391.00 | 6,959,800 |
| ケーヨー | 19,400 | 549.00 | 10,650,600 |
| 上新電機 | 8,100 | 2,055.00 | 16,645,500 |
| 日本瓦斯 | 11,900 | 3,620.00 | 43,078,000 |
| ロイヤルホールディングス | 12,400 | 1,700.00 | 21,080,000 |
| いなげや | 9,200 | 1,614.00 | 14,848,800 |
| 島忠 | 14,000 | 2,680.00 | 37,520,000 |
| チヨダ | 9,200 | 1,043.00 | 9,595,600 |
| ライフコーポレーション | 5,600 | 3,530.00 | 19,768,000 |
| リンガーハット | 9,100 | 2,090.00 | 19,019,000 |
| Mr Max HD | 12,500 | 425.00 | 5,312,500 |
| A O K Iホールディングス | 14,900 | 648.00 | 9,655,200 |
| オークワ | 11,400 | 1,454.00 | 16,575,600 |
| コメリ | 11,300 | 2,070.00 | 23,391,000 |
| 青山商事 | 15,200 | 871.00 | 13,239,200 |
| しまむら | 8,500 | 6,770.00 | 57,545,000 |
| 高島屋 | 54,500 | 966.00 | 52,647,000 |
| 松屋 | 16,800 | 630.00 | 10,584,000 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 35,000 | 831.00 | 29,085,000 |
| 近鉄百貨店 | 3,000 | 2,528.00 | 7,584,000 |
| 丸井グループ | 68,000 | 1,697.00 | 115,396,000 |
| アクシアル リテイリング | 6,000 | 4,170.00 | 25,020,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|-------------|
| イオン | 283,300 | 2,159.50 | 611,786,350 |
| イズミ | 15,100 | 3,025.00 | 45,677,500 |
| 平和堂 | 14,300 | 1,826.00 | 26,111,800 |
| フジ | 8,600 | 1,690.00 | 14,534,000 |
| ヤオコー | 8,100 | 6,700.00 | 54,270,000 |
| ゼビオホールディングス | 10,100 | 893.00 | 9,019,300 |
| ケーズホールディングス | 70,700 | 1,165.00 | 82,365,500 |
| Olympicグループ | 6,800 | 663.00 | 4,508,400 |
| 日産東京販売ホールディングス | 18,400 | 208.00 | 3,827,200 |
| Genky DrugStores | 3,700 | 2,584.00 | 9,560,800 |
| ブックオフグループホールディングス | 5,900 | 799.00 | 4,714,100 |
| アインホールディングス | 9,300 | 5,720.00 | 53,196,000 |
| 元気寿司 | 2,500 | 2,259.00 | 5,647,500 |
| ヤマダ電機 | 224,700 | 514.00 | 115,495,800 |
| アークランドサカモト | 11,500 | 975.00 | 11,212,500 |
| ニトリホールディングス | 32,000 | 16,570.00 | 530,240,000 |
| グルメ杵屋 | 7,900 | 884.00 | 6,983,600 |
| 吉野家ホールディングス | 24,300 | 2,271.00 | 55,185,300 |
| 松屋フーズホールディングス | 3,500 | 3,785.00 | 13,247,500 |
| サガミホールディングス | 10,000 | 1,229.00 | 12,290,000 |
| 関西スーパーマーケット | 7,200 | 1,106.00 | 7,963,200 |
| 王将フードサービス | 5,300 | 5,610.00 | 29,733,000 |
| プレナス | 8,300 | 1,799.00 | 14,931,700 |
| ミニストップ | 6,500 | 1,460.00 | 9,490,000 |
| アークス | 14,300 | 2,037.00 | 29,129,100 |
| パローホールディングス | 15,600 | 2,015.00 | 31,434,000 |
| ベルク | 3,700 | 6,410.00 | 23,717,000 |
| 大庄 | 5,400 | 1,137.00 | 6,139,800 |
| ファーストリテイリング | 9,900 | 48,980.00 | 484,902,000 |
| サンドラッグ | 27,700 | 3,665.00 | 101,520,500 |
| サックスパー ホールディングス | 8,900 | 549.00 | 4,886,100 |
| ベルーナ | 17,200 | 491.00 | 8,445,200 |
| じもとホールディングス | 54,900 | 96.00 | 5,270,400 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 382,600 | 231.00 | 88,380,600 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 10,000 | 1,063.00 | 10,630,000 |
| 九州フィナンシャルグループ | 121,500 | 461.00 | 56,011,500 |
| ゆうちょ銀行 | 210,000 | 996.00 | 209,160,000 |
| 富山第一銀行 | 17,000 | 271.00 | 4,607,000 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 435,200 | 322.00 | 140,134,400 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 50,600 | 608.00 | 30,764,800 |
| 関西みらいフィナンシャルグループ | 45,400 | 357.00 | 16,207,800 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 6,700 | 1,508.00 | 10,103,600 |

| | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|
| 第四北越フィナンシャルグループ | 12,800 | 2,312.00 | 29,593,600 |
| 新生銀行 | 54,300 | 1,340.00 | 72,762,000 |
| あおぞら銀行 | 44,300 | 1,921.00 | 85,100,300 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 5,052,300 | 423.50 | 2,139,649,050 |
| りそなホールディングス | 808,800 | 331.10 | 267,793,680 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 139,500 | 3,165.00 | 441,517,500 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 511,000 | 2,755.50 | 1,408,060,500 |
| 千葉銀行 | 246,000 | 501.00 | 123,246,000 |
| 群馬銀行 | 144,800 | 337.00 | 48,797,600 |
| 武蔵野銀行 | 10,900 | 1,322.00 | 14,409,800 |
| 千葉興業銀行 | 20,200 | 236.00 | 4,767,200 |
| 筑波銀行 | 30,900 | 167.00 | 5,160,300 |
| 七十七銀行 | 25,000 | 1,414.00 | 35,350,000 |
| 青森銀行 | 5,600 | 2,252.00 | 12,611,200 |
| 秋田銀行 | 5,400 | 1,440.00 | 7,776,000 |
| 山形銀行 | 8,200 | 1,293.00 | 10,602,600 |
| 岩手銀行 | 4,800 | 2,600.00 | 12,480,000 |
| 東邦銀行 | 68,300 | 260.00 | 17,758,000 |
| 東北銀行 | 4,000 | 874.00 | 3,496,000 |
| みちのく銀行 | 5,500 | 1,118.00 | 6,149,000 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 61,300 | 1,464.00 | 89,743,200 |
| 静岡銀行 | 183,400 | 645.00 | 118,293,000 |
| 十六銀行 | 9,300 | 1,944.00 | 18,079,200 |
| スルガ銀行 | 76,700 | 368.00 | 28,225,600 |
| 八十二銀行 | 176,000 | 388.00 | 68,288,000 |
| 山梨中央銀行 | 9,200 | 783.00 | 7,203,600 |
| 大垣共立銀行 | 14,600 | 2,217.00 | 32,368,200 |
| 福井銀行 | 6,200 | 1,555.00 | 9,641,000 |
| 北國銀行 | 7,800 | 3,200.00 | 24,960,000 |
| 清水銀行 | 3,400 | 1,800.00 | 6,120,000 |
| 富山銀行 | 1,600 | 2,078.00 | 3,324,800 |
| 滋賀銀行 | 14,700 | 2,553.00 | 37,529,100 |
| 南都銀行 | 12,700 | 2,299.00 | 29,197,300 |
| 百五銀行 | 69,000 | 314.00 | 21,666,000 |
| 京都銀行 | 26,100 | 3,705.00 | 96,700,500 |
| 紀陽銀行 | 26,600 | 1,626.00 | 43,251,600 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 49,300 | 875.00 | 43,137,500 |
| 広島銀行 | 107,900 | 441.00 | 47,583,900 |
| 山陰合同銀行 | 44,200 | 579.00 | 25,591,800 |
| 中国銀行 | 63,300 | 1,005.00 | 63,616,500 |
| 伊予銀行 | 104,400 | 581.00 | 60,656,400 |
| 百十四銀行 | 7,900 | 1,988.00 | 15,705,200 |

| | | | |
|----------------------|------------|----------|---------------|
| 四国銀行 | 11,600 | 859.00 | 9,964,400 |
| 阿波銀行 | 12,200 | 2,363.00 | 28,828,600 |
| 大分銀行 | 4,800 | 2,084.00 | 10,003,200 |
| 宮崎銀行 | 4,900 | 2,390.00 | 11,711,000 |
| 佐賀銀行 | 4,600 | 1,091.00 | 5,018,600 |
| 沖縄銀行 | 7,100 | 3,205.00 | 22,755,500 |
| 琉球銀行 | 17,800 | 998.00 | 17,764,400 |
| セブン銀行 | 249,900 | 297.00 | 74,220,300 |
| みずほフィナンシャルグループ | 10,040,200 | 123.60 | 1,240,968,720 |
| 山口フィナンシャルグループ | 93,000 | 576.00 | 53,568,000 |
| 名古屋銀行 | 6,000 | 2,175.00 | 13,050,000 |
| 北洋銀行 | 116,000 | 195.00 | 22,620,000 |
| 愛知銀行 | 2,600 | 3,135.00 | 8,151,000 |
| 中京銀行 | 3,000 | 2,076.00 | 6,228,000 |
| 大光銀行 | 2,500 | 1,392.00 | 3,480,000 |
| 愛媛銀行 | 10,400 | 1,116.00 | 11,606,400 |
| 京葉銀行 | 31,000 | 535.00 | 16,585,000 |
| 栃木銀行 | 42,700 | 154.00 | 6,575,800 |
| 北日本銀行 | 2,700 | 1,883.00 | 5,084,100 |
| 東和銀行 | 14,200 | 669.00 | 9,499,800 |
| トモニホールディングス | 59,400 | 359.00 | 21,324,600 |
| フィデアホールディングス | 75,000 | 105.00 | 7,875,000 |
| 池田泉州ホールディングス | 89,000 | 165.00 | 14,685,000 |
| F P G | 24,100 | 463.00 | 11,158,300 |
| S B I ホールディングス | 82,500 | 1,821.00 | 150,232,500 |
| ジャフコ | 11,700 | 3,200.00 | 37,440,000 |
| 大和証券グループ本社 | 592,000 | 431.90 | 255,684,800 |
| 野村ホールディングス | 1,301,500 | 430.20 | 559,905,300 |
| 岡三証券グループ | 65,600 | 327.00 | 21,451,200 |
| 丸三証券 | 26,400 | 414.00 | 10,929,600 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 88,500 | 235.00 | 20,797,500 |
| 水戸証券 | 26,500 | 184.00 | 4,876,000 |
| いちよし証券 | 15,600 | 432.00 | 6,739,200 |
| 松井証券 | 42,900 | 794.00 | 34,062,600 |
| マネックスグループ | 40,400 | 200.00 | 8,080,000 |
| 極東証券 | 13,900 | 515.00 | 7,158,500 |
| 岩井コスモホールディングス | 8,000 | 916.00 | 7,328,000 |
| 藍澤證券 | 14,500 | 708.00 | 10,266,000 |
| スパークス・グループ | 32,600 | 178.00 | 5,802,800 |
| かんぽ生命保険 | 27,000 | 1,349.00 | 36,423,000 |
| S O M P O ホールディングス | 138,700 | 3,500.00 | 485,450,000 |
| アニコム ホールディングス | 6,000 | 4,120.00 | 24,720,000 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| MS & A Dインシュアランスグループホールディングス | 192,900 | 3,096.00 | 597,218,400 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 60,600 | 1,975.00 | 119,685,000 |
| 第一生命ホールディングス | 417,300 | 1,323.50 | 552,296,550 |
| 東京海上ホールディングス | 264,200 | 5,025.00 | 1,327,605,000 |
| T & Dホールディングス | 221,500 | 897.00 | 198,685,500 |
| アドバンスクリエイト | 2,600 | 1,892.00 | 4,919,200 |
| 全国保証 | 21,200 | 2,964.00 | 62,836,800 |
| 日本モーゲージサービス | 2,200 | 1,447.00 | 3,183,400 |
| C a s a | 3,000 | 1,073.00 | 3,219,000 |
| アルヒ | 12,100 | 1,190.00 | 14,399,000 |
| プレミアグループ | 4,400 | 1,623.00 | 7,141,200 |
| クレディセゾン | 51,200 | 1,178.00 | 60,313,600 |
| 芙蓉総合リース | 7,800 | 5,280.00 | 41,184,000 |
| みずほリース | 11,900 | 2,061.00 | 24,525,900 |
| 東京センチュリー | 14,700 | 3,495.00 | 51,376,500 |
| 日本証券金融 | 31,600 | 502.00 | 15,863,200 |
| アイフル | 112,300 | 221.00 | 24,818,300 |
| リコーリース | 6,000 | 2,866.00 | 17,196,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 44,600 | 1,054.00 | 47,008,400 |
| アコム | 148,800 | 440.00 | 65,472,000 |
| ジャックス | 8,500 | 1,718.00 | 14,603,000 |
| オリエントコーポレーション | 209,500 | 122.00 | 25,559,000 |
| 日立キャピタル | 17,600 | 2,008.00 | 35,340,800 |
| アプラスフィナンシャル | 45,700 | 61.00 | 2,787,700 |
| オリックス | 462,000 | 1,216.50 | 562,023,000 |
| 三菱UFJリース | 185,400 | 501.00 | 92,885,400 |
| 日本取引所グループ | 212,000 | 2,122.00 | 449,864,000 |
| イー・ギャランティ | 8,500 | 1,923.00 | 16,345,500 |
| NECキャピタルソリューション | 3,000 | 1,924.00 | 5,772,000 |
| いちご | 98,200 | 259.00 | 25,433,800 |
| 日本駐車場開発 | 99,200 | 127.00 | 12,598,400 |
| スター・マイカ・ホールディングス | 4,800 | 1,420.00 | 6,816,000 |
| ヒューリック | 158,800 | 1,057.00 | 167,851,600 |
| 三栄建築設計 | 3,800 | 1,171.00 | 4,449,800 |
| 野村不動産ホールディングス | 44,800 | 1,715.00 | 76,832,000 |
| 三重交通グループホールディングス | 19,400 | 471.00 | 9,137,400 |
| サムティ | 9,900 | 1,362.00 | 13,483,800 |
| ディア・ライフ | 14,300 | 403.00 | 5,762,900 |
| 日本商業開発 | 6,100 | 1,362.00 | 8,308,200 |
| プレサンスコーポレーション | 14,100 | 1,072.00 | 15,115,200 |
| ユニゾホールディングス | 11,400 | 5,980.00 | 68,172,000 |
| 日本管理センター | 7,000 | 1,050.00 | 7,350,000 |

| | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|
| フージャースホールディングス | 17,600 | 608.00 | 10,700,800 |
| オープンハウス | 21,700 | 2,217.00 | 48,108,900 |
| 東急不動産ホールディングス | 201,200 | 512.00 | 103,014,400 |
| 飯田グループホールディングス | 61,100 | 1,412.00 | 86,273,200 |
| ムゲンエステート | 10,200 | 458.00 | 4,671,600 |
| ビーロッド | 5,700 | 594.00 | 3,385,800 |
| ハウズドゥ | 4,700 | 748.00 | 3,515,600 |
| ジェイ・エス・ビー | 1,200 | 4,800.00 | 5,760,000 |
| パーク24 | 39,400 | 1,573.00 | 61,976,200 |
| パラカ | 3,100 | 1,560.00 | 4,836,000 |
| 三井不動産 | 364,600 | 1,955.50 | 712,975,300 |
| 三菱地所 | 518,000 | 1,712.50 | 887,075,000 |
| 平和不動産 | 14,100 | 2,807.00 | 39,578,700 |
| 東京建物 | 78,300 | 1,170.00 | 91,611,000 |
| ダイビル | 20,700 | 903.00 | 18,692,100 |
| 京阪神ビルディング | 13,600 | 1,403.00 | 19,080,800 |
| 住友不動産 | 166,400 | 2,889.50 | 480,812,800 |
| テーオーシー | 18,000 | 662.00 | 11,916,000 |
| 東京楽天地 | 1,700 | 4,100.00 | 6,970,000 |
| スターツコーポレーション | 9,400 | 2,056.00 | 19,326,400 |
| フジ住宅 | 11,800 | 489.00 | 5,770,200 |
| 空港施設 | 13,300 | 424.00 | 5,639,200 |
| ゴールドクレスト | 6,900 | 1,623.00 | 11,198,700 |
| エスリード | 4,000 | 1,300.00 | 5,200,000 |
| 日神グループホールディングス | 14,500 | 400.00 | 5,800,000 |
| 日本エスコン | 14,400 | 628.00 | 9,043,200 |
| タカラレーベン | 37,200 | 351.00 | 13,057,200 |
| A V A N T I A | 7,000 | 640.00 | 4,480,000 |
| イオンモール | 37,600 | 1,326.00 | 49,857,600 |
| ファースト住建 | 4,800 | 933.00 | 4,478,400 |
| カチタス | 18,600 | 1,697.00 | 31,564,200 |
| トーセイ | 12,000 | 994.00 | 11,928,000 |
| サンフロンティア不動産 | 12,400 | 833.00 | 10,329,200 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 7,600 | 804.00 | 6,110,400 |
| ランドビジネス | 7,400 | 291.00 | 2,153,400 |
| 日本空港ビルデング | 23,800 | 3,995.00 | 95,081,000 |
| 日本工営 | 4,900 | 2,963.00 | 14,518,700 |
| L I F U L L | 29,500 | 309.00 | 9,115,500 |
| ジェイエシーリクルートメント | 5,300 | 1,085.00 | 5,750,500 |
| 日本M&Aセンター | 54,400 | 3,420.00 | 186,048,000 |
| メンバーズ | 2,700 | 1,410.00 | 3,807,000 |
| UTグループ | 8,600 | 1,356.00 | 11,661,600 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| タケエイ | 8,600 | 773.00 | 6,647,800 |
| ビーネックスグループ | 10,800 | 632.00 | 6,825,600 |
| コシダカホールディングス | 19,800 | 420.00 | 8,316,000 |
| パソナグループ | 8,400 | 1,061.00 | 8,912,400 |
| リンクアンドモチベーション | 18,700 | 333.00 | 6,227,100 |
| G C A | 10,800 | 635.00 | 6,858,000 |
| エス・エム・エス | 22,800 | 2,217.00 | 50,547,600 |
| パーソルホールディングス | 71,800 | 1,120.00 | 80,416,000 |
| リニカル | 4,900 | 859.00 | 4,209,100 |
| クックパッド | 30,600 | 368.00 | 11,260,800 |
| 学情 | 3,400 | 1,115.00 | 3,791,000 |
| スタジオアリス | 5,100 | 1,410.00 | 7,191,000 |
| シミックホールディングス | 5,000 | 1,595.00 | 7,975,000 |
| 総合警備保障 | 28,300 | 5,400.00 | 152,820,000 |
| カカクコム | 53,200 | 2,178.00 | 115,869,600 |
| アイロムグループ | 3,500 | 1,317.00 | 4,609,500 |
| ルネサンス | 5,500 | 952.00 | 5,236,000 |
| ディップ | 10,200 | 2,075.00 | 21,165,000 |
| オプトホールディング | 4,500 | 1,428.00 | 6,426,000 |
| 新日本科学 | 9,300 | 642.00 | 5,970,600 |
| ツクイ | 19,600 | 432.00 | 8,467,200 |
| ベネフィット・ワン | 19,600 | 1,853.00 | 36,318,800 |
| エムスリー | 157,800 | 3,870.00 | 610,686,000 |
| アウトソーシング | 40,700 | 465.00 | 18,925,500 |
| ウェルネット | 11,700 | 487.00 | 5,697,900 |
| ワールドホールディングス | 2,900 | 1,298.00 | 3,764,200 |
| ディー・エヌ・エー | 36,400 | 1,326.00 | 48,266,400 |
| 博報堂D Yホールディングス | 98,200 | 1,138.00 | 111,751,600 |
| ぐるなび | 15,500 | 532.00 | 8,246,000 |
| タカミヤ | 12,500 | 401.00 | 5,012,500 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 6,500 | 704.00 | 4,576,000 |
| ファンコミュニケーションズ | 22,800 | 439.00 | 10,009,200 |
| ライク | 3,200 | 1,525.00 | 4,880,000 |
| エスプール | 15,500 | 707.00 | 10,958,500 |
| W D Bホールディングス | 3,600 | 2,477.00 | 8,917,200 |
| バリューコマース | 4,400 | 1,998.00 | 8,791,200 |
| インフォマート | 80,000 | 726.00 | 58,080,000 |
| J Pホールディングス | 28,000 | 265.00 | 7,420,000 |
| E P Sホールディングス | 11,300 | 1,130.00 | 12,769,000 |
| プレステージ・インターナショナル | 27,100 | 852.00 | 23,089,200 |
| アミューズ | 4,400 | 2,188.00 | 9,627,200 |
| ドリームインキュベータ | 3,800 | 1,150.00 | 4,370,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| クイック | 5,200 | 998.00 | 5,189,600 |
| ケネディクス | 69,600 | 477.00 | 33,199,200 |
| 電通グループ | 73,800 | 2,106.00 | 155,422,800 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 3,900 | 565.00 | 2,203,500 |
| ぴあ | 2,200 | 2,876.00 | 6,327,200 |
| イオンファンタジー | 3,400 | 1,513.00 | 5,144,200 |
| シーティーエス | 9,700 | 539.00 | 5,228,300 |
| ネクシィーズグループ | 3,300 | 981.00 | 3,237,300 |
| みらかホールディングス | 20,600 | 2,340.00 | 48,204,000 |
| アルプス技研 | 6,900 | 1,576.00 | 10,874,400 |
| 日本空調サービス | 9,600 | 715.00 | 6,864,000 |
| オリエンタルランド | 76,100 | 14,095.00 | 1,072,629,500 |
| ダスキン | 18,200 | 2,793.00 | 50,832,600 |
| 明光ネットワークジャパン | 11,900 | 743.00 | 8,841,700 |
| ファルコホールディングス | 5,000 | 1,657.00 | 8,285,000 |
| ラウンドワン | 21,200 | 796.00 | 16,875,200 |
| リゾートトラスト | 33,700 | 1,043.00 | 35,149,100 |
| ビー・エム・エル | 9,300 | 2,765.00 | 25,714,500 |
| りらいあコミュニケーションズ | 13,000 | 1,087.00 | 14,131,000 |
| リソー教育 | 37,700 | 248.00 | 9,349,600 |
| ユー・エス・エス | 79,800 | 1,692.00 | 135,021,600 |
| サイバーエージェント | 41,400 | 4,430.00 | 183,402,000 |
| 楽天 | 334,500 | 917.00 | 306,736,500 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 5,000 | 896.00 | 4,480,000 |
| テー・オー・ダブリュー | 16,600 | 264.00 | 4,382,400 |
| 山田コンサルティンググループ | 4,600 | 1,070.00 | 4,922,000 |
| セントラルスポーツ | 3,200 | 2,162.00 | 6,918,400 |
| フルキャストホールディングス | 7,300 | 1,280.00 | 9,344,000 |
| エン・ジャパン | 12,700 | 2,252.00 | 28,600,400 |
| テクノプロ・ホールディングス | 14,300 | 5,180.00 | 74,074,000 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 3,100 | 6,650.00 | 20,615,000 |
| Gunosy | 5,500 | 823.00 | 4,526,500 |
| イー・ガーディアン | 4,000 | 1,763.00 | 7,052,000 |
| ジャパンマテリアル | 21,700 | 1,537.00 | 33,352,900 |
| ベクトル | 10,100 | 730.00 | 7,373,000 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 6,900 | 819.00 | 5,651,100 |
| I B J | 6,700 | 624.00 | 4,180,800 |
| アサンテ | 4,300 | 1,424.00 | 6,123,200 |
| N・フィールド | 9,300 | 415.00 | 3,859,500 |
| バリューHR | 3,600 | 1,450.00 | 5,220,000 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 5,200 | 2,891.00 | 15,033,200 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 3,800 | 1,504.00 | 5,715,200 |

| | | | |
|------------------------|---------|----------|---------------|
| シグマクシス | 5,500 | 1,493.00 | 8,211,500 |
| ウィルグループ | 5,600 | 608.00 | 3,404,800 |
| リクルートホールディングス | 512,400 | 2,937.50 | 1,505,175,000 |
| エラン | 4,600 | 1,732.00 | 7,967,200 |
| 日本郵政 | 586,600 | 856.90 | 502,657,540 |
| ベルシステム24ホールディングス | 12,500 | 1,234.00 | 15,425,000 |
| 鎌倉新書 | 6,100 | 1,020.00 | 6,222,000 |
| LITALICO | 3,000 | 2,183.00 | 6,549,000 |
| アトラエ | 2,200 | 2,737.00 | 6,021,400 |
| ストライク | 2,800 | 4,100.00 | 11,480,000 |
| ソラスト | 20,300 | 1,038.00 | 21,071,400 |
| インソース | 3,800 | 2,282.00 | 8,671,600 |
| バイカレント・コンサルティング | 4,500 | 6,180.00 | 27,810,000 |
| グレイステクノロジー | 3,600 | 2,826.00 | 10,173,600 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 7,700 | 2,737.00 | 21,074,900 |
| グリーンズ | 5,200 | 408.00 | 2,121,600 |
| 日総工産 | 6,000 | 448.00 | 2,688,000 |
| キュービーネットホールディングス | 4,000 | 1,688.00 | 6,752,000 |
| RPAホールディングス | 4,800 | 744.00 | 3,571,200 |
| スプリックス | 4,100 | 833.00 | 3,415,300 |
| カーブスホールディングス | 18,600 | 465.00 | 8,649,000 |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 5,900 | 782.00 | 4,613,800 |
| リログループ | 39,400 | 2,239.00 | 88,216,600 |
| 東祥 | 5,900 | 905.00 | 5,339,500 |
| エイチ・アイ・エス | 11,400 | 1,303.00 | 14,854,200 |
| 共立メンテナンス | 11,800 | 2,383.00 | 28,119,400 |
| イチネンホールディングス | 9,100 | 1,083.00 | 9,855,300 |
| 建設技術研究所 | 5,500 | 1,747.00 | 9,608,500 |
| 燦ホールディングス | 4,400 | 1,310.00 | 5,764,000 |
| 東京テアトル | 4,700 | 1,191.00 | 5,597,700 |
| ナガワ | 2,300 | 7,050.00 | 16,215,000 |
| よみうりランド | 2,100 | 3,470.00 | 7,287,000 |
| 東京都競馬 | 4,900 | 3,500.00 | 17,150,000 |
| カナモト | 11,900 | 2,069.00 | 24,621,100 |
| 東京ドーム | 30,300 | 763.00 | 23,118,900 |
| 西尾レントオール | 6,900 | 2,113.00 | 14,579,700 |
| トランス・コスモス | 7,100 | 2,156.00 | 15,307,600 |
| 乃村工藝社 | 30,800 | 769.00 | 23,685,200 |
| 藤田観光 | 4,100 | 1,679.00 | 6,883,900 |
| KNT-CTホールディングス | 5,700 | 821.00 | 4,679,700 |
| 日本管財 | 7,400 | 1,816.00 | 13,438,400 |
| トーカイ | 6,900 | 2,882.00 | 19,885,800 |

| | | | | |
|--------------|------------|----------|-----------------|--|
| セコム | 75,700 | 9,119.00 | 690,308,300 | |
| セントラル警備保障 | 3,600 | 4,275.00 | 15,390,000 | |
| 丹青社 | 14,000 | 656.00 | 9,184,000 | |
| メイテック | 9,100 | 4,485.00 | 40,813,500 | |
| 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 | 2,215.00 | 32,117,500 | |
| オオバ | 8,900 | 557.00 | 4,957,300 | |
| ベネッセホールディングス | 24,100 | 3,150.00 | 75,915,000 | |
| イオンディライト | 8,400 | 3,165.00 | 26,586,000 | |
| ナック | 6,000 | 839.00 | 5,034,000 | |
| ニチイ学館 | 11,100 | 1,089.00 | 12,087,900 | |
| ダイセキ | 12,200 | 2,325.00 | 28,365,000 | |
| 合計 | 87,507,700 | | 152,354,149,040 | |

(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。

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)

(2020年 4月27日現在)

資産の部

流動資産

| | |
|----------|-----------------|
| 預金 | 633,599,484 |
| 金銭信託 | 100,485,366 |
| コール・ローン | 103,015,575 |
| 株式 | 186,251,660,602 |
| 投資証券 | 4,618,495,180 |
| 派生商品評価勘定 | 27,953,556 |
| 未収入金 | 1,865,057,554 |
| 未収配当金 | 227,793,045 |
| 差入委託証拠金 | 1,118,430,587 |
| 流動資産合計 | 194,946,490,949 |

資産合計

194,946,490,949

負債の部

流動負債

| | |
|----------|------------|
| 派生商品評価勘定 | 9,203,874 |
| 前受金 | 17,362,275 |

(2020年 4月27日現在)

| | |
|-------------|-----------------|
| 未払金 | 54,739,686 |
| 未払解約金 | 1,290,294,992 |
| 未払利息 | 297 |
| その他未払費用 | 41,742 |
| 流動負債合計 | 1,371,642,866 |
| 負債合計 | 1,371,642,866 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 58,066,751,593 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 135,508,096,490 |
| 元本等合計 | 193,574,848,083 |
| 純資産合計 | 193,574,848,083 |
| 負債純資産合計 | 194,946,490,949 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| | 外貨建資産等の会計処理 |

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 58,066,751,593口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.3337円 (10,000口当たりの純資産額 33,337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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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> |

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2020年 4月27日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（デリバティブ取引に関する注記）

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|-----------|-------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,140,907,036 | - | 2,158,269,311 | 17,362,275 |
| | SPMINI 2006 | 1,588,735,520 | - | 1,613,607,260 | 24,871,740 |
| | DJ EUR 2006 | 345,470,467 | - | 338,741,361 | 6,729,106 |
| | FTSE 2006 | 108,338,229 | - | 107,004,466 | 1,333,763 |
| | SPI200 2006 | 98,362,820 | - | 98,916,224 | 553,404 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 122,693,920 | - | 122,578,600 | 115,320 |
| | 米ドル | 112,008,000 | - | 111,893,600 | 114,400 |
| | スウェーデンクローナ | 213,800 | - | 214,200 | 400 |
| | ニュージーランドドル | 2,581,320 | - | 2,591,600 | 10,280 |
| | 香港ドル | 6,672,000 | - | 6,657,600 | 14,400 |
| | イスラエルシケル | 1,218,800 | - | 1,221,600 | 2,800 |
| | 売建 | 1,848,430,927 | - | 1,846,928,200 | 1,502,727 |
| | 米ドル | 1,355,179,520 | - | 1,353,482,200 | 1,697,320 |
| | カナダドル | 66,299,310 | - | 66,346,200 | 46,890 |
| | ユーロ | 180,363,014 | - | 180,327,000 | 36,014 |
| | 英ポンド | 106,303,800 | - | 106,480,000 | 176,200 |
| | スイスフラン | 68,546,410 | - | 68,485,200 | 61,210 |
| | スウェーデンクローナ | 15,258,873 | - | 15,315,300 | 56,427 |
| | ノルウェークローネ | 3,947,500 | - | 3,950,700 | 3,200 |
| | デンマーククローネ | 15,133,300 | - | 15,132,000 | 1,300 |
| | オーストラリアドル | 6,848,000 | - | 6,895,000 | 47,000 |
| | 香港ドル | 20,576,080 | - | 20,527,600 | 48,480 |
| | シンガポールドル | 9,058,320 | - | 9,070,800 | 12,480 |
| | イスラエルシケル | 916,800 | - | 916,200 | 600 |
| 合計 | | 4,112,031,883 | - | 4,127,776,111 | 18,749,682 |

(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 2020年 1月24日

至 2020年 4月27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)

(2020年 4月27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 | 58,840,117,713円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 7,256,445,495円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 8,029,811,615円 |
| 2020年 4月27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 | 25,451,218,551円 |
| 三井住友・DC 年金バランス30 (債券重点型) | 354,132,894円 |
| 三井住友・DC 年金バランス50 (標準型) | 1,402,748,729円 |
| 三井住友・DC 年金バランス70 (株式重点型) | 898,409,075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) | 67,502,372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) | 2,062,158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) | 8,137,497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) | 23,861,394円 |
| 三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ) | 50,148,540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) | 42,133,260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) | 93,012,458円 |
| 外国株式指数ファンド | 558,034,519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 | 5,826,411,908円 |
| アセットアロケーション・ファンド (安定型) | 243,195,509円 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|---|----------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 245,763,764円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 180,873,346円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 8,810,021円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 63,308,584円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 50,183,200円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 158,005,784円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 76,905,157円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 92,680,407円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 24,402,638円 |
| 三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド | 11,277,567円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 218,126円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 848,695円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 538,088円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,759,348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) | 1,296,632,642円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定> | 7,995,785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> | 1,521,663,602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> | 1,513,925,274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> | 6,117,486,464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> | 101,693,203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> | 718,885,446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> | 177,133,917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> | 760,554,540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> | 648,495,263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> | 1,550,284,613円 |
| S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定> | 837,014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) | 293,533,256円 |
| S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定> | 131,650,499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> | 6,812,692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> | 634,241,041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> | 5,665,809,160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> | 251,019,233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 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|-----------------|
| 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> | 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 | 58,066,751,593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 | 10.69 | 203,772.78 | |
| | BAKER HUGHES COMPANY | 31,974 | 13.42 | 429,091.08 | |
| | CABOT OIL & GAS CORPORATION | 19,632 | 20.44 | 401,278.08 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 11,747 | 41.87 | 491,846.89 | |
| | CHEVRON CORPORATION | 96,717 | 87.01 | 8,415,346.17 | |
| | CONCHO RESOURCES INC | 10,172 | 53.09 | 540,031.48 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 55,797 | 36.09 | 2,013,713.73 | |
| | CONTINENTAL RESOURCES, INC. | 4,535 | 12.59 | 57,095.65 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 21,054 | 10.52 | 221,488.08 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 7,933 | 35.78 | 283,842.74 | |
| | EOG RESOURCES INC | 30,830 | 43.36 | 1,336,788.80 | |
| | EXXON MOBIL CORPORATION | 217,519 | 43.73 | 9,512,105.87 | |
| | HALLIBURTON CO | 44,317 | 8.86 | 392,648.62 | |
| | HESS CORPORATION | 15,362 | 42.46 | 652,270.52 | |
| | HOLLYFRONTIER CORP | 6,263 | 28.56 | 178,871.28 | |
| | KINDER MORGAN INC | 104,140 | 14.62 | 1,522,526.80 | |
| | MARATHON OIL CORP | 31,450 | 4.93 | 155,048.50 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORPORATION | 35,915 | 25.76 | 925,170.40 | |
| | NATIONAL-OILWELL VARCO INC. | 15,585 | 12.02 | 187,331.70 | |
| | NOBLE ENERGY INC | 26,757 | 8.18 | 218,872.26 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 50,338 | 13.81 | 695,167.78 | |
| | ONEOK INC | 19,764 | 27.66 | 546,672.24 | |
| | PHILLIPS 66 | 23,496 | 60.53 | 1,422,212.88 | |
| | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 8,858 | 77.45 | 686,052.10 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 73,444 | 16.11 | 1,183,182.84 | |
| | TARGA RESOURCES CORP | 11,788 | 9.72 | 114,579.36 | |
| TECHNIPFMC PLC | 21,584 | 8.02 | 173,103.68 | | |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| VALERO ENERGY CORP | 22,007 | 52.50 | 1,155,367.50 |
| WILLIAMS COS INC | 61,445 | 18.28 | 1,123,214.60 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 11,440 | 216.78 | 2,479,963.20 |
| ALBEMARLE CORPORATION | 4,714 | 61.53 | 290,052.42 |
| AMCOR PLC | 82,302 | 8.42 | 692,982.84 |
| AVERY DENNISON CORP | 4,832 | 108.54 | 524,465.28 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 12,590 | 18.45 | 232,285.50 |
| BALL CORPORATION | 15,187 | 65.27 | 991,255.49 |
| CELANESE CORPORATION | 6,420 | 78.79 | 505,831.80 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 12,002 | 28.00 | 336,056.00 |
| CORTEVA INC | 38,111 | 26.27 | 1,001,175.97 |
| CROWN HOLDINGS INC | 6,863 | 59.22 | 406,426.86 |
| DOW INC | 37,953 | 33.12 | 1,257,003.36 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 38,956 | 41.90 | 1,632,256.40 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 7,027 | 57.27 | 402,436.29 |
| ECOLAB INC | 13,499 | 180.08 | 2,430,899.92 |
| FMC CORPORATION | 6,676 | 88.20 | 588,823.20 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 69,858 | 8.48 | 592,395.84 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 19,140 | 31.13 | 595,828.20 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 4,871 | 126.49 | 616,132.79 |
| LINDE PLC | 27,616 | 181.47 | 5,011,475.52 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 14,793 | 50.05 | 740,389.65 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 3,092 | 177.35 | 548,366.20 |
| MOSAIC CO/THE | 18,584 | 11.33 | 210,556.72 |
| NEWMONT CORPORATION | 42,763 | 63.11 | 2,698,772.93 |
| NUCOR CORP | 15,455 | 37.87 | 585,280.85 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 4,682 | 85.99 | 402,605.18 |
| PPG INDUSTRIES INC | 12,848 | 92.74 | 1,191,523.52 |
| RPM INTERNATIONAL INC | 6,118 | 65.05 | 397,975.90 |
| SEALED AIR CORP | 7,895 | 28.49 | 224,928.55 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 4,330 | 506.06 | 2,191,239.80 |
| STEEL DYNAMICS, INC. | 10,191 | 23.54 | 239,896.14 |
| VULCAN MATERIALS CO | 6,698 | 102.03 | 683,396.94 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 1,475 | 40.70 | 60,032.50 |
| WESTROCK CO | 13,034 | 28.88 | 376,421.92 |
| 3M COMPANY | 29,528 | 147.00 | 4,340,616.00 |
| ACUITY BRANDS INC | 1,884 | 83.34 | 157,012.56 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 3,944 | 22.26 | 87,793.44 |
| ALLEGION PLC | 4,764 | 96.57 | 460,059.48 |
| AMETEK INC | 11,307 | 77.06 | 871,317.42 |
| BOEING CO | 27,646 | 128.98 | 3,565,781.08 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 42,223 | 16.25 | 686,123.75 |

| | | | |
|------------------------------------|---------|--------|--------------|
| CATERPILLAR INC | 28,560 | 114.04 | 3,256,982.40 |
| CUMMINS INC | 7,482 | 147.77 | 1,105,615.14 |
| DEERE & CO | 15,183 | 138.63 | 2,104,819.29 |
| DOVER CORP | 7,186 | 90.97 | 653,710.42 |
| EATON CORP PLC | 21,253 | 78.86 | 1,676,011.58 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 31,316 | 53.82 | 1,685,427.12 |
| FASTENAL COMPANY | 29,021 | 36.03 | 1,045,626.63 |
| FLOWSERVE CORPORATION | 6,650 | 25.53 | 169,774.50 |
| FORTIVE CORP | 14,950 | 60.34 | 902,083.00 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY | 6,450 | 43.72 | 281,994.00 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 12,642 | 129.30 | 1,634,610.60 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 450,795 | 6.26 | 2,821,976.70 |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 7,787 | 27.85 | 216,867.95 |
| HEICO CORP | 1,888 | 75.70 | 142,921.60 |
| HEICO CORP-CLASS A | 4,435 | 66.77 | 296,124.95 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 36,734 | 135.52 | 4,978,191.68 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 19,024 | 10.81 | 205,649.44 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES | 2,107 | 184.50 | 388,741.50 |
| IDEX CORP | 3,839 | 152.72 | 586,292.08 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 16,690 | 158.23 | 2,640,858.70 |
| INGERSOLL-RAND INC | 16,918 | 27.82 | 470,658.76 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6,927 | 80.00 | 554,160.00 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED | 11,500 | 47.11 | 541,765.00 |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED | 10,600 | 22.86 | 242,316.00 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 40,974 | 27.91 | 1,143,584.34 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 11,089 | 189.85 | 2,105,246.65 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,056 | 176.51 | 362,904.56 |
| LOCKHEED MARTIN CORPORATION | 13,059 | 381.77 | 4,985,534.43 |
| MASCO CORP | 14,885 | 40.05 | 596,144.25 |
| MIDDLEBY CORP | 2,823 | 51.49 | 145,356.27 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 8,295 | 339.31 | 2,814,576.45 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 21,111 | 47.85 | 1,010,161.35 |
| OWENS CORNING | 5,205 | 37.10 | 193,105.50 |
| PACCAR INC | 17,781 | 67.48 | 1,199,861.88 |
| PARKER HANNIFIN CORPORATION | 6,505 | 134.95 | 877,849.75 |
| PENTAIR PLC-REGISTERED | 8,220 | 31.67 | 260,327.40 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 77,798 | 63.43 | 4,934,727.14 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 6,219 | 174.59 | 1,085,775.21 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 5,445 | 306.41 | 1,668,402.45 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 7,600 | 34.55 | 262,580.00 |
| SMITH(A.O.) CORP | 7,157 | 40.39 | 289,071.23 |
| SNAP-ON INC | 2,407 | 116.07 | 279,380.49 |

| | | | |
|----------------------------------|--------|--------|--------------|
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A | 5,137 | 18.09 | 92,928.33 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 7,684 | 107.74 | 827,874.16 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 2,060 | 316.04 | 651,042.40 |
| TEXTRON INC | 11,803 | 27.03 | 319,035.09 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 12,759 | 84.03 | 1,072,138.77 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 2,427 | 304.92 | 740,040.84 |
| UNITED RENTALS INC | 3,596 | 106.05 | 381,355.80 |
| WABCO HOLDINGS INC | 2,598 | 135.16 | 351,145.68 |
| WABTEC CORP | 9,231 | 53.44 | 493,304.64 |
| WW GRAINGER INC | 2,390 | 269.61 | 644,367.90 |
| XYLEM INC | 9,124 | 68.52 | 625,176.48 |
| CINTAS CORP | 4,833 | 200.18 | 967,469.94 |
| COPART INC | 10,456 | 73.83 | 771,966.48 |
| COSTAR GROUP INC | 1,853 | 593.60 | 1,099,940.80 |
| EQUIFAX INC | 6,127 | 131.42 | 805,210.34 |
| IHS MARKIT LTD | 19,584 | 65.60 | 1,284,710.40 |
| MANPOWERGROUP | 3,264 | 68.75 | 224,400.00 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 18,026 | 12.47 | 224,784.22 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 11,415 | 76.10 | 868,681.50 |
| ROBERT HALF INTL INC | 5,555 | 44.06 | 244,753.30 |
| ROLLINS INC | 6,451 | 38.14 | 246,041.14 |
| TRANSUNION | 9,497 | 72.13 | 685,018.61 |
| VERISK ANALYTICS INC | 8,444 | 148.54 | 1,254,271.76 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 13,556 | 85.74 | 1,162,291.44 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 22,016 | 98.48 | 2,168,135.68 |
| AMERCO | 390 | 252.54 | 98,490.60 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 5,676 | 10.31 | 58,519.56 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC. | 6,925 | 72.28 | 500,539.00 |
| CSX CORPORATION | 38,440 | 63.82 | 2,453,240.80 |
| DELTA AIR LINES INC | 8,299 | 22.41 | 185,980.59 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 8,148 | 71.93 | 586,085.64 |
| FEDEX CORP | 12,743 | 123.06 | 1,568,153.58 |
| J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 4,411 | 101.60 | 448,157.60 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 5,100 | 131.41 | 670,191.00 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION | 7,940 | 35.88 | 284,887.20 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 13,060 | 160.68 | 2,098,480.80 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 4,926 | 141.63 | 697,669.38 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 6,316 | 29.33 | 185,248.28 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 23,948 | 29.49 | 706,226.52 |
| UNION PACIFIC CORP | 35,688 | 156.09 | 5,570,539.92 |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 2,880 | 25.56 | 73,612.80 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 36,101 | 100.18 | 3,616,598.18 |

| | | | |
|------------------------------------|---------|----------|--------------|
| XPO LOGISTICS INC | 4,716 | 66.00 | 311,256.00 |
| APTIV PLC | 13,074 | 62.74 | 820,262.76 |
| AUTOLIV INC | 4,001 | 60.75 | 243,060.75 |
| BORGWARNER INC | 12,075 | 27.08 | 326,991.00 |
| FORD MOTOR COMPANY | 208,063 | 4.87 | 1,013,266.81 |
| GENERAL MOTORS CO | 67,788 | 21.95 | 1,487,946.60 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 7,347 | 18.67 | 137,168.49 |
| LEAR CORP | 2,749 | 88.50 | 243,286.50 |
| TESLA INC | 6,950 | 725.15 | 5,039,792.50 |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 6,229 | 12.50 | 77,862.50 |
| D.R.HORTON INC | 17,316 | 40.94 | 708,917.04 |
| GARMIN LTD | 6,739 | 78.92 | 531,841.88 |
| HANESBRANDS INC | 22,204 | 8.44 | 187,401.76 |
| HASBRO INC | 7,491 | 74.87 | 560,851.17 |
| LEGGETT & PLATT INC | 6,656 | 29.88 | 198,881.28 |
| LENNAR CORP-CL A | 13,372 | 42.88 | 573,391.36 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 6,005 | 214.55 | 1,288,372.75 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 2,863 | 78.96 | 226,062.48 |
| NEWELL BRANDS INC | 18,477 | 12.91 | 238,538.07 |
| NIKE INC -CL B | 64,058 | 88.37 | 5,660,805.46 |
| NVR INC | 173 | 2,847.37 | 492,595.01 |
| POLARIS INC | 2,467 | 63.33 | 156,235.11 |
| PULTE GROUP INC | 13,065 | 25.64 | 334,986.60 |
| PVH CORP | 3,303 | 41.36 | 136,612.08 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 1,971 | 68.30 | 134,619.30 |
| TAPESTRY INC | 14,712 | 13.64 | 200,671.68 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 8,634 | 10.00 | 86,340.00 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 8,291 | 8.97 | 74,370.27 |
| VF CORP | 17,117 | 54.57 | 934,074.69 |
| WHIRLPOOL CORP | 3,212 | 104.58 | 335,910.96 |
| ARAMARK | 13,242 | 24.57 | 325,355.94 |
| CARNIVAL CORP | 21,372 | 11.91 | 254,540.52 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 1,306 | 882.47 | 1,152,505.82 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 5,866 | 68.82 | 403,698.12 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 2,121 | 367.29 | 779,022.09 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 14,617 | 71.37 | 1,043,215.29 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 17,634 | 43.78 | 772,016.52 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 14,715 | 80.71 | 1,187,647.65 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 38,716 | 184.02 | 7,124,518.32 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR | 14,027 | 15.11 | 211,947.97 |
| MGM MIRAGE | 25,878 | 13.94 | 360,739.32 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS | 10,922 | 10.86 | 118,612.92 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|----------|---------------|
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 9,036 | 35.68 | 322,404.48 |
| STARBUCKS CORP | 60,807 | 75.58 | 4,595,793.06 |
| VAIL RESORTS INC | 2,038 | 153.94 | 313,729.72 |
| WYNN RESORTS LTD | 4,913 | 76.61 | 376,384.93 |
| YUM! BRANDS INC | 15,549 | 85.89 | 1,335,503.61 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 39,230 | 66.65 | 2,614,679.50 |
| ALPHABET INC-CL A | 15,446 | 1,276.60 | 19,718,363.60 |
| ALPHABET INC-CL C | 15,938 | 1,279.31 | 20,389,642.78 |
| ALTICE USA INC-A | 6,300 | 26.21 | 165,123.00 |
| CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A | 7,729 | 508.55 | 3,930,582.95 |
| COMCAST CORP-CLASS A | 233,390 | 37.16 | 8,672,772.40 |
| DISCOVERY INC-A | 7,075 | 21.02 | 148,716.50 |
| DISCOVERY INC-C | 18,283 | 19.14 | 349,936.62 |
| DISH NETWORK CORP. | 12,937 | 23.40 | 302,725.80 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 15,352 | 116.31 | 1,785,591.12 |
| FACEBOOK INC-A | 124,019 | 190.07 | 23,572,291.33 |
| FOX CORPORATION-CLASS A | 16,962 | 24.83 | 421,251.27 |
| FOX CORPORATION-CLASS B | 8,773 | 24.52 | 215,113.96 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 3,974 | 223.67 | 888,864.58 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 19,626 | 14.74 | 289,287.24 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 5,418 | 126.08 | 683,101.44 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 8,432 | 18.38 | 154,980.16 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 21,079 | 17.51 | 369,198.68 |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 10,288 | 27.44 | 282,302.72 |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 7,648 | 31.08 | 237,699.84 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 4,141 | 30.64 | 126,880.24 |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 7,512 | 38.24 | 287,258.88 |
| MATCH GROUP INC | 2,681 | 81.23 | 217,777.63 |
| NETFLIX INC | 22,530 | 424.99 | 9,575,024.70 |
| NEWS CORP-CLASS A | 16,662 | 8.83 | 147,125.46 |
| OMNICOM GROUP | 10,417 | 52.03 | 541,996.51 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 14,828 | 20.62 | 305,753.36 |
| ROKU INC | 4,624 | 124.83 | 577,213.92 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 81,768 | 5.50 | 450,132.84 |
| SNAP INC-A | 35,102 | 16.00 | 561,632.00 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 5,707 | 127.88 | 729,811.16 |
| THE WALT DISNEY CO. | 92,661 | 101.19 | 9,376,366.59 |
| TRIPADVISOR INC-W/I | 4,051 | 18.44 | 74,700.44 |
| TWITTER INC | 37,026 | 28.74 | 1,064,127.24 |
| VIACOMCBS INC | 32,846 | 15.63 | 513,382.98 |
| ZILLOW GROUP INC-C | 7,906 | 40.70 | 321,813.73 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 3,426 | 117.59 | 402,863.34 |

| | | | |
|---------------------------------|---------|----------|---------------|
| AMAZON.COM INC | 21,665 | 2,410.22 | 52,217,416.30 |
| AUTOZONE INC | 1,271 | 1,047.04 | 1,330,787.84 |
| BEST BUY COMPANY INC | 13,126 | 71.88 | 943,496.88 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 2,165 | 1,362.77 | 2,950,397.05 |
| BURLINGTON STORES INC | 3,739 | 174.49 | 652,418.11 |
| CARMAX INC | 8,427 | 70.96 | 597,979.92 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 13,035 | 175.98 | 2,293,899.30 |
| DOLLAR TREE INC | 12,047 | 74.54 | 897,983.38 |
| EBAY INC | 39,732 | 39.35 | 1,563,454.20 |
| EXPEDIA GROUP INC | 6,894 | 66.57 | 458,933.58 |
| GAP INC/THE | 9,218 | 6.90 | 63,604.20 |
| GENUINE PARTS CO | 7,406 | 75.03 | 555,672.18 |
| GRUBHUB INC | 4,403 | 43.52 | 191,618.56 |
| HOME DEPOT INC | 56,079 | 212.18 | 11,898,842.22 |
| KOHL'S CORP | 8,274 | 15.80 | 130,729.20 |
| LKQ CORPORATION | 15,922 | 21.33 | 339,616.26 |
| LOWE'S COMPANIES INC | 39,710 | 98.75 | 3,921,362.50 |
| MERCADOLIBRE INC | 2,251 | 571.27 | 1,285,928.77 |
| NORDSTROM INC | 4,756 | 17.84 | 84,847.04 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW | 4,012 | 384.82 | 1,543,897.84 |
| ROSS STORES INC | 18,131 | 85.49 | 1,550,019.19 |
| TARGET CORP | 26,051 | 107.82 | 2,808,818.82 |
| TIFFANY & CO | 5,541 | 126.35 | 700,105.35 |
| TJX COMPANIES INC | 62,641 | 46.05 | 2,884,618.05 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 6,117 | 101.98 | 623,811.66 |
| ULTA BEAUTY INC | 2,765 | 210.52 | 582,087.80 |
| WAYFAIR INC-CLASS A | 2,887 | 122.41 | 353,397.67 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 22,712 | 310.55 | 7,053,211.60 |
| DAIRY FARM INTL HLDGS-900 | 13,500 | 4.74 | 63,990.00 |
| KROGER CO | 39,652 | 32.96 | 1,306,929.92 |
| SYSCO CORP | 26,129 | 53.08 | 1,386,927.32 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 39,655 | 43.74 | 1,734,509.70 |
| WALMART INC | 73,512 | 129.44 | 9,515,393.28 |
| ALTRIA GROUP INC | 95,985 | 39.42 | 3,783,728.70 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 28,404 | 35.99 | 1,022,259.96 |
| BROWN-FORMAN CORPORATION | 15,620 | 61.13 | 954,850.60 |
| BUNGE LIMITED | 7,174 | 39.61 | 284,162.14 |
| CAMPBELL SOUP CO | 7,879 | 50.75 | 399,859.25 |
| COCA-COLA CO/THE | 210,391 | 45.43 | 9,558,063.13 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 12,033 | 40.25 | 484,328.25 |
| CONAGRA BRANDS INC | 24,639 | 34.18 | 842,161.02 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 8,881 | 158.83 | 1,410,569.23 |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|---------------|
| GENERAL MILLS INC | 31,072 | 60.48 | 1,879,234.56 |
| HORMEL FOODS CORPORATION | 14,939 | 46.61 | 696,306.79 |
| INGREDION INC | 3,320 | 80.57 | 267,492.40 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 5,768 | 117.80 | 679,470.40 |
| KELLOGG CO | 12,949 | 64.10 | 830,030.90 |
| KRAFT HEINZ COMPANY | 34,009 | 29.23 | 994,083.07 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 7,417 | 57.78 | 428,554.26 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 6,209 | 154.26 | 957,800.34 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 9,629 | 43.03 | 414,335.87 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 74,020 | 51.41 | 3,805,368.20 |
| MONSTER BEVERAGE CORPORATION | 19,947 | 59.80 | 1,192,830.60 |
| PEPSICO INC | 72,083 | 134.36 | 9,685,071.88 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 79,987 | 73.67 | 5,892,642.29 |
| THE HERSHEY COMPANY | 7,514 | 135.74 | 1,019,950.36 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 14,949 | 58.98 | 881,692.02 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 12,485 | 71.35 | 890,804.75 |
| CLOROX COMPANY | 6,208 | 190.65 | 1,183,555.20 |
| COLGATE-PALMOLIVE COMPANY | 41,857 | 71.40 | 2,988,589.80 |
| COTY INC-CL A | 16,985 | 6.27 | 106,495.95 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 11,317 | 166.31 | 1,882,130.27 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 17,800 | 141.66 | 2,521,548.00 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 128,483 | 118.78 | 15,261,210.74 |
| ABBOTT LABORATORIES | 91,466 | 94.06 | 8,603,291.96 |
| ABIOMED INC | 2,288 | 168.52 | 385,573.76 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 3,854 | 191.97 | 739,852.38 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 7,993 | 88.70 | 708,979.10 |
| ANTHEM INC | 13,036 | 264.12 | 3,443,068.32 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 24,935 | 92.92 | 2,316,960.20 |
| BECTON DICKINSON & CO | 14,106 | 268.17 | 3,782,806.02 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 71,656 | 36.90 | 2,644,106.40 |
| CARDINAL HEALTH INC | 15,114 | 50.32 | 760,536.48 |
| CENTENE CORP | 29,691 | 70.58 | 2,095,590.78 |
| CERNER CORP | 15,537 | 72.75 | 1,130,316.75 |
| CIGNA CORPORATION | 19,198 | 188.20 | 3,613,063.60 |
| COOPER COMPANIES INC (THE) | 2,509 | 293.21 | 735,663.89 |
| CVS HEALTH CORPORATION | 66,864 | 62.31 | 4,166,295.84 |
| DANAHER CORP | 32,178 | 165.07 | 5,311,622.46 |
| DAVITA INC | 5,115 | 74.00 | 378,510.00 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 11,864 | 39.31 | 466,373.84 |
| DEXCOM INC | 4,617 | 332.44 | 1,534,875.48 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 10,722 | 223.48 | 2,396,152.56 |
| HCA HEALTHCARE INC | 14,352 | 107.83 | 1,547,576.16 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| HENRY SCHEIN INC | 7,559 | 52.39 | 396,016.01 |
| HOLOGIC INC | 13,592 | 47.11 | 640,319.12 |
| HUMANA INC. | 6,808 | 369.09 | 2,512,764.72 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 4,361 | 271.80 | 1,185,319.80 |
| INSULET CORP | 2,958 | 203.83 | 602,929.14 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 5,988 | 514.93 | 3,083,400.84 |
| LABORATORY CRP OF AMR HLDGS | 4,995 | 163.72 | 817,781.40 |
| MCKESSON CORP | 7,996 | 139.94 | 1,118,960.24 |
| MEDTRONIC PLC | 68,908 | 99.30 | 6,842,564.40 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 6,814 | 106.62 | 726,508.68 |
| RESMED INC | 7,271 | 161.00 | 1,170,631.00 |
| STERIS PLC | 4,287 | 147.82 | 633,704.34 |
| STRYKER CORP | 17,447 | 188.12 | 3,282,129.64 |
| TELEFLEX INC | 2,340 | 338.39 | 791,832.60 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 48,895 | 291.29 | 14,242,624.55 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 4,203 | 101.65 | 427,234.95 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 4,349 | 108.68 | 472,649.32 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 6,481 | 187.63 | 1,216,030.03 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 4,188 | 195.54 | 818,921.52 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 10,856 | 116.45 | 1,264,181.20 |
| ABBVIE INC | 76,670 | 83.59 | 6,408,845.30 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 15,308 | 75.75 | 1,159,581.00 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 10,946 | 108.12 | 1,183,481.52 |
| ALLERGAN PLC | 16,877 | 186.90 | 3,154,311.30 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 5,613 | 145.63 | 817,421.19 |
| AMGEN INC | 30,771 | 236.28 | 7,270,571.88 |
| BEIGENE LTD-ADR | 1,850 | 160.20 | 296,370.00 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 1,220 | 433.01 | 528,272.20 |
| BIOGEN INC | 9,176 | 297.80 | 2,732,612.80 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 9,080 | 97.31 | 883,574.80 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 121,044 | 62.25 | 7,534,989.00 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 17,964 | 23.85 | 428,441.40 |
| ELI LILLY & CO | 44,424 | 162.93 | 7,238,002.32 |
| EXACT SCIENCES CORP | 6,832 | 75.46 | 515,542.72 |
| GILEAD SCIENCES INC | 64,930 | 79.64 | 5,171,025.20 |
| ILLUMINA INC | 7,655 | 309.07 | 2,365,930.85 |
| INCYTE CORP | 9,243 | 103.48 | 956,465.64 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 6,760 | 58.15 | 393,094.00 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 8,158 | 128.86 | 1,051,239.88 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 2,604 | 107.15 | 279,018.60 |
| JOHNSON & JOHNSON | 135,649 | 154.86 | 21,006,604.14 |
| MERCK & CO. INC. | 131,546 | 81.43 | 10,711,790.78 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|---------------|
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 1,258 | 713.38 | 897,432.04 |
| MYLAN NV | 26,138 | 15.76 | 411,934.88 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 4,186 | 98.18 | 410,981.48 |
| PERKINELMER INC | 5,624 | 87.55 | 492,381.20 |
| PERRIGO CO PLC | 6,187 | 51.43 | 318,197.41 |
| PFIZER INC | 285,960 | 37.38 | 10,689,184.80 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 4,162 | 566.21 | 2,356,566.02 |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 3,828 | 121.53 | 465,216.84 |
| SEATTLE GENETICS INC | 5,726 | 146.04 | 836,225.04 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR | 59,290 | 10.22 | 605,943.80 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 20,615 | 328.70 | 6,776,150.50 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 13,417 | 269.86 | 3,620,711.62 |
| WATERS CORP | 3,527 | 191.32 | 674,785.64 |
| ZOETIS INC | 24,652 | 125.91 | 3,103,933.32 |
| BANK OF AMERICA CORP | 440,243 | 22.18 | 9,764,589.74 |
| CITIGROUP INC | 112,237 | 43.10 | 4,837,414.70 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 20,799 | 20.60 | 428,459.40 |
| COMERICA INC | 7,691 | 32.13 | 247,111.83 |
| EAST WEST BANCORP INC | 9,201 | 30.37 | 279,434.37 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 33,954 | 17.12 | 581,292.48 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 8,897 | 100.05 | 890,144.85 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 53,062 | 8.16 | 432,985.92 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 161,245 | 90.71 | 14,626,533.95 |
| KEYCORP | 51,128 | 10.90 | 557,295.20 |
| M & T BANK CORP | 5,998 | 105.06 | 630,149.88 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 20,200 | 11.88 | 239,976.00 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 22,526 | 100.73 | 2,269,043.98 |
| REGIONS FINANCIAL CORPORATION | 45,237 | 9.79 | 442,870.23 |
| SIGNATURE BANK | 2,508 | 94.12 | 236,052.96 |
| SVB FINANCIAL GROUP | 2,640 | 184.00 | 485,760.00 |
| TRUIST FINANCIAL CORPORATION | 68,950 | 35.48 | 2,446,346.00 |
| US BANCORP | 76,789 | 34.00 | 2,610,826.00 |
| WELLS FARGO & COMPANY | 206,558 | 26.92 | 5,560,541.36 |
| ZIONS BANCORPORATION | 8,874 | 29.46 | 261,428.04 |
| ALLY FINANCIAL INC | 20,139 | 14.30 | 287,987.70 |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 35,757 | 83.17 | 2,973,909.69 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 6,062 | 107.48 | 651,543.76 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE) | 42,207 | 35.76 | 1,509,322.32 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 67,565 | 186.52 | 12,602,223.80 |
| BLACKROCK INC | 5,952 | 475.14 | 2,828,033.28 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A | 34,684 | 48.43 | 1,679,746.12 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 24,649 | 56.15 | 1,384,041.35 |

| | | | |
|-----------------------------------|--------|--------|--------------|
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 5,661 | 96.52 | 546,399.72 |
| CME GROUP INC. | 18,423 | 182.72 | 3,366,250.56 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 16,425 | 36.23 | 595,077.75 |
| E*TRADE FINANCIAL CORPORATION | 10,809 | 38.66 | 417,875.94 |
| EATON VANCE CORP | 5,530 | 33.58 | 185,697.40 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 22,820 | 16.00 | 365,120.00 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 1,939 | 274.43 | 532,119.77 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 14,298 | 15.92 | 227,624.16 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 16,520 | 177.00 | 2,924,040.00 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 28,913 | 88.92 | 2,570,943.96 |
| INVESCO LIMITED | 18,328 | 7.80 | 142,958.40 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 12,885 | 12.17 | 156,810.45 |
| KKR & CO INC -A | 24,824 | 23.61 | 586,094.64 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 1,912 | 421.02 | 804,990.24 |
| MOODY'S CORP | 8,888 | 245.20 | 2,179,337.60 |
| MORGAN STANLEY | 62,409 | 37.97 | 2,369,669.73 |
| MSCI INC-A | 4,383 | 324.89 | 1,423,992.87 |
| NASDAQ INC | 6,498 | 105.63 | 686,383.74 |
| NORTHERN TRUST CORP | 11,127 | 77.39 | 861,118.53 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 6,426 | 61.55 | 395,520.30 |
| S&P GLOBAL INC | 12,564 | 283.94 | 3,567,422.16 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 59,841 | 35.40 | 2,118,371.40 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 5,574 | 48.82 | 272,150.55 |
| STATE STREET CORP | 18,694 | 57.41 | 1,073,222.54 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 27,825 | 16.97 | 472,190.25 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 12,364 | 100.34 | 1,240,603.76 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION | 14,028 | 36.72 | 515,108.16 |
| VOYA FINANCIAL INC | 7,308 | 41.74 | 305,035.92 |
| AFLAC INC | 38,953 | 36.29 | 1,413,604.37 |
| ALLEGHANY CORPORATION | 689 | 524.97 | 361,704.33 |
| ALLSTATE CORP | 16,654 | 101.44 | 1,689,381.76 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 3,539 | 61.65 | 218,179.35 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 47,036 | 23.35 | 1,098,290.60 |
| AON PLC | 11,871 | 175.54 | 2,083,835.34 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD. | 20,476 | 23.64 | 484,052.64 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 9,394 | 75.28 | 707,180.32 |
| ASSURANT INC | 3,114 | 104.65 | 325,880.10 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 8,199 | 23.64 | 193,824.36 |
| BROWN & BROWN INC | 10,899 | 34.76 | 378,849.24 |
| CHUBB LTD | 23,475 | 104.02 | 2,441,869.50 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 7,858 | 78.53 | 617,088.74 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 1,288 | 173.32 | 223,236.16 |

| | | | |
|--|--------|--------|--------------|
| EVEREST RE GROUP LTD | 2,065 | 170.81 | 352,722.65 |
| FNF GROUP | 13,937 | 26.25 | 365,846.25 |
| GLOBE LIFE INC | 6,040 | 76.07 | 459,462.80 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 18,331 | 36.04 | 660,649.24 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 8,356 | 30.21 | 252,434.76 |
| LOEWS CORPORATION | 13,914 | 32.40 | 450,813.60 |
| MARKEL CORP | 702 | 879.54 | 617,437.08 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 26,208 | 93.29 | 2,444,944.32 |
| METLIFE INC | 41,534 | 33.30 | 1,383,082.20 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 14,124 | 29.98 | 423,437.52 |
| PROGRESSIVE CORP | 30,367 | 82.87 | 2,516,513.29 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 20,728 | 55.78 | 1,156,207.84 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 3,022 | 101.29 | 306,098.38 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 2,239 | 141.13 | 315,990.07 |
| TRAVELERS COS INC(THE) | 13,126 | 100.82 | 1,323,363.32 |
| UNUM GROUP | 9,769 | 15.35 | 149,954.15 |
| W.R.BERKLEY CORPORATION | 7,428 | 50.24 | 373,182.72 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 6,823 | 177.22 | 1,209,172.06 |
| CBRE GROUP INC-A | 16,199 | 39.99 | 647,798.01 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 21,483 | 161.61 | 3,471,867.63 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 52,300 | 4.00 | 209,200.00 |
| JONES LANG LASALLE INC | 2,618 | 102.48 | 268,292.64 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 5,916 | 305.79 | 1,809,053.64 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 32,648 | 175.46 | 5,728,418.08 |
| ADOBE INC | 24,886 | 344.10 | 8,563,272.60 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 8,321 | 102.78 | 855,232.38 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 2,222 | 40.40 | 89,768.80 |
| ANSYS INC | 4,256 | 259.45 | 1,104,219.20 |
| AUTODESK INC | 11,506 | 180.35 | 2,075,107.10 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 22,245 | 139.23 | 3,097,171.35 |
| BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED | 7,623 | 68.96 | 525,682.08 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 8,029 | 75.86 | 609,079.94 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 5,889 | 111.44 | 656,270.16 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 14,250 | 80.52 | 1,147,410.00 |
| CDK GLOBAL INC | 5,808 | 34.71 | 201,595.68 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 6,244 | 104.37 | 651,686.28 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 6,676 | 146.04 | 974,963.04 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION | 28,737 | 53.81 | 1,546,337.97 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 1,984 | 94.70 | 187,884.80 |
| DOCUSIGN INC | 5,401 | 105.07 | 567,483.07 |
| DROPBOX INC-CLASS A | 10,565 | 20.20 | 213,465.82 |
| DXC TECHNOLOGY CO | 11,825 | 15.92 | 188,254.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| EPAM SYSTEMS INC | 3,128 | 203.03 | 635,077.84 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 31,596 | 125.73 | 3,972,565.08 |
| FISERV INC | 30,144 | 96.29 | 2,902,565.76 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 4,371 | 222.62 | 973,072.02 |
| FORTINET INC | 7,360 | 103.27 | 760,067.20 |
| GARTNER INC | 4,568 | 109.76 | 501,383.68 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 15,685 | 153.01 | 2,399,961.85 |
| GODADDY INC - CLASS A | 8,905 | 67.39 | 600,107.95 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 4,731 | 87.17 | 412,401.27 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 45,493 | 124.72 | 5,673,886.96 |
| INTUIT INC | 13,382 | 263.66 | 3,528,298.12 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 3,915 | 159.11 | 622,915.65 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 6,947 | 101.95 | 708,246.65 |
| MASTERCARD INC-CL A | 46,151 | 258.76 | 11,942,032.76 |
| MICROSOFT CORP | 372,892 | 174.55 | 65,088,298.60 |
| MONGODB INC | 2,035 | 159.94 | 325,477.90 |
| NORTONLIFELOCK INC | 31,347 | 20.96 | 657,033.12 |
| OKTA INC | 5,270 | 155.35 | 818,694.50 |
| ORACLE CORPORATION | 118,127 | 53.01 | 6,261,912.27 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 4,867 | 193.45 | 941,521.15 |
| PAYCHEX INC | 17,507 | 68.09 | 1,192,051.63 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 2,522 | 211.80 | 534,159.60 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 57,346 | 120.18 | 6,891,842.28 |
| PTC INC | 5,462 | 65.00 | 355,030.00 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 4,049 | 238.73 | 966,617.77 |
| SABRE CORP | 13,930 | 5.59 | 77,868.70 |
| SALESFORCE.COM, INC. | 42,832 | 153.98 | 6,595,271.36 |
| SERVICENOW INC | 9,802 | 302.94 | 2,969,417.88 |
| SPLUNK INC | 7,614 | 128.63 | 979,388.82 |
| SQUARE INC-A | 17,051 | 62.01 | 1,057,332.51 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 11,546 | 51.21 | 591,270.66 |
| SYNOPSYS INC | 7,601 | 153.03 | 1,163,181.03 |
| TWILIO INC-A | 5,649 | 109.95 | 621,107.55 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 1,865 | 314.71 | 586,934.15 |
| VERISIGN INC | 5,227 | 212.13 | 1,108,803.51 |
| VISA INC | 88,048 | 167.32 | 14,732,191.36 |
| VMWARE INC | 4,194 | 128.17 | 537,544.98 |
| WESTERN UNION COMPANY | 21,840 | 18.50 | 404,040.00 |
| WIX.COM LTD | 2,557 | 134.36 | 343,558.52 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 8,688 | 144.96 | 1,259,412.48 |
| AMPHENOL CORPORATION -CL A | 15,698 | 86.17 | 1,352,696.66 |
| APPLE INC | 228,505 | 282.97 | 64,660,059.85 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ARISTA NETWORKS INC | 2,720 | 216.81 | 589,723.20 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 4,130 | 55.20 | 227,976.00 |
| CDW CORP/DE | 7,404 | 104.77 | 775,717.08 |
| CISCO SYSTEMS INC | 218,093 | 42.52 | 9,273,314.36 |
| COGNEX CORP | 8,698 | 48.80 | 424,462.40 |
| CORNING INC | 38,044 | 20.78 | 790,554.32 |
| DELL TECHNOLOGIES INC-C | 7,900 | 39.69 | 313,551.00 |
| F5 NETWORKS INC | 2,909 | 127.32 | 370,373.88 |
| FLEX LTD | 23,204 | 8.10 | 187,952.40 |
| FLIR SYSTEMS INC | 6,867 | 39.66 | 272,345.22 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C | 61,911 | 9.53 | 590,011.83 |
| HP INC | 78,476 | 15.00 | 1,177,140.00 |
| IPG PHOTONICS CORP | 1,776 | 120.90 | 214,718.40 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 17,460 | 23.29 | 406,643.40 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 9,542 | 97.54 | 930,726.68 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 9,241 | 152.80 | 1,412,024.80 |
| NETAPP INC | 10,919 | 43.06 | 470,172.14 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 12,634 | 48.63 | 614,391.42 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 16,545 | 70.15 | 1,160,631.75 |
| TRIMBLE INC | 12,759 | 32.63 | 416,326.17 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 14,857 | 40.69 | 604,531.33 |
| XEROX HOLDINGS CORP | 9,697 | 17.97 | 174,255.09 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 2,737 | 208.62 | 570,992.94 |
| AT&T INC | 375,942 | 29.71 | 11,169,236.82 |
| CENTURYLINK INC | 49,758 | 10.21 | 508,029.18 |
| T-MOBILE US INC | 22,097 | 90.80 | 2,006,407.60 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 213,529 | 57.93 | 12,369,734.97 |
| AES CORPORATION | 33,656 | 12.86 | 432,816.16 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 12,101 | 49.98 | 604,807.98 |
| AMEREN CORPORATION | 12,454 | 73.64 | 917,112.56 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 25,727 | 83.23 | 2,141,258.21 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 9,154 | 125.01 | 1,144,341.54 |
| ATMOS ENERGY CORP | 5,710 | 104.41 | 596,181.10 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 25,464 | 16.68 | 424,739.52 |
| CMS ENERGY CORPORATION | 14,040 | 59.40 | 833,976.00 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 16,493 | 82.64 | 1,362,981.52 |
| DOMINION ENERGY INC | 42,503 | 77.92 | 3,311,833.76 |
| DTE ENERGY COMPANY | 10,496 | 103.02 | 1,081,297.92 |
| DUKE ENERGY CORP | 37,900 | 85.69 | 3,247,651.00 |
| EDISON INTERNATIONAL | 17,941 | 59.25 | 1,063,004.25 |
| ENERGY CORP | 10,866 | 97.53 | 1,059,760.98 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 10,092 | 43.68 | 440,818.56 |

| | | | |
|-----------------------------------|------------|--------|---------------------------------------|
| EVERGY INC | 11,273 | 58.51 | 659,583.23 |
| EVERSOURCE ENERGY | 16,644 | 86.57 | 1,440,871.08 |
| EXELON CORP | 50,837 | 36.60 | 1,860,634.20 |
| FIRSTENERGY CORP | 26,948 | 42.32 | 1,140,439.36 |
| NEXTERA ENERGY INC | 25,128 | 239.70 | 6,023,181.60 |
| NISOURCE INC | 18,919 | 26.03 | 492,461.57 |
| NRG ENERGY INC | 13,547 | 32.60 | 441,632.20 |
| OGE ENERGY CORP | 11,870 | 31.27 | 371,174.90 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION | 5,996 | 77.14 | 462,531.44 |
| PPL CORPORATION | 36,597 | 25.49 | 932,857.53 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 24,964 | 51.37 | 1,282,400.68 |
| SEMPRA ENERGY | 14,772 | 126.97 | 1,875,600.84 |
| SOUTHERN CO | 54,269 | 57.73 | 3,132,949.37 |
| UGI CORPORATION | 10,588 | 28.24 | 299,005.12 |
| VISTRA ENERGY CORP | 18,354 | 18.04 | 331,106.16 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 16,438 | 93.77 | 1,541,391.26 |
| XCEL ENERGY INC | 26,959 | 64.57 | 1,740,742.63 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 54,897 | 56.18 | 3,084,113.46 |
| ANALOG DEVICES INC | 19,298 | 105.92 | 2,044,044.16 |
| APPLIED MATERIALS INC | 48,260 | 51.74 | 2,496,972.40 |
| BROADCOM INC | 20,398 | 264.81 | 5,401,594.38 |
| INTEL CORP | 223,631 | 59.26 | 13,252,373.06 |
| KLA CORPORATION | 7,805 | 164.92 | 1,287,200.60 |
| LAM RESEARCH CORP | 7,581 | 266.67 | 2,021,625.27 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 31,750 | 27.13 | 861,377.50 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 13,814 | 53.67 | 741,397.38 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 12,065 | 82.01 | 989,450.65 |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 57,501 | 44.16 | 2,539,244.16 |
| NVIDIA CORP | 29,890 | 289.59 | 8,655,845.10 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 14,457 | 94.43 | 1,365,174.51 |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 20,912 | 14.66 | 306,569.92 |
| QORVO INC | 6,042 | 89.89 | 543,115.38 |
| QUALCOMM INC | 58,780 | 76.04 | 4,469,631.20 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 8,757 | 96.51 | 845,138.07 |
| TERADYNE INC | 8,542 | 62.00 | 529,604.00 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 48,056 | 113.93 | 5,475,020.08 |
| XILINX INC | 12,876 | 89.74 | 1,155,492.24 |
| 米ドル 小計 | 15,404,627 | | 1,244,237,912.72 (133,879,999,408) |
| カナダドル | | | |
| CAMECO CORP | 16,384 | 14.34 | 234,946.56 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 66,360 | 19.75 | 1,310,610.00 |
| CENOVUS ENERGY INC | 54,018 | 4.28 | 231,197.04 |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|--------|--------------|
| ENBRIDGE INC | 104,629 | 41.17 | 4,307,575.93 |
| HUSKY ENERGY INC | 14,553 | 3.61 | 52,536.33 |
| IMPERIAL OIL LTD | 12,999 | 18.55 | 241,131.45 |
| INTER PIPELINE LTD | 19,394 | 10.45 | 202,667.30 |
| KEYERA CORP | 11,374 | 17.79 | 202,343.46 |
| OVINTIV INC | 13,275 | 6.60 | 87,615.00 |
| PARKLAND FUEL CORP | 7,666 | 28.68 | 219,860.88 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 27,411 | 28.41 | 778,746.51 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 9,038 | 9.08 | 82,065.04 |
| SUNCOR ENERGY INC | 78,642 | 21.95 | 1,726,191.90 |
| TC ENERGY CORP | 47,682 | 64.29 | 3,065,475.78 |
| AGNICO EAGLE MINES LIMITED | 11,905 | 85.85 | 1,022,044.25 |
| BARRICK GOLD CORP | 90,520 | 38.21 | 3,458,769.20 |
| CCL INDUSTRIES INC-CL B | 6,563 | 41.10 | 269,739.30 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 31,672 | 8.55 | 270,795.60 |
| FRANCO-NEVADA CORPORATION | 9,493 | 192.04 | 1,823,035.72 |
| KINROSS GOLD CORP | 63,501 | 9.99 | 634,374.99 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 15,581 | 60.33 | 940,001.73 |
| LUNDIN MINING CORP | 28,209 | 6.78 | 191,257.02 |
| METHANEX CORPORATION | 2,452 | 19.34 | 47,421.68 |
| NUTRIEN LTD | 29,898 | 48.45 | 1,448,558.10 |
| TECK RESOURCES LIMITED-CL B | 24,814 | 10.41 | 258,313.74 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 2,873 | 30.25 | 86,908.25 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 24,560 | 55.80 | 1,370,448.00 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 75,852 | 0.42 | 31,857.84 |
| CAE INC | 12,891 | 19.68 | 253,694.88 |
| WSP GLOBAL INC | 6,141 | 89.56 | 549,987.96 |
| THOMSON REUTERS CORP | 10,175 | 99.96 | 1,017,093.00 |
| AIR CANADA | 5,737 | 18.24 | 104,642.88 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 37,013 | 111.43 | 4,124,358.59 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 7,115 | 323.20 | 2,299,568.00 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 14,364 | 49.55 | 711,736.20 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,066 | 20.84 | 188,935.44 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 14,069 | 66.66 | 937,839.54 |
| STARS GROUP INC/THE | 13,795 | 35.39 | 488,205.05 |
| QUEBECOR INC -CL B | 9,953 | 30.17 | 300,282.01 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 27,232 | 22.89 | 623,340.48 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 3,570 | 95.30 | 340,221.00 |
| DOLLARAMA INC | 14,542 | 43.42 | 631,413.64 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B | 45,924 | 40.30 | 1,850,737.20 |
| EMPIRE CO LTD A | 7,235 | 33.45 | 242,010.75 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 8,539 | 74.50 | 636,155.50 |

| | | | | | |
|-----|---------------------------------|-----------|----------|----------------------------------|--|
| | METRO INC | 13,109 | 60.15 | 788,506.35 | |
| | WESTON (GEORGE) LTD | 4,281 | 102.95 | 440,728.95 | |
| | SAPUTO INC | 13,425 | 34.66 | 465,310.50 | |
| | AURORA CANNABIS INC | 47,116 | 1.03 | 48,529.48 | |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 15,027 | 23.87 | 358,694.49 | |
| | CANOPY GROWTH CORP | 11,251 | 21.88 | 246,171.88 | |
| | CRONOS GROUP INC | 8,026 | 8.76 | 70,307.76 | |
| | BANK OF MONTREAL | 33,057 | 67.52 | 2,232,008.64 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 63,154 | 53.35 | 3,369,265.90 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 23,513 | 79.00 | 1,857,527.00 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 16,993 | 52.43 | 890,942.99 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 73,726 | 83.20 | 6,134,003.20 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 93,129 | 54.87 | 5,109,988.23 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC | 68,634 | 44.87 | 3,079,607.58 | |
| | CI FINANCIAL CORP | 11,041 | 13.67 | 150,930.47 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 6,433 | 27.09 | 174,269.97 | |
| | ONEX CORPORATION | 4,217 | 61.98 | 261,369.66 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,393 | 386.55 | 538,464.15 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 14,200 | 20.99 | 298,058.00 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 4,851 | 41.11 | 199,424.61 | |
| | INTACT FINANCIAL CORPORATION | 7,058 | 132.61 | 935,961.38 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 99,810 | 16.06 | 1,602,948.60 | |
| | POWER CORP OF CANADA | 26,356 | 20.13 | 530,546.28 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 29,068 | 43.75 | 1,271,725.00 | |
| | BLACKBERRY LIMITED | 25,993 | 5.70 | 148,160.10 | |
| | CGI INC-CL A | 13,436 | 86.05 | 1,156,167.80 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE | 1,026 | 1,350.00 | 1,385,100.00 | |
| | OPEN TEXT CORPORATION | 13,665 | 52.00 | 710,580.00 | |
| | SHOPIFY INC-CLASS A | 5,335 | 908.61 | 4,847,434.35 | |
| | BCE INC | 8,379 | 56.48 | 473,245.92 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 18,509 | 58.22 | 1,077,593.98 | |
| | TELUS CORPORATION | 15,222 | 22.60 | 344,017.20 | |
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 26,712 | 18.97 | 506,726.64 | |
| | ALTAGAS LTD | 17,347 | 14.99 | 260,031.53 | |
| | ATCO LTD-CLASS I | 3,030 | 37.40 | 113,322.00 | |
| | CANADIAN UTILITIES LIMITED | 7,344 | 33.59 | 246,684.96 | |
| | EMERA INC | 13,874 | 54.40 | 754,745.60 | |
| | FORTIS INC | 21,905 | 53.27 | 1,166,879.35 | |
| | HYDRO ONE LTD | 15,052 | 25.30 | 380,815.60 | |
| | カナダドル 小計 | 2,044,376 | | 84,523,506.82 (6,446,607,865) | |
| ユーロ | ENI SPA | 133,196 | 8.25 | 1,098,867.00 | |

| | | | |
|-----------------------------|---------|--------|--------------|
| GALP ENERGIA SGPS S.A | 30,462 | 9.41 | 286,769.26 |
| NESTE OYJ | 20,558 | 29.61 | 608,722.38 |
| OMV AG | 7,781 | 27.64 | 215,066.84 |
| REPSOL SA | 74,961 | 7.74 | 580,348.06 |
| TENARIS S.A. | 25,963 | 5.91 | 153,649.03 |
| TOTAL SA | 122,058 | 31.86 | 3,888,767.88 |
| VOPAK | 3,130 | 51.94 | 162,572.20 |
| AIR LIQUIDE SA | 24,422 | 115.30 | 2,815,856.60 |
| AKZO NOBEL | 10,399 | 68.24 | 709,627.76 |
| ARCELORMITTAL | 35,989 | 8.94 | 322,065.56 |
| ARKEMA | 3,250 | 72.84 | 236,730.00 |
| BASF SE | 47,219 | 43.69 | 2,063,234.20 |
| COVESTRO AG | 8,053 | 29.79 | 239,898.87 |
| CRH PLC | 40,916 | 26.06 | 1,066,270.96 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 12,950 | 21.70 | 281,015.00 |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF | 3,370 | 35.78 | 120,578.60 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 6,958 | 38.98 | 271,222.84 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 9,430 | 113.20 | 1,067,476.00 |
| LANXESS | 4,409 | 40.73 | 179,578.57 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 11,441 | 26.96 | 308,449.36 |
| SOLVAY SA | 3,758 | 66.56 | 250,132.48 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 30,234 | 10.20 | 308,386.80 |
| SYMRISE AG | 6,524 | 95.26 | 621,476.24 |
| THYSSENKRUPP AG | 19,367 | 5.43 | 105,201.54 |
| UMICORE | 9,349 | 39.16 | 366,106.84 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 27,288 | 24.00 | 654,912.00 |
| VOESTALPINE AG | 6,338 | 18.40 | 116,619.20 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 14,792 | 20.90 | 309,152.80 |
| AIRBUS SE | 30,303 | 52.34 | 1,586,059.02 |
| ALSTOM RGPT | 9,668 | 38.60 | 373,184.80 |
| ANDRITZ AG | 4,328 | 31.44 | 136,072.32 |
| BOUYGUES SA | 11,049 | 26.98 | 298,102.02 |
| BRENTAG AG | 7,392 | 39.30 | 290,505.60 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 54,775 | 5.77 | 316,161.30 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 25,583 | 22.96 | 587,385.68 |
| DASSAULT AVIATION SA | 172 | 785.00 | 135,020.00 |
| EIFFAGE SA | 3,488 | 70.18 | 244,787.84 |
| FERROVIAL SA | 23,480 | 22.00 | 516,560.00 |
| GEA GROUP AG | 8,178 | 20.63 | 168,712.14 |
| HOCHTIEF AG | 825 | 66.80 | 55,110.00 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 7,632 | 45.16 | 344,661.12 |
| KION GROUP AG | 3,179 | 43.74 | 139,049.46 |

| | | | |
|-------------------------------------|--------|--------|--------------|
| KNORR-BREMSE AG | 2,328 | 79.67 | 185,471.76 |
| KONE OYJ-B | 18,168 | 53.66 | 974,894.88 |
| LEGRAND SA | 13,198 | 58.40 | 770,763.20 |
| LEONARDO SPA | 18,310 | 6.12 | 112,203.68 |
| METSO OYJ | 5,880 | 22.83 | 134,240.40 |
| MTU AERO ENGINES AG | 2,496 | 107.95 | 269,443.20 |
| PRYSMIAN SPA | 11,926 | 16.03 | 191,173.78 |
| SAFRAN SA | 17,246 | 76.18 | 1,313,800.28 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 28,687 | 80.18 | 2,300,123.66 |
| SIEMENS AG-REG | 39,518 | 78.44 | 3,099,791.92 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 11,482 | 13.43 | 154,203.26 |
| THALES SA | 5,403 | 68.18 | 368,376.54 |
| VINCI S.A. | 25,765 | 69.94 | 1,802,004.10 |
| WARTSILA OYJ-B SHARES | 18,903 | 6.28 | 118,748.64 |
| BUREAU VERITAS SA | 17,817 | 18.01 | 320,884.17 |
| RANDSTAD NV | 5,121 | 33.92 | 173,704.32 |
| TELEPERFORMANCE | 2,970 | 189.50 | 562,815.00 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 14,578 | 67.74 | 987,513.72 |
| AENA SME SA | 3,556 | 113.60 | 403,961.60 |
| AEROPORTS DE PARIS (ADP) | 1,346 | 86.25 | 116,092.50 |
| ATLANTIA SPA | 26,501 | 13.88 | 367,966.38 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 16,574 | 7.18 | 119,001.32 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 50,830 | 26.11 | 1,327,171.30 |
| FRAPORT AG | 1,856 | 35.72 | 66,296.32 |
| GETLINK | 22,311 | 11.27 | 251,444.97 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 16,789 | 48.66 | 816,952.74 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD | 2,508 | 39.64 | 99,417.12 |
| CONTINENTAL AG | 5,578 | 69.74 | 389,009.72 |
| DAIMLER AG | 48,163 | 27.56 | 1,327,372.28 |
| FAURECIA | 3,127 | 31.16 | 97,437.32 |
| FERRARI NV | 6,200 | 144.05 | 893,110.00 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 52,499 | 7.35 | 385,867.65 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 8,746 | 82.40 | 720,670.40 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 5,507 | 17.67 | 97,336.22 |
| PIRELLI & C SPA | 17,484 | 3.35 | 58,693.78 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF | 7,765 | 42.20 | 327,683.00 |
| PSA PEUGEOT CITROEN | 28,139 | 12.38 | 348,501.51 |
| RENAULT SA | 8,830 | 16.00 | 141,297.66 |
| VALEO SA | 14,048 | 17.43 | 244,856.64 |
| VOLKSWAGEN AG | 1,984 | 128.00 | 253,952.00 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 9,869 | 117.36 | 1,158,225.84 |
| ADIDAS AG | 9,273 | 205.40 | 1,904,674.20 |

| | | | |
|-------------------------------------|--------|--------|--------------|
| ESSILORLUXOTTICA | 14,466 | 105.00 | 1,518,930.00 |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,676 | 674.40 | 1,130,294.40 |
| KERING | 4,004 | 451.35 | 1,807,205.40 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 14,191 | 340.85 | 4,837,002.35 |
| MONCLER SPA | 10,437 | 32.58 | 340,037.46 |
| PUMA SE | 3,830 | 52.98 | 202,913.40 |
| SEB SA | 1,589 | 114.90 | 182,576.10 |
| ACCOR SA | 10,451 | 24.60 | 257,094.60 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 4,221 | 103.20 | 435,607.20 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW | 70 | 103.20 | 7,224.00 |
| SODEXO | 3,900 | 67.32 | 262,548.00 |
| ALTICE NV -A W/I | 37,625 | 3.45 | 129,806.25 |
| BOLLORE | 39,433 | 2.32 | 91,563.42 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 8,726 | 9.94 | 86,771.34 |
| JC DECAUX SA | 2,828 | 16.31 | 46,124.68 |
| PUBLICIS GROUPE | 10,736 | 26.90 | 288,798.40 |
| SES | 17,687 | 5.95 | 105,237.65 |
| TELENET GROUP HOLDINGS NV | 2,181 | 34.62 | 75,506.22 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT SA | 5,382 | 67.20 | 361,670.40 |
| VIVENDI SA | 44,196 | 19.65 | 868,451.40 |
| DELIVERY HERO SE | 5,334 | 74.26 | 396,102.84 |
| INDITEX | 55,558 | 22.99 | 1,277,278.42 |
| JUST EAT TAKEAWAY | 5,922 | 88.40 | 523,504.80 |
| PROSUS NV | 25,434 | 67.50 | 1,716,795.00 |
| ZALANDO SE | 6,626 | 42.41 | 281,008.66 |
| CARREFOUR SA | 28,378 | 13.32 | 377,994.96 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 1,833 | 35.68 | 65,401.44 |
| COLRUYT NV | 2,870 | 54.70 | 156,989.00 |
| JERONIMO MARTINS SGPS S.A. | 12,377 | 15.74 | 194,875.86 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 59,452 | 22.95 | 1,364,423.40 |
| METRO AG | 8,344 | 7.80 | 65,133.26 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 39,845 | 38.12 | 1,518,891.40 |
| DANONE | 32,081 | 62.50 | 2,005,062.50 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 28,021 | 6.67 | 186,956.11 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 5,512 | 68.25 | 376,194.00 |
| HEINEKEN NV | 13,143 | 75.28 | 989,405.04 |
| KERRY GROUP PLC-A | 8,005 | 103.80 | 830,919.00 |
| PERNOD-RICARD SA | 11,112 | 135.00 | 1,500,120.00 |
| REMY COINTREAU | 1,273 | 99.75 | 126,981.75 |
| BEIERSDORF AG | 5,138 | 94.78 | 486,979.64 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 5,974 | 67.75 | 404,738.50 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 9,043 | 77.44 | 700,289.92 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|--------------|
| L'OREAL | 12,765 | 243.30 | 3,105,724.50 |
| UNILEVER NV | 75,516 | 45.27 | 3,418,609.32 |
| BIOMERIEUX | 1,779 | 118.30 | 210,455.70 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 2,269 | 93.10 | 211,243.90 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA | 11,118 | 69.30 | 770,477.40 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 21,162 | 37.66 | 796,960.92 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 47,048 | 39.75 | 1,870,158.00 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 1,804 | 254.20 | 458,576.80 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 7,177 | 39.59 | 284,173.31 |
| BAYER AG | 51,053 | 59.54 | 3,039,695.62 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 701 | 442.60 | 310,262.60 |
| GALAPAGOS NV | 2,318 | 194.75 | 451,430.50 |
| GRIFOLS S.A. | 15,169 | 31.60 | 479,340.40 |
| IPSEN | 1,498 | 65.20 | 97,669.60 |
| MERCK KGAA | 6,553 | 104.50 | 684,788.50 |
| ORION OYJ | 6,379 | 47.20 | 301,088.80 |
| QIAGEN N.V. | 12,543 | 38.14 | 478,390.02 |
| RECORDATI SPA | 4,578 | 38.30 | 175,337.40 |
| SANOFI | 57,442 | 90.94 | 5,223,775.48 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 1,555 | 211.60 | 329,038.00 |
| UCB SA | 6,623 | 82.36 | 545,470.28 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 18,916 | 6.31 | 119,359.96 |
| AIB GROUP PLC | 36,918 | 0.98 | 36,456.52 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 352,889 | 2.59 | 915,041.17 |
| BANCO DE SABADELL SA | 242,077 | 0.35 | 84,726.95 |
| BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES) | 187,906 | 0.01 | 1,879.06 |
| BANCO SANTANDER SA | 829,065 | 1.90 | 1,578,539.76 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 52,159 | 1.52 | 79,281.68 |
| BANKIA SA | 82,022 | 0.89 | 73,048.79 |
| BANKINTER,S.A. | 36,405 | 3.41 | 124,395.88 |
| BNP PARIBAS | 58,653 | 26.30 | 1,542,573.90 |
| CAIXABANK | 181,981 | 1.53 | 279,977.76 |
| COMMERZBANK AG | 46,644 | 3.07 | 143,570.23 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 58,140 | 6.54 | 380,351.88 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 15,778 | 17.79 | 280,769.51 |
| FINECOBANK SPA | 32,034 | 9.21 | 295,097.20 |
| ING GROEP NV-CVA | 205,237 | 4.60 | 945,116.38 |
| INTESA SANPAOLO | 801,876 | 1.34 | 1,077,560.96 |
| KBC GROUPE SA | 13,541 | 44.50 | 602,574.50 |
| MEDIOBANCA SPA | 26,782 | 5.00 | 133,963.56 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 7,862 | 14.80 | 116,357.60 |
| SOCIETE GENERALE | 41,025 | 13.51 | 554,575.95 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|--------------|
| UNICREDIT SPA | 105,606 | 6.68 | 706,292.92 |
| AMUNDI SA | 3,955 | 57.55 | 227,610.25 |
| DEUTSCHE BANK AG -REG | 99,560 | 5.45 | 542,701.56 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 10,031 | 135.35 | 1,357,695.85 |
| EURAZEO | 1,792 | 41.68 | 74,690.56 |
| EXOR NV | 6,204 | 47.85 | 296,861.40 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 4,071 | 69.40 | 282,527.40 |
| NATIXIS | 45,362 | 1.91 | 86,777.50 |
| WENDEL | 1,082 | 76.00 | 82,232.00 |
| AEGON NV | 91,609 | 2.15 | 197,234.17 |
| AGEAS | 8,765 | 30.92 | 271,013.80 |
| ALLIANZ SE-REG | 21,519 | 155.76 | 3,351,799.44 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 52,574 | 12.37 | 650,340.38 |
| AXA SA | 103,334 | 14.56 | 1,504,543.04 |
| CNP ASSURANCES | 8,978 | 8.24 | 74,023.61 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 3,058 | 134.00 | 409,772.00 |
| MAPFRE SA | 46,367 | 1.57 | 73,213.49 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 7,363 | 199.20 | 1,466,709.60 |
| NN GROUP NV | 15,922 | 23.73 | 377,829.06 |
| POSTE ITALIANE SPA | 26,562 | 7.39 | 196,505.67 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 21,422 | 26.89 | 576,037.58 |
| SCOR SE | 7,099 | 23.48 | 166,684.52 |
| AROUNDTOWN SA | 63,402 | 4.75 | 301,730.11 |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 18,144 | 36.47 | 661,711.68 |
| VONOVIA SE | 26,484 | 44.61 | 1,181,451.24 |
| ADYEN NV | 490 | 867.00 | 424,830.00 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 21,931 | 42.73 | 937,111.63 |
| ATOS SE | 4,547 | 60.90 | 276,912.30 |
| CAPGEMINI SA | 8,059 | 78.00 | 628,602.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 6,666 | 135.85 | 905,576.10 |
| EDENRED | 12,139 | 35.68 | 433,119.52 |
| SAP SE | 50,662 | 106.68 | 5,404,622.16 |
| WIRECARD AG | 5,952 | 131.48 | 782,568.96 |
| WORLDLINE SA | 6,842 | 64.68 | 442,540.56 |
| INGENICO S.A. | 3,603 | 117.50 | 423,352.50 |
| NOKIA OYJ | 295,063 | 3.08 | 910,416.88 |
| CELLNEX TELECOM SA | 13,299 | 49.59 | 659,497.41 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 170,388 | 12.58 | 2,144,332.98 |
| ELISA OYJ | 6,988 | 56.02 | 391,467.76 |
| ILIAD SA | 1,016 | 139.70 | 141,935.20 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 173,603 | 1.97 | 342,431.91 |
| ORANGE S.A. | 100,867 | 11.18 | 1,128,197.39 |

| | | | | |
|-----|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|
| | PROXIMUS SA | 7,349 | 19.32 | 141,982.68 |
| | TELECOM ITALIA SPA | 491,982 | 0.33 | 165,945.52 |
| | TELECOM ITALIA-RNC | 251,378 | 0.33 | 85,217.14 |
| | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 40,394 | 2.53 | 102,237.21 |
| | TELEFONICA S.A. | 241,284 | 3.97 | 958,621.33 |
| | UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 5,269 | 30.26 | 159,439.94 |
| | E.ON SE | 116,681 | 8.68 | 1,013,724.52 |
| | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 122,490 | 3.76 | 461,664.81 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE(EDF) | 28,638 | 6.70 | 191,989.15 |
| | ENAGAS | 10,471 | 20.39 | 213,503.69 |
| | ENDESA S.A. | 18,336 | 19.53 | 358,102.08 |
| | ENEL SPA | 420,373 | 5.90 | 2,480,200.70 |
| | ENGIE | 91,950 | 9.24 | 850,169.70 |
| | FORTUM OYJ | 24,312 | 14.86 | 361,276.32 |
| | IBERDROLA SA | 317,605 | 8.72 | 2,771,421.23 |
| | NATURGY ENERGY GROUP SA | 15,439 | 15.12 | 233,437.68 |
| | RED ELECTRICA CORPORATION SA | 23,632 | 14.89 | 351,998.64 |
| | RWE AG | 29,609 | 25.03 | 741,113.27 |
| | SNAM SPA | 106,707 | 3.86 | 411,995.72 |
| | SUEZ | 18,986 | 9.61 | 182,493.43 |
| | TERNA SPA | 67,555 | 5.58 | 377,497.34 |
| | UNIPER SE | 11,709 | 24.20 | 283,357.80 |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 28,561 | 18.70 | 534,233.50 |
| | VERBUND AG | 2,458 | 38.18 | 93,846.44 |
| | ASML HOLDING NV | 21,914 | 266.70 | 5,844,463.80 |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 63,610 | 15.33 | 975,141.30 |
| | STMICROELECTRONICS NV | 35,518 | 22.63 | 803,772.34 |
| | ユーロ 小計 | 10,154,350 | | 164,190,920.94 (19,101,971,742) |
| 英債券 | BP PLC | 1,045,687 | 3.08 | 3,226,990.08 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 216,119 | 13.79 | 2,980,713.24 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 191,963 | 13.48 | 2,588,429.09 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 51,260 | 13.97 | 716,512.28 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 19,439 | 7.70 | 149,835.81 |
| | BHP GROUP PLC | 110,160 | 12.87 | 1,417,979.52 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 6,626 | 47.59 | 315,331.34 |
| | EVRAZ PLC | 28,275 | 2.46 | 69,641.32 |
| | GLENCORE PLC | 538,015 | 1.39 | 749,347.29 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 10,074 | 19.18 | 193,219.32 |
| | MONDI PLC | 25,128 | 13.20 | 331,689.60 |
| | RIO TINTO PLC | 58,423 | 37.50 | 2,190,862.50 |
| | ASHTREAD GROUP PLC | 23,686 | 18.30 | 433,453.80 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|-------|--------------|
| BAE SYSTEMS PLC | 173,381 | 5.05 | 875,574.05 |
| BUNZL PLC | 17,064 | 17.19 | 293,415.48 |
| DCC PLC | 4,734 | 53.76 | 254,499.84 |
| FERGUSON PLC | 11,206 | 53.80 | 602,882.80 |
| MEGGITT PLC | 36,960 | 2.53 | 93,582.72 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 246,349 | 0.89 | 219,546.22 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 86,917 | 3.10 | 269,616.53 |
| SMITHS GROUP PLC | 24,168 | 11.84 | 286,149.12 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 3,685 | 86.14 | 317,425.90 |
| WEIR GROUP PLC/THE | 16,710 | 8.43 | 140,865.30 |
| EXPERIAN PLC | 44,915 | 22.58 | 1,014,180.70 |
| G4S PLC | 74,291 | 0.85 | 63,191.92 |
| INTERTEK GROUP PLC | 8,184 | 47.26 | 386,775.84 |
| RELX PLC | 100,974 | 17.38 | 1,755,432.99 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 90,552 | 4.41 | 399,515.42 |
| EASYJET PLC | 7,630 | 5.73 | 43,719.90 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 46,694 | 5.17 | 241,781.53 |
| BURBERRY GROUP PLC | 23,066 | 12.91 | 297,782.06 |
| PERSIMMON PLC | 16,916 | 21.93 | 370,967.88 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 147,698 | 1.51 | 223,836.31 |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 7,187 | 43.32 | 311,340.84 |
| CARNIVAL PLC | 8,091 | 8.49 | 68,708.77 |
| COMPASS GROUP PLC | 78,344 | 12.66 | 992,226.76 |
| GVC HOLDINGS PLC | 23,842 | 6.98 | 166,607.89 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 9,999 | 33.62 | 336,166.38 |
| TUI AG-DI | 17,636 | 2.75 | 48,499.00 |
| WHITBREAD PLC | 6,801 | 26.51 | 180,294.51 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 42,053 | 4.50 | 189,238.50 |
| INFORMA PLC | 70,487 | 4.14 | 292,098.12 |
| ITV PLC | 215,062 | 0.68 | 147,102.40 |
| PEARSON PLC | 39,623 | 4.32 | 171,527.96 |
| WPP PLC | 63,987 | 5.45 | 348,729.15 |
| JD SPORTS FASHION PLC | 28,860 | 4.93 | 142,308.66 |
| KINGFISHER PLC | 109,678 | 1.46 | 160,129.88 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 84,084 | 0.90 | 76,365.08 |
| NEXT PLC | 6,860 | 44.82 | 307,465.20 |
| OCADO GROUP PLC | 22,177 | 16.06 | 356,273.50 |
| SAINSBURY (J) PLC | 112,814 | 2.01 | 227,545.83 |
| TESCO PLC | 527,322 | 2.36 | 1,245,007.24 |
| WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC | 146,235 | 1.88 | 275,214.27 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 16,771 | 18.88 | 316,720.33 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 117,926 | 29.55 | 3,484,713.30 |

| | | | | |
|--------|---------------------------------|------------|--------|----------------------------------|
| | COCA-COLA HBC AG-CDI | 8,704 | 19.75 | 171,904.00 |
| | DIAGEO PLC | 120,650 | 26.55 | 3,203,257.50 |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 45,288 | 15.46 | 700,378.92 |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 36,076 | 65.34 | 2,357,205.84 |
| | UNILEVER PLC | 56,404 | 40.92 | 2,308,051.68 |
| | NMC HEALTH PLC | 3,940 | 7.66 | 30,200.10 |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 44,355 | 15.26 | 676,857.30 |
| | ASTRAZENECA PLC | 67,156 | 82.04 | 5,509,478.24 |
| | GLAXOSMITHKLINE PLC | 256,292 | 16.87 | 4,325,183.79 |
| | BARCLAYS PLC | 863,463 | 0.88 | 765,114.56 |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 1,034,027 | 4.02 | 4,158,339.58 |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 3,756,526 | 0.29 | 1,117,003.00 |
| | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 245,244 | 1.04 | 256,525.22 |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 146,561 | 3.76 | 551,509.04 |
| | 3I GROUP PLC | 49,338 | 7.37 | 364,015.76 |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 19,572 | 14.65 | 286,827.66 |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 15,570 | 74.40 | 1,158,408.00 |
| | M&G PLC | 133,064 | 1.25 | 166,330.00 |
| | SCHRODERS PLC | 6,213 | 25.34 | 157,437.42 |
| | ST JAMES'S PLACE PLC | 23,417 | 7.85 | 183,823.45 |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 123,263 | 2.04 | 252,072.83 |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 11,535 | 23.08 | 266,227.80 |
| | AVIVA PLC | 198,601 | 2.30 | 457,576.70 |
| | DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 63,289 | 2.67 | 168,981.63 |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 302,263 | 1.85 | 561,453.52 |
| | PRUDENTIAL PLC | 138,100 | 10.25 | 1,416,215.50 |
| | RSA INSURANCE GROUP PLC | 52,295 | 3.47 | 181,568.24 |
| | AVEVA GROUP PLC | 3,527 | 32.41 | 114,310.07 |
| | MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 15,111 | 3.70 | 55,910.70 |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 55,987 | 6.09 | 341,408.72 |
| | HALMA PLC | 19,839 | 20.79 | 412,452.81 |
| | BT GROUP PLC | 419,350 | 1.15 | 484,139.57 |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,419,322 | 1.09 | 1,551,602.81 |
| | CENTRICA PLC | 254,915 | 0.32 | 82,286.56 |
| | NATIONAL GRID PLC | 175,047 | 9.39 | 1,644,041.42 |
| | SEVERN TRENT PLC | 14,253 | 23.71 | 337,938.63 |
| | SSE PLC | 55,879 | 12.05 | 673,621.34 |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 33,207 | 8.93 | 296,804.16 |
| | 英ポンド 小計 | 15,550,431 | | 71,105,495.34 (9,464,852,484) |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 10,101 | 17.85 | 180,302.85 |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 392 | 633.00 | 248,136.00 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------------|---------|-----------|----------------------------------|--|
| | GIVAUDAN-REG | 484 | 3,262.00 | 1,578,808.00 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD | 26,329 | 36.25 | 954,426.25 | |
| | SIKA AG | 6,470 | 161.00 | 1,041,670.00 | |
| | ABB LTD | 97,696 | 16.81 | 1,642,758.24 | |
| | GEBERIT AG-REG | 1,986 | 403.00 | 800,358.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 941 | 208.00 | 195,728.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2,102 | 216.00 | 454,032.00 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 7,019 | 39.01 | 273,811.19 | |
| | SGS SA | 308 | 2,181.00 | 671,748.00 | |
| | KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG | 3,030 | 140.10 | 424,503.00 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A | 26,223 | 52.24 | 1,369,889.52 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 1,692 | 183.80 | 310,989.60 | |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 2,516 | 35.90 | 90,324.40 | |
| | DUFREY AG-REG | 2,262 | 26.08 | 58,992.96 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 144 | 1,933.00 | 278,352.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG | 49 | 7,810.00 | 382,690.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-REG | 5 | 82,100.00 | 410,500.00 | |
| | NESTLE SA-REGISTERED | 153,361 | 106.56 | 16,342,148.16 | |
| | ALCON INC | 21,063 | 51.34 | 1,081,374.42 | |
| | SONOVA HOLDING AG | 2,643 | 175.50 | 463,846.50 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 460 | 751.40 | 345,644.00 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 3,995 | 424.80 | 1,697,076.00 | |
| | NOVARTIS AG-REG SHS | 110,441 | 85.97 | 9,494,612.77 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 36,084 | 347.45 | 12,537,385.80 | |
| | VIFOR PHARMA AG | 2,638 | 145.75 | 384,488.50 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 132,838 | 7.74 | 1,028,963.14 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 12,877 | 34.01 | 437,946.77 | |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 1,867 | 66.70 | 124,528.90 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 973 | 718.80 | 699,392.40 | |
| | UBS GROUP AG | 201,356 | 9.09 | 1,831,534.17 | |
| | BALOISE HOLDING AG | 2,475 | 140.10 | 346,747.50 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 1,735 | 322.50 | 559,537.50 | |
| | SWISS RE AG | 15,168 | 67.48 | 1,023,536.64 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 7,520 | 287.00 | 2,158,240.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 3,906 | 90.20 | 352,321.20 | |
| | TEMENOS GROUP AG-REG | 3,131 | 118.85 | 372,119.35 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 1,239 | 511.00 | 633,129.00 | |
| | スイスフラン 小計 | 905,519 | | 63,282,592.73 (6,990,195,192) | |
| スウェーデンク ローナ | LUNDIN ENERGY AB | 8,581 | 225.70 | 1,936,731.70 | |
| | BOLIDEN AB | 13,086 | 201.70 | 2,639,446.20 | |
| | ALFA LAVAL AB | 13,939 | 168.50 | 2,348,721.50 | |

| | | | | |
|---------------|------------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|
| | ASSA ABLOY AB-B | 52,119 | 191.00 | 9,954,729.00 |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 34,434 | 345.00 | 11,879,730.00 |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 19,787 | 308.90 | 6,112,204.30 |
| | EPIROC AB-A | 29,626 | 100.70 | 2,983,338.20 |
| | EPIROC AB-B | 25,132 | 99.70 | 2,505,660.40 |
| | SANDVIK AB | 61,070 | 142.45 | 8,699,421.50 |
| | SKANSKA AB-B SHS | 15,711 | 171.90 | 2,700,720.90 |
| | SKF AB-B SHARES | 20,607 | 154.55 | 3,184,811.85 |
| | VOLVO AB-B SHS | 75,703 | 116.20 | 8,796,688.60 |
| | SECURITAS AB-B SHS | 16,123 | 110.80 | 1,786,428.40 |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 13,883 | 127.00 | 1,763,141.00 |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 18,593 | 61.76 | 1,148,303.68 |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 38,437 | 124.75 | 4,795,015.75 |
| | ICA GRUPPEN AB | 5,614 | 456.60 | 2,563,352.40 |
| | SWEDISH MATCH AB | 9,284 | 624.80 | 5,800,643.20 |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 29,351 | 303.80 | 8,916,833.80 |
| | NORDEA BANK ABP | 167,942 | 55.17 | 9,265,360.14 |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A | 88,317 | 68.34 | 6,035,583.78 |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 77,668 | 84.00 | 6,524,112.00 |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 45,921 | 111.38 | 5,114,680.98 |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 10,879 | 194.05 | 2,111,069.95 |
| | INVESTOR AB-B SHS | 23,614 | 476.70 | 11,256,793.80 |
| | KINNEVIK AB-B SHS | 11,257 | 191.75 | 2,158,529.75 |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 3,368 | 395.00 | 1,330,360.00 |
| | ERICSSON LM-B SHS | 161,331 | 81.10 | 13,083,944.10 |
| | HEXAGON AB-B SHS | 13,203 | 438.60 | 5,790,835.80 |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 4,238 | 262.00 | 1,110,356.00 |
| | TELE2 AB-B SHS | 25,537 | 128.50 | 3,281,504.50 |
| | TELIA CO AB | 151,710 | 33.86 | 5,136,900.60 |
| | スウェーデンクローナ 小計 | 1,286,065 | | 162,715,953.78 (1,742,687,864) |
| ノルウェーク ローネ | AKER BP ASA | 5,392 | 155.95 | 840,882.40 |
| | EQUINOR ASA | 50,788 | 133.00 | 6,754,804.00 |
| | NORSK HYDRO ASA | 64,344 | 22.50 | 1,447,740.00 |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 9,005 | 342.90 | 3,087,814.50 |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 5,480 | 196.30 | 1,075,724.00 |
| | MOWI ASA | 22,242 | 170.45 | 3,791,148.90 |
| | ORKLA ASA | 43,456 | 92.86 | 4,035,324.16 |
| | DNB ASA | 44,508 | 109.45 | 4,871,400.60 |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 11,066 | 185.10 | 2,048,316.60 |
| | TELENOR ASA | 37,498 | 152.60 | 5,722,194.80 |
| | | 293,779 | | 33,675,349.96 |

| | | | | |
|----------------------|--------------------------------|---------|------------|----------------------------------|
| | ノルウェークローネ 小計 | | | (341,468,048) |
| デンマーククローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 5,509 | 606.60 | 3,341,759.40 |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 11,512 | 318.10 | 3,661,967.20 |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 9,581 | 561.40 | 5,378,773.40 |
| | ISS A/S | 8,523 | 91.98 | 783,945.54 |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-A | 168 | 6,000.00 | 1,008,000.00 |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 388 | 6,378.00 | 2,474,664.00 |
| | DSV PANALPINA A S | 10,873 | 660.00 | 7,176,180.00 |
| | PANDORA A/S | 4,763 | 228.10 | 1,086,440.30 |
| | CARLSBERG AS-B | 5,585 | 807.40 | 4,509,329.00 |
| | COLOPLAST-B | 6,052 | 1,074.50 | 6,502,874.00 |
| | DEMANT A/S | 4,455 | 160.00 | 712,800.00 |
| | GENMAB A/S | 3,294 | 1,661.00 | 5,471,334.00 |
| | H LUNDBECK A/S | 2,896 | 240.70 | 697,067.20 |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 91,765 | 446.45 | 40,968,484.25 |
| | DANSKE BANK A/S | 32,789 | 71.30 | 2,337,855.70 |
| | TRYG A/S | 5,752 | 177.10 | 1,018,679.20 |
| | ORSTED A/S | 9,592 | 713.40 | 6,842,932.80 |
| | デンマーククローネ 小計 | 213,497 | | 93,973,085.99 (1,465,980,141) |
| オーストラリアドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 13,386 | 22.43 | 300,247.98 |
| | OIL SEARCH LTD | 70,573 | 2.61 | 184,195.53 |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 89,306 | 4.84 | 432,241.04 |
| | SANTOS LTD | 84,526 | 4.34 | 366,842.84 |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 7,659 | 17.36 | 132,960.24 |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 46,112 | 20.36 | 938,840.32 |
| | WORLEY LIMITED | 31,142 | 6.90 | 214,879.80 |
| | ALUMINA LTD | 106,977 | 1.50 | 160,465.50 |
| | BHP GROUP LTD | 152,583 | 30.54 | 4,659,884.82 |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 23,089 | 9.68 | 223,501.52 |
| | BORAL LIMITED | 75,397 | 2.45 | 184,722.65 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LIMITED | 70,101 | 11.45 | 802,656.45 |
| | INCITEC PIVOT LTD | 61,355 | 2.08 | 127,618.40 |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 27,158 | 17.81 | 483,683.98 |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 37,503 | 28.53 | 1,069,960.59 |
| | ORICA LIMITED | 17,981 | 16.68 | 299,923.08 |
| | RIO TINTO LIMITED | 19,336 | 87.27 | 1,687,452.72 |
| | SOUTH32 LTD | 235,718 | 1.84 | 434,899.71 |
| | CIMIC GROUP LTD | 4,062 | 21.84 | 88,714.08 |
| | BRAMBLES LIMITED | 74,644 | 10.79 | 805,408.76 |
| SEEK LIMITED | 18,186 | 15.64 | 284,429.04 | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 120,139 | 4.50 | 540,625.50 | |

| | | | | |
|--------------------------------|------------------------------|--------|----------------------------------|------------|
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 45,831 | 3.39 | 155,367.09 | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 31,541 | 21.66 | 683,178.06 | |
| CROWN RESORTS LTD | 21,863 | 8.35 | 182,556.05 | |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 2,650 | 9.12 | 24,168.00 | |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED | 104,040 | 2.78 | 289,231.20 | |
| REA GROUP LTD | 2,556 | 80.27 | 205,170.12 | |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 33,543 | 2.62 | 87,882.66 | |
| WESFARMERS LIMITED | 59,674 | 36.65 | 2,187,052.10 | |
| COLES GROUP LIMITED | 66,443 | 16.14 | 1,072,390.02 | |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 65,824 | 35.89 | 2,362,423.36 | |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 23,442 | 8.20 | 192,224.40 | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 36,464 | 9.71 | 354,065.44 | |
| COCHLEAR LIMITED | 2,927 | 179.26 | 524,694.02 | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 9,446 | 61.94 | 585,085.24 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 21,081 | 24.48 | 516,062.88 | |
| CSL LIMITED | 23,588 | 313.75 | 7,400,735.00 | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 145,659 | 16.02 | 2,333,457.18 | |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 19,841 | 5.80 | 115,077.80 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 91,374 | 58.88 | 5,380,101.12 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 154,272 | 15.76 | 2,431,326.72 | |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 186,708 | 15.33 | 2,862,233.64 | |
| AMP LIMITED | 223,504 | 1.30 | 290,555.20 | |
| ASX LTD | 9,287 | 81.49 | 756,797.63 | |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 23,022 | 4.05 | 93,239.10 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 16,904 | 95.01 | 1,606,049.04 | |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 5,783 | 46.41 | 268,389.03 | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 117,187 | 5.86 | 686,715.82 | |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 128,724 | 2.61 | 335,969.64 | |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 67,004 | 7.89 | 528,661.56 | |
| SUNCORP GROUP LTD | 63,933 | 8.92 | 570,282.36 | |
| COMPUTERSHARE LIMITED | 27,967 | 10.97 | 306,797.99 | |
| WISETECH GLOBAL LTD | 7,909 | 16.24 | 128,442.16 | |
| TELSTRA CORPORATION LIMITED | 216,943 | 3.05 | 661,676.15 | |
| TPG TELECOM LTD | 17,758 | 7.37 | 130,876.46 | |
| AGL ENERGY LIMITED | 32,492 | 17.10 | 555,613.20 | |
| AUSNET SERVICES | 85,220 | 1.87 | 159,787.50 | |
| オーストラリアドル 小計 | 3,579,337 | | 51,448,489.49 (3,547,887,835) | |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 65,410 | 3.60 | 235,476.00 |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 66,024 | 5.64 | 372,375.36 |
| | A2 MILK CO LTD | 37,422 | 19.70 | 737,213.40 |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 30,600 | 28.00 | 856,800.00 |

| | | | | |
|------|--|-----------|--------|-------------------------------|
| | RYMAN HEALTHCARE LIMITED | 15,962 | 12.30 | 196,332.60 |
| | SPARK NEW ZEALAND LIMITED | 87,897 | 4.44 | 390,262.68 |
| | MERCURY NZ LTD | 30,223 | 4.36 | 131,772.28 |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 61,565 | 4.49 | 276,426.85 |
| | ニュージーランドドル 小計 | 395,103 | | 3,196,659.17 (207,143,514) |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 137,424 | 55.25 | 7,592,676.00 |
| | NWS HOLDINGS LTD | 69,500 | 7.70 | 535,150.00 |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 70,500 | 56.45 | 3,979,725.00 |
| | MTR CORPORATION | 84,500 | 41.25 | 3,485,625.00 |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 27,000 | 11.74 | 316,980.00 |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED | 118,000 | 49.30 | 5,817,400.00 |
| | SANDS CHINA LTD | 116,000 | 30.95 | 3,590,200.00 |
| | SJM HOLDINGS LIMITED | 80,000 | 7.64 | 611,200.00 |
| | WYNN MACAU LTD | 70,800 | 13.32 | 943,056.00 |
| | BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 65,000 | 20.75 | 1,348,750.00 |
| | VITASOY INTL HOLDINGS LTD | 42,000 | 27.30 | 1,146,600.00 |
| | WH GROUP LIMITED | 534,500 | 7.62 | 4,072,890.00 |
| | BANK OF EAST ASIA | 87,220 | 16.08 | 1,402,497.60 |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 187,500 | 23.50 | 4,406,250.00 |
| | HANG SENG BANK LTD | 38,800 | 132.40 | 5,137,120.00 |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED | 62,300 | 245.00 | 15,263,500.00 |
| | AIA GROUP LTD | 616,600 | 69.55 | 42,884,530.00 |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 123,924 | 46.95 | 5,818,231.80 |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 98,000 | 16.34 | 1,601,320.00 |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 83,384 | 31.05 | 2,589,073.20 |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 27,500 | 20.95 | 576,125.00 |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 339,333 | 8.74 | 2,965,770.42 |
| | SINO LAND CO | 202,200 | 10.54 | 2,131,188.00 |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 84,500 | 102.60 | 8,669,700.00 |
| | SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 27,000 | 49.00 | 1,323,000.00 |
| | SWIRE PROPERTIES LIMITED | 53,000 | 21.35 | 1,131,550.00 |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 72,000 | 29.45 | 2,120,400.00 |
| | WHELOCK&COMPANY LTD | 37,000 | 53.30 | 1,972,100.00 |
| | PCCW LIMITED | 177,000 | 4.65 | 823,050.00 |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 30,000 | 45.30 | 1,359,000.00 |
| | CLP HOLDINGS LTD | 85,100 | 81.40 | 6,927,140.00 |
| | HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS | 111,000 | 7.96 | 883,560.00 |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 550,014 | 13.68 | 7,524,191.52 |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 71,500 | 51.35 | 3,671,525.00 |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 12,300 | 75.85 | 932,955.00 |
| | | 4,592,399 | | 155,554,029.54 |

| 香港ドル 小計 | | | | (2,159,089,930) |
|------------------------------|--------------------------------------|------------|--------------|--------------------------------------|
| シンガポールドル | KEPPEL CORP LTD | 69,900 | 5.69 | 397,731.00 |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 43,720 | 1.50 | 65,580.00 |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG | 99,100 | 3.23 | 320,093.00 |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 66,300 | 0.98 | 64,974.00 |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 116,700 | 1.43 | 166,881.00 |
| | SATS LTD | 26,800 | 2.99 | 80,132.00 |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 25,066 | 6.04 | 151,398.64 |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 260,600 | 0.74 | 192,844.00 |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 69,050 | 1.45 | 100,122.50 |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 4,700 | 20.88 | 98,136.00 |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 103,200 | 3.39 | 349,848.00 |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 95,000 | 18.67 | 1,773,650.00 |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 179,100 | 8.65 | 1,549,215.00 |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 63,900 | 19.56 | 1,249,884.00 |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 35,600 | 9.64 | 343,184.00 |
| | CAPITALAND LTD | 136,600 | 2.82 | 385,212.00 |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 25,800 | 7.43 | 191,694.00 |
| | UOL GROUP LIMITED | 21,700 | 6.76 | 146,692.00 |
| | VENTURE CORP LTD | 15,200 | 15.18 | 230,736.00 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 441,915 | 2.70 | 1,193,170.50 | |
| シンガポールドル 小計 | | 1,899,951 | | 9,051,177.64 (684,269,029) |
| イスラエルシュケル | ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 28,711 | 12.55 | 360,323.05 |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 1,389 | 471.00 | 654,219.00 |
| | BANK HAPOLIM BM | 52,321 | 23.00 | 1,203,383.00 |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 70,150 | 19.50 | 1,367,925.00 |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 54,674 | 11.38 | 622,190.12 |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 9,249 | 72.60 | 671,477.40 |
| | AZRIELI GROUP | 2,140 | 205.00 | 438,700.00 |
| | NICE LTD | 3,251 | 575.00 | 1,869,325.00 |
| イスラエルシュケル 小計 | | 221,885 | | 7,187,542.57 (219,507,550) |
| 合 計 | | 56,541,319 | | 186,251,660,602 (186,251,660,602) |

(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 | 69.2% | 71.9% |
| カナダドル | 株式 84銘柄 | 3.3% | 3.5% |
| ユーロ | 株式 238銘柄 | 9.9% | 10.3% |
| 英ポンド | 株式 93銘柄 | 4.9% | 5.1% |

| | | | | |
|------------|----|------|------|------|
| スイスフラン | 株式 | 39銘柄 | 3.6% | 3.8% |
| 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 | 0.8% | 0.8% |
| オーストラリアドル | 株式 | 58銘柄 | 1.8% | 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% |
| イスラエルシェケル | 株式 | 8銘柄 | 0.1% | 0.1% |

(b)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------------------------|--------|---------------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | AGNC INVESTMENT CORPORATION | 25,432 | 308,490.16 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 5,587 | 835,200.63 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 22,771 | 5,570,014.31 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 66,789 | 395,390.88 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 6,853 | 1,085,378.14 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 7,835 | 707,970.60 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 4,902 | 410,248.38 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 13,726 | 2,059,311.78 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 17,347 | 595,002.10 | |
| | | EQUINIX INC | 4,423 | 3,030,197.30 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 8,664 | 523,565.52 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 19,671 | 1,258,747.29 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,332 | 805,044.52 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 6,463 | 574,496.07 | |
| | | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 3,613 | 250,236.38 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 24,237 | 587,262.51 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 37,569 | 417,015.90 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 30,462 | 663,462.36 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 14,204 | 334,220.12 | |
| | | KIMCO REALTY CORPORATION | 21,090 | 181,374.00 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 25,595 | 406,192.65 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 5,780 | 615,165.40 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 8,249 | 242,933.05 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 10,454 | 280,376.28 | | | |
| PROLOGIS INC | 38,188 | 3,400,259.52 | | | |
| PUBLIC STORAGE | 8,249 | 1,544,460.27 | | | |
| REALTY INCOME CORPORATION | 17,798 | 888,476.16 | | | |

| | | | |
|-----------|--|---------|----------------------------------|
| | REGENCY CENTERS CORP | 8,289 | 293,679.27 |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 16,756 | 862,766.44 |
| | SL GREEN REALTY CORP | 3,945 | 176,420.40 |
| | SUN COMMUNITIES INC | 4,598 | 582,750.52 |
| | UDR INC | 16,633 | 603,611.57 |
| | VENTAS INC | 21,118 | 585,179.78 |
| | VEREIT INC | 54,273 | 253,997.64 |
| | VICI PROPERTIES INC | 23,498 | 366,098.84 |
| | VORNADO REALTY TRUST | 8,706 | 328,825.62 |
| | WELLTOWER INC | 20,071 | 884,328.26 |
| | WEYERHAEUSER CO | 37,766 | 740,591.26 |
| | WP CAREY INC | 8,640 | 507,340.80 |
| | 米ドル 小計 | 683,576 | 34,156,082.68 (3,675,194,496) |
| カナダドル | CAN APARTMENT PROP | 3,971 | 182,427.74 |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 6,546 | 89,156.52 |
| | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,144 | 62,152.80 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,441 | 112,656.74 |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 3,585 | 72,488.70 |
| | カナダドル 小計 | 28,687 | 518,882.50 (39,575,168) |
| ユーロ | COVIVIO | 2,388 | 141,847.20 |
| | GECINA SA | 2,189 | 241,884.50 |
| | ICADE | 2,061 | 142,724.25 |
| | KLEPIERRE | 9,305 | 150,322.27 |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 7,176 | 360,235.20 |
| | ユーロ 小計 | 23,119 | 1,037,013.42 (120,646,141) |
| 英ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 44,962 | 171,260.25 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 32,703 | 205,767.27 |
| | SEGRO PLC | 59,061 | 486,308.27 |
| | 英ポンド 小計 | 136,726 | 863,335.79 (114,918,627) |
| オーストラリアドル | APA GROUP | 68,168 | 749,848.00 |
| | DEXUS | 54,256 | 474,197.44 |
| | GOODMAN GROUP | 86,301 | 1,117,597.95 |
| | GPT GROUP | 97,296 | 359,995.20 |
| | LENDLEASE GROUP | 23,184 | 238,563.36 |
| | MIRVAC GROUP | 200,053 | 412,109.18 |
| | SCENTRE GROUP | 275,200 | 553,152.00 |

| | | | |
|----------|---------------------------------------|-----------|----------------------------------|
| | STOCKLAND | 127,393 | 338,865.38 |
| | SYDNEY AIRPORT | 49,760 | 276,168.00 |
| | TRANSURBAN GROUP | 145,680 | 1,812,259.20 |
| | VICINITY CENTRES | 146,656 | 188,452.96 |
| | オーストラリアドル 小計 | 1,273,947 | 6,521,208.67 (449,702,549) |
| 香港ドル | HKT TRUST AND HKT LTD | 197,000 | 2,383,700.00 |
| | LINK REIT | 110,100 | 7,321,650.00 |
| | 香港ドル 小計 | 307,100 | 9,705,350.00 (134,710,258) |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 150,400 | 407,584.00 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 130,400 | 186,472.00 |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 120,700 | 202,776.00 |
| | MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST | 104,900 | 184,624.00 |
| | SUNTEC REIT | 102,700 | 126,321.00 |
| | シンガポールドル 小計 | 609,100 | 1,107,777.00 (83,747,941) |
| | 合計 | | 4,618,495,180 (4,618,495,180) |

(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 | 1.9% | 79.6% |
| 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% | 2.6% |
| 英ポンド | 投資証券 3銘柄 | 0.1% | 2.5% |
| オーストラリアドル | 投資証券 11銘柄 | 0.2% | 9.7% |
| 香港ドル | 投資証券 2銘柄 | 0.1% | 2.9% |
| シンガポールドル | 投資証券 5銘柄 | 0.0% | 1.8% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年 4月27日現在)

資産の部
流動資産

(2020年 4月27日現在)

| | |
|-------------|---------------|
| 預金 | 136,683,620 |
| 金銭信託 | 646,925,215 |
| コール・ローン | 663,214,708 |
| 株式 | 3,662,360,965 |
| 投資信託受益証券 | 411,445,602 |
| 投資証券 | 119,441,221 |
| 派生商品評価勘定 | 101,259,570 |
| 未収入金 | 132,763 |
| 未収配当金 | 4,237,599 |
| 前払金 | 6,878,868 |
| 差入委託証拠金 | 650,095,027 |
| 流動資産合計 | 6,402,675,158 |
| 資産合計 | 6,402,675,158 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 31,112,301 |
| 未払解約金 | 4,770,000 |
| 未払利息 | 1,913 |
| その他未払費用 | 96,472 |
| 流動負債合計 | 35,980,686 |
| 負債合計 | 35,980,686 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 5,713,549,870 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 653,144,602 |
| 元本等合計 | 6,366,694,472 |
| 純資産合計 | 6,366,694,472 |
| 負債純資産合計 | 6,402,675,158 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| | (1) 先物取引 |

| | |
|---------------------------|--|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、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。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | 受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。 |
| 4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | |
|-----------------------|-------------------|----------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 5,713,549,870口 | |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.1143円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 11,143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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク |

| | |
|---------------------------|--|
| | <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27日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（デリバティブ取引に関する注記）

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,172,770,028 | - | 2,165,891,160 | 6,878,868 |
| | MSCIE 2006 | 2,172,770,028 | - | 2,165,891,160 | 6,878,868 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,262,767,762 | - | 2,337,596,220 | 74,828,458 |
| | 米ドル | 2,262,767,762 | - | 2,337,596,220 | 74,828,458 |
| | 売建 | 961,067,762 | - | 958,870,083 | 2,197,679 |
| | 米ドル | 961,000,000 | - | 958,802,971 | 2,197,029 |
| | ブラジルレアル | 58,380 | - | 57,750 | 630 |
| | 香港ドル | 9,382 | - | 9,362 | 20 |
| | 合計 | 5,396,605,552 | - | 5,462,357,463 | 70,147,269 |

(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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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)

| (2020年 4月27日現在) | |
|--------------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 6,421,132,350円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 838,276,061円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,545,858,541円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 2,454,605,033円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 1,776,810,273円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 198,129,473円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 458,657,103円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 338,056,722円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,268,525円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 40,284,077円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 27,674,839円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 125,402,862円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 82,725,406円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 144,452,900円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 36,039,470円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,548,148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> | 14,895,039円 |
| 合計 | 5,713,549,870円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|-----------------------------------|-------|-------|-----------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 6,800 | 0.62 | 4,222.80 | |
| | YPF S.A.-SPONSORED ADR | 1,387 | 3.30 | 4,577.10 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR | 1,867 | 7.30 | 13,629.10 | |
| | SOUTHERN COPPER CORPORATION | 673 | 30.75 | 20,694.75 | |

| | | | | |
|--------|-------------------------------|---------|--------|-------------------------------|
| | 51JOB INC-ADR | 189 | 64.51 | 12,192.39 |
| | BEST INC-ADR | 1,816 | 5.50 | 9,988.00 |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 2,399 | 28.89 | 69,307.11 |
| | NIO INC-ADR | 5,143 | 2.94 | 15,120.42 |
| | HUAZHU GROUP LTD-ADR | 1,038 | 28.91 | 30,008.58 |
| | LUCKIN COFFEE INC - ADR | 659 | 4.39 | 2,893.01 |
| | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 1,117 | 110.15 | 123,037.55 |
| | TAL EDUCATION GROUP-ADR | 3,019 | 47.39 | 143,070.41 |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 2,766 | 43.95 | 121,565.70 |
| | 58.COM INC-ADR | 787 | 51.38 | 40,436.06 |
| | AUTOHOME INC-ADR | 493 | 73.88 | 36,422.84 |
| | BAIDU INC - SPON ADR | 2,151 | 100.95 | 217,143.45 |
| | HUYA INC-ADR | 492 | 16.21 | 7,975.32 |
| | IQIYI INC-ADR | 1,087 | 17.76 | 19,305.12 |
| | JOYY INC | 421 | 59.33 | 24,977.93 |
| | MOMO INC-SPON ADR | 1,091 | 23.12 | 25,223.92 |
| | NETEASE.COM INC -ADR | 557 | 348.95 | 194,365.15 |
| | SINA CORP | 556 | 33.48 | 18,614.88 |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 840 | 10.75 | 9,030.00 |
| | WEIBO CORP-SPON ADR | 488 | 36.49 | 17,807.12 |
| | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 13,616 | 204.36 | 2,782,565.76 |
| | BAOZUN INC-SPN-ADR | 263 | 30.18 | 7,937.34 |
| | JD.COM INC-ADR | 5,781 | 45.05 | 260,434.05 |
| | PINDUODUO INC-ADR | 1,513 | 49.57 | 74,999.41 |
| | TRIP.COM GROUP-ADR | 3,689 | 23.78 | 87,724.42 |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 3,446 | 16.09 | 55,446.14 |
| | HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR | 475 | 20.95 | 9,951.25 |
| | ZAI LAB LTD-ADR | 293 | 63.45 | 18,590.85 |
| | BANCO MACRO SA-ADR | 320 | 14.51 | 4,643.20 |
| | CREDICORP LTD | 519 | 134.21 | 69,654.99 |
| | GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR | 709 | 6.10 | 4,324.90 |
| | NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS | 231 | 25.62 | 5,918.22 |
| | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 7,080 | 0.80 | 5,678.16 |
| | GDS HOLDINGS LTD-ADR | 445 | 59.40 | 26,433.00 |
| | GLOBANT SA | 258 | 105.87 | 27,314.46 |
| | TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR | 892 | 6.70 | 5,976.40 |
| | 米ドル 小計 | 77,366 | | 4,629,201.26 (498,102,055) |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-CPO | 115,600 | 4.63 | 535,228.00 |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV | 28,400 | 47.22 | 1,341,048.00 |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 1,195 | 178.04 | 212,757.80 |
| | ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV | 8,600 | 25.99 | 223,514.00 |

| | | | | |
|---------|--|---------|--------|-------------------------------|
| | ALFA S.A.B. -A | 22,000 | 8.62 | 189,640.00 |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 3,600 | 47.13 | 169,668.00 |
| | GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B | 1,485 | 235.71 | 350,029.35 |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 3,000 | 135.65 | 406,950.00 |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 1,750 | 154.93 | 271,127.50 |
| | ALSEA SAB DE CV | 3,800 | 21.48 | 81,624.00 |
| | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | 17,400 | 25.08 | 436,392.00 |
| | MEGACABLE HOLDINGS-CPO | 1,584 | 59.59 | 94,390.56 |
| | EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1 | 1,600 | 58.71 | 93,936.00 |
| | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 41,800 | 57.04 | 2,384,272.00 |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 2,900 | 90.32 | 261,928.00 |
| | COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V | 4,500 | 97.44 | 438,480.00 |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 15,500 | 141.73 | 2,196,815.00 |
| | GRUMA S.A.B. -B | 1,505 | 229.78 | 345,818.90 |
| | GRUPO BIMBO SAB-SERIES A | 10,700 | 32.63 | 349,141.00 |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 12,100 | 34.40 | 416,240.00 |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V. | 20,700 | 61.12 | 1,265,184.00 |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-0 | 20,200 | 15.03 | 303,606.00 |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C.V. | 266,500 | 13.61 | 3,627,065.00 |
| | INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA | 4,300 | 70.35 | 302,505.00 |
| | メキシコペソ 小計 | 610,719 | | 16,297,360.11 (70,241,622) |
| ブラジルリアル | COSAN SA | 1,300 | 56.14 | 72,982.00 |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS | 29,500 | 16.07 | 474,065.00 |
| | PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR | 33,300 | 15.95 | 531,135.00 |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 6,100 | 13.49 | 82,289.00 |
| | BRASKEM SA-PREF A | 1,800 | 18.93 | 34,074.00 |
| | COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN | 5,300 | 7.08 | 37,524.00 |
| | GERDAU S.A.-PREF | 8,700 | 10.93 | 95,091.00 |
| | SUZANO SA | 4,515 | 39.13 | 176,671.95 |
| | VALE SA | 25,000 | 43.76 | 1,094,000.00 |
| | EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A. | 5,000 | 8.28 | 41,400.00 |
| | WEG SA | 6,730 | 38.71 | 260,518.30 |
| | COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS | 10,100 | 12.04 | 121,604.00 |
| | LOCALIZA RENT A CAR SA | 4,900 | 32.98 | 161,602.00 |
| | RUMO SA | 9,000 | 20.55 | 184,950.00 |
| | COGNA EDUCACAO | 14,100 | 4.61 | 65,001.00 |
| | B2W CIA DIGITAL | 1,561 | 68.68 | 107,209.48 |
| | LOJAS AMERICANAS SA | 5,900 | 22.50 | 132,750.00 |
| | LOJAS RENNER S.A. | 5,980 | 37.67 | 225,266.60 |
| | MAGAZINE LUIZA SA | 5,900 | 47.38 | 279,542.00 |
| | PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 5,800 | 16.94 | 98,252.00 |

| | | | | | |
|------|--|---------|-----------|-------------------------------|--|
| | ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO | 3,100 | 19.99 | 61,969.00 | |
| | CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO | 1,300 | 67.30 | 87,490.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 1,800 | 104.54 | 188,172.00 | |
| | AMBEV SA | 37,000 | 11.11 | 411,070.00 | |
| | BRF-BRASIL FOODS SA | 4,500 | 18.55 | 83,475.00 | |
| | JBS SA | 8,300 | 21.54 | 178,782.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 5,100 | 33.23 | 169,473.00 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 1,800 | 50.00 | 90,000.00 | |
| | NOTRE DAME INTERMED PAR SA | 3,900 | 52.04 | 202,956.00 | |
| | HYPERMARCAS SA | 2,700 | 30.01 | 81,027.00 | |
| | BANCO BRADESCO S.A.-PREF | 34,742 | 17.84 | 619,797.28 | |
| | BANCO BRADESCO SA | 9,908 | 15.93 | 157,834.44 | |
| | BANCO DO BRASIL S.A. | 6,400 | 24.30 | 155,520.00 | |
| | ITAU UNIVANCO HOLDING SA | 38,000 | 20.88 | 793,440.00 | |
| | ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR | 34,580 | 8.40 | 290,472.00 | |
| | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 1,700 | 37.50 | 63,750.00 | |
| | BM&F BOVESPA SA | 16,100 | 37.00 | 595,700.00 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 5,100 | 24.40 | 124,440.00 | |
| | IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 5,100 | 9.07 | 46,257.00 | |
| | PORTO SEGURO SA | 600 | 43.84 | 26,304.00 | |
| | BR MALLS PARTICIPACOES SA | 6,300 | 9.30 | 58,590.00 | |
| | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS | 2,400 | 20.58 | 49,392.00 | |
| | CIELO SA | 9,300 | 4.08 | 37,944.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL SA | 3,400 | 45.51 | 154,734.00 | |
| | TIM PARTICIPACOES SA | 7,200 | 12.20 | 87,840.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR | 2,200 | 21.78 | 47,916.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B | 1,600 | 24.93 | 39,888.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 7,500 | 8.75 | 65,625.00 | |
| | COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO | 2,600 | 37.77 | 98,202.00 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 1,100 | 42.47 | 46,717.00 | |
| | ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 1,350 | 38.23 | 51,610.50 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 6,500 | 17.94 | 116,610.00 | |
| | ブラジルリアル 小計 | 463,666 | | 9,558,924.55 (184,009,297) | |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 3,327 | 5,024.00 | 16,714,848.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 8,980 | 1,705.00 | 15,310,900.00 | |
| | SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 921 | 18,200.00 | 16,762,200.00 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP | 1,840 | 2,965.10 | 5,455,784.00 | |
| | FALABELLA SA | 5,234 | 2,075.00 | 10,860,550.00 | |
| | CENCOSUD SA | 12,537 | 954.00 | 11,960,298.00 | |
| | CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 883 | 5,750.00 | 5,077,250.00 | |
| | EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B | 1,886 | 1,715.10 | 3,234,678.60 | |

| | | | | | |
|---------|--|-----------|-----------|--------------------------------|--|
| | BANCO DE CHILE | 380,926 | 67.70 | 25,788,690.20 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 353 | 27,500.00 | 9,707,500.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 567,731 | 30.99 | 17,593,983.69 | |
| | ITAU CORPBANCA | 1,230,978 | 2.20 | 2,708,151.60 | |
| | EMPRESA NACIONAL DE TELECOM | 1,200 | 4,360.10 | 5,232,120.00 | |
| | AGUAS ANDINAS SA-A | 20,335 | 250.00 | 5,083,750.00 | |
| | COLBUN SA | 61,705 | 113.00 | 6,972,665.00 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 286,610 | 134.20 | 38,463,062.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 227,542 | 61.10 | 13,902,816.20 | |
| | チリペソ 小計 | 2,812,988 | | 210,829,247.29 (26,416,904) | |
| コロンビアペソ | ECOPETRO SA | 41,073 | 1,910.00 | 78,449,430.00 | |
| | GRUPO ARGOS SA | 2,250 | 9,110.00 | 20,497,500.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA | 1,718 | 23,040.00 | 39,582,720.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 3,564 | 24,200.00 | 86,248,800.00 | |
| | GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF | 28,377 | 820.00 | 23,269,140.00 | |
| | GRUPO DE INV SURAMERICANA | 1,916 | 21,360.00 | 40,925,760.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 3,245 | 18,300.00 | 59,383,500.00 | |
| | コロンビアペソ 小計 | 82,143 | | 348,356,850.00 (9,266,292) | |
| ユーロ | MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA | 599 | 12.98 | 7,775.02 | |
| | TITAN CEMENT INTERNATIONAL T | 334 | 11.74 | 3,921.16 | |
| | FOLLI FOLLIE GROUP | 123 | 4.22 | 519.06 | |
| | OPAP SA | 1,325 | 7.94 | 10,527.12 | |
| | JUMBO S.A. | 802 | 13.60 | 10,907.20 | |
| | ALPHA BANK AE | 11,891 | 0.60 | 7,201.18 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SEEVICS & HOLDINGS SA | 19,175 | 0.33 | 6,477.31 | |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 4,254 | 1.14 | 4,862.32 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 1,878 | 11.38 | 21,371.64 | |
| | ユーロ 小計 | 40,381 | | 73,562.01 (8,558,204) | |
| トルコリラ | TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 1,004 | 85.60 | 85,942.40 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 12,606 | 7.96 | 100,343.76 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 2,111 | 26.68 | 56,321.48 | |
| | KOC HOLDING AS | 6,107 | 14.66 | 89,528.62 | |
| | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 1,755 | 18.07 | 31,712.85 | |
| | TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI | 4,473 | 10.27 | 45,937.71 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 734 | 58.70 | 43,085.80 | |
| | ARCELIK AS | 866 | 15.26 | 13,215.16 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 2,989 | 56.00 | 167,384.00 | |
| | ANADOLU EFES BIRACILIK VE | 2,205 | 18.05 | 39,800.25 | |
| | AKBANK T.A.S. | 20,175 | 5.74 | 115,804.50 | |

| | | | | | |
|----------------|---|---------|----------|---------------|--------------|
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 16,240 | 8.12 | 131,868.80 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 9,681 | 4.84 | 46,856.04 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 7,157 | 7.81 | 55,896.17 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 8,901 | 13.61 | 121,142.61 | |
| | トルコリラ 小計 | 97,004 | | 1,144,840.15 | (17,676,331) |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 547 | 518.00 | 283,346.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 3,975 | 51.90 | 206,302.50 | |
| | CEZ AS | 1,346 | 460.50 | 619,833.00 | |
| | チェココルナ 小計 | 5,868 | | 1,109,481.50 | (4,748,580) |
| ハンガリーフォ リント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT | 3,501 | 2,010.00 | 7,037,010.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 1,084 | 6,560.00 | 7,111,040.00 | |
| | OTP BANK PLC | 1,711 | 8,400.00 | 14,372,400.00 | |
| | ハンガリーフォリント 小計 | 6,296 | | 28,520,450.00 | (9,314,778) |
| ポーランドズロ チ | GRUPA LOTOS SA | 546 | 62.14 | 33,928.44 | |
| | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 2,258 | 60.84 | 137,376.72 | |
| | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 14,344 | 3.65 | 52,355.60 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 1,106 | 72.80 | 80,516.80 | |
| | CCC SA | 282 | 43.80 | 12,351.60 | |
| | LPP SA | 9 | 5,920.00 | 53,280.00 | |
| | AMREST HOLDINGS SE | 739 | 25.05 | 18,511.95 | |
| | CD PROJEKT SA | 557 | 363.40 | 202,413.80 | |
| | CYFROWY POLSAT SA | 2,338 | 25.16 | 58,824.08 | |
| | DINO POLSKA SA | 366 | 175.00 | 64,050.00 | |
| | BANK MILLENNIUM SA | 4,887 | 2.72 | 13,302.41 | |
| | BANK PEKAO SA | 1,434 | 49.31 | 70,710.54 | |
| | MBANK SA | 79 | 212.00 | 16,748.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 7,143 | 20.82 | 148,717.26 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 253 | 145.30 | 36,760.90 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 4,783 | 29.91 | 143,059.53 | |
| | ORANGE POLSKA SA | 4,301 | 6.90 | 29,676.90 | |
| | PGE SA | 7,070 | 4.05 | 28,654.71 | |
| | ポーランドズロチ 小計 | 52,495 | | 1,201,239.24 | (30,811,786) |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY COMPANY - H | 11,000 | 2.04 | 22,440.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 14,000 | 5.71 | 79,940.00 | |
| | CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H | 204,000 | 3.74 | 762,960.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H | 25,500 | 13.64 | 347,820.00 | |
| | CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H | 8,000 | 5.07 | 40,560.00 | |
| | CNOOC LTD | 142,000 | 8.51 | 1,208,420.00 | |

| | | | |
|--|---------|-------|------------|
| PETROCHINA CO LTD | 158,000 | 2.69 | 425,020.00 |
| YANZHOU COAL MINING CO-H | 10,000 | 5.83 | 58,300.00 |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 40,000 | 1.52 | 60,800.00 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 9,500 | 58.20 | 552,900.00 |
| BBMG CORPORATION - H | 9,000 | 1.92 | 17,280.00 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 11,500 | 3.44 | 39,560.00 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 36,000 | 2.17 | 78,120.00 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD | 28,000 | 9.22 | 258,160.00 |
| CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED | 18,000 | 10.12 | 182,160.00 |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 8,800 | 1.69 | 14,872.00 |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | 7,000 | 7.26 | 50,820.00 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED | 13,000 | 4.73 | 61,490.00 |
| MAANSHAN IRON&STEEL-H | 6,000 | 2.23 | 13,380.00 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 14,000 | 7.10 | 99,400.00 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L | 18,000 | 2.15 | 38,700.00 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H | 10,000 | 9.34 | 93,400.00 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 42,000 | 3.48 | 146,160.00 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH CO | 13,000 | 3.03 | 39,390.00 |
| BOC AVIATION LTD | 1,900 | 52.10 | 98,990.00 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 31,000 | 5.05 | 156,550.00 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 20,000 | 5.43 | 108,600.00 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED | 12,500 | 35.95 | 449,375.00 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | 10,000 | 10.70 | 107,000.00 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 28,000 | 4.54 | 127,120.00 |
| CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H | 14,500 | 8.39 | 121,655.00 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD | 18,000 | 5.85 | 105,300.00 |
| CITIC LIMITED | 44,000 | 7.40 | 325,600.00 |
| CRRG CORP LTD-H | 31,000 | 4.00 | 124,000.00 |
| FOSUN INTERNATIONAL | 18,000 | 9.57 | 172,260.00 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 4,000 | 13.70 | 54,800.00 |
| METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H | 11,000 | 1.32 | 14,520.00 |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED | 26,000 | 2.30 | 59,800.00 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD | 5,000 | 12.36 | 61,800.00 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 7,500 | 3.47 | 26,025.00 |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 6,500 | 15.52 | 100,880.00 |
| WEICHAO POWER CO | 14,000 | 13.48 | 188,720.00 |
| XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H | 6,618 | 7.15 | 47,318.70 |
| ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD | 4,000 | 24.10 | 96,400.00 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H | 13,000 | 6.04 | 78,520.00 |
| A-LIVING SERVICES CO LTD-H | 3,500 | 38.25 | 133,875.00 |
| CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED | 26,000 | 4.38 | 113,880.00 |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS | 10,000 | 35.55 | 355,500.00 |

| | | | |
|---|---------|--------|---------------|
| GREENTOWN SERVICE GROUP | 10,000 | 9.39 | 93,900.00 |
| AIR CHINA/HONG KONG | 16,000 | 5.45 | 87,200.00 |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H | 10,000 | 5.14 | 51,400.00 |
| CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H | 22,000 | 2.06 | 45,320.00 |
| CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR | 18,000 | 3.10 | 55,800.00 |
| CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD | 10,140 | 9.02 | 91,462.80 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 8,000 | 3.71 | 29,680.00 |
| COSCO SHIPPING PORTS LIMITED | 10,000 | 3.75 | 37,500.00 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 10,000 | 8.77 | 87,700.00 |
| SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H | 6,000 | 8.03 | 48,180.00 |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD | 8,000 | 14.20 | 113,600.00 |
| SINOTRANS LIMITED | 8,000 | 1.76 | 14,080.00 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 12,000 | 5.12 | 61,440.00 |
| BAIC MOTOR CORP LTD-H | 15,500 | 3.23 | 50,065.00 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 22,000 | 6.79 | 149,380.00 |
| BYD CO LTD-H | 5,500 | 43.40 | 238,700.00 |
| DONGFENG MOTOR CORPORATION | 20,000 | 4.91 | 98,200.00 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 4,800 | 16.48 | 79,104.00 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED | 41,000 | 11.42 | 468,220.00 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED | 25,000 | 4.91 | 122,750.00 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H | 21,200 | 6.50 | 137,800.00 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED | 5,000 | 3.80 | 19,000.00 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED | 9,000 | 64.00 | 576,000.00 |
| BOSIDENG INTL HOLDGS LTD | 26,000 | 2.10 | 54,600.00 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 9,000 | 20.80 | 187,200.00 |
| LI NING COMPANY LIMITED | 16,500 | 23.40 | 386,100.00 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 6,100 | 87.05 | 531,005.00 |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDING | 4,000 | 12.96 | 51,840.00 |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED | 3,000 | 11.88 | 35,640.00 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | 3,000 | 32.55 | 97,650.00 |
| ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED | 110,000 | 0.93 | 102,300.00 |
| CHINA LITERATURE LTD | 1,400 | 30.15 | 42,210.00 |
| TENCENT HOLDINGS LIMITED | 45,000 | 406.40 | 18,288,000.00 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 99,000 | 0.90 | 89,100.00 |
| MEITUAN DIANPING-CLASS B | 8,100 | 99.20 | 803,520.00 |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 11,000 | 9.55 | 105,050.00 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 4,500 | 29.80 | 134,100.00 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 17,500 | 12.64 | 221,200.00 |
| CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED | 21,000 | 27.45 | 576,450.00 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD | 12,000 | 35.25 | 423,000.00 |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 19,500 | 4.74 | 92,430.00 |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 14,000 | 13.88 | 194,320.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|--------------|
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 4,000 | 44.10 | 176,400.00 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 8,000 | 7.69 | 61,520.00 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED | 42,000 | 5.63 | 236,460.00 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 4,000 | 60.80 | 243,200.00 |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD | 5,500 | 66.95 | 368,225.00 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI | 30,000 | 18.34 | 550,200.00 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 2,600 | 111.20 | 289,120.00 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 16,000 | 12.06 | 192,960.00 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 7,700 | 13.90 | 107,030.00 |
| SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H | 11,200 | 19.28 | 215,936.00 |
| 3SBIO INC | 10,500 | 8.11 | 85,155.00 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED | 10,000 | 9.25 | 92,500.00 |
| CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 38,000 | 15.56 | 591,280.00 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL | 12,000 | 4.81 | 57,720.00 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS | 22,000 | 3.37 | 74,140.00 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 6,000 | 12.90 | 77,400.00 |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 4,000 | 30.05 | 120,200.00 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 8,000 | 37.05 | 296,400.00 |
| LUYE PHARMA GROUP | 9,500 | 3.83 | 36,385.00 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H | 5,000 | 29.45 | 147,250.00 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 56,000 | 11.22 | 628,320.00 |
| SSY GROUP LIMITED | 10,000 | 5.81 | 58,100.00 |
| WUXI APPTTEC CO LTD | 1,340 | 106.60 | 142,844.00 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 6,000 | 115.40 | 692,400.00 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 229,000 | 3.10 | 709,900.00 |
| BANK OF CHINA LTD | 628,000 | 2.86 | 1,796,080.00 |
| BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H | 67,000 | 4.69 | 314,230.00 |
| CHINA CITIC BANK | 68,000 | 3.58 | 243,440.00 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 756,000 | 6.01 | 4,543,560.00 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 21,000 | 2.97 | 62,370.00 |
| CHINA MERCHANTS BANK- H | 30,500 | 34.45 | 1,050,725.00 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 51,100 | 5.50 | 281,050.00 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H | 13,000 | 3.11 | 40,430.00 |
| INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA | 513,000 | 5.06 | 2,595,780.00 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H | 59,000 | 4.43 | 261,370.00 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H | 64,000 | 1.40 | 89,600.00 |
| CHINA EVERBRIGHT LIMITED | 8,000 | 10.96 | 87,680.00 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO | 25,500 | 3.69 | 94,095.00 |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT | 92,000 | 0.82 | 75,440.00 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H | 10,400 | 10.90 | 113,360.00 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 16,000 | 14.10 | 225,600.00 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 18,000 | 6.09 | 109,620.00 |

| | | | |
|--|--------|-------|--------------|
| GF SECURITIES CO LTD-H | 10,600 | 7.98 | 84,588.00 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H | 5,000 | 10.72 | 53,600.00 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 22,800 | 6.87 | 156,636.00 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 14,000 | 12.50 | 175,000.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO. | 58,000 | 15.84 | 918,720.00 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 21,400 | 24.00 | 513,600.00 |
| CHINA REINSURANCE GROUP CO-H | 30,000 | 0.88 | 26,400.00 |
| CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD | 12,600 | 12.16 | 153,216.00 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED | 7,100 | 24.65 | 175,015.00 |
| PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD | 65,000 | 2.45 | 159,250.00 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY - H | 52,000 | 7.16 | 372,320.00 |
| PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT | 44,000 | 77.30 | 3,401,200.00 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 2,800 | 24.65 | 69,020.00 |
| AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED | 12,000 | 8.14 | 97,680.00 |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | 9,000 | 8.75 | 78,750.00 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 15,000 | 12.90 | 193,500.00 |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED | 44,000 | 5.18 | 227,920.00 |
| CHINA OVERSEAS LAND&INVEST | 30,000 | 26.10 | 783,000.00 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 26,000 | 30.85 | 802,100.00 |
| CHINA VANKE CO LTD -H | 12,300 | 24.15 | 297,045.00 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 22,000 | 5.56 | 122,320.00 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY | 62,000 | 9.57 | 593,340.00 |
| GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H | 11,600 | 9.30 | 107,880.00 |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 21,000 | 2.85 | 59,850.00 |
| KWG GROUP HOLDINGS LIMITED | 8,000 | 10.96 | 87,680.00 |
| LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD | 10,000 | 11.82 | 118,200.00 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 13,500 | 37.95 | 512,325.00 |
| SEAZEN GROUP LTD | 20,000 | 6.79 | 135,800.00 |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 16,000 | 2.29 | 36,640.00 |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED | 9,500 | 29.95 | 284,525.00 |
| SHUI ON LAND LIMITED | 13,500 | 1.30 | 17,550.00 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD. | 19,000 | 1.89 | 35,910.00 |
| SOHO CHINA LTD | 7,500 | 3.52 | 26,400.00 |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 20,000 | 32.40 | 648,000.00 |
| WHARF HOLDINGS LTD | 9,000 | 13.80 | 124,200.00 |
| YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD | 44,000 | 1.42 | 62,480.00 |
| YUZHOU PROPERTIES COMPANY | 17,000 | 3.17 | 53,890.00 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 14,000 | 4.86 | 68,040.00 |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP | 17,000 | 11.60 | 197,200.00 |
| KINGSOFT CORPORATION LTD. | 6,000 | 26.15 | 156,900.00 |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 8,000 | 13.24 | 105,920.00 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 5,500 | 37.45 | 205,975.00 |

| | | | | | |
|----------------|---|-----------|--------|----------------------------------|--|
| | BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 5,500 | 16.82 | 92,510.00 | |
| | CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H | 10,000 | 3.67 | 36,700.00 | |
| | KINGBOARD HOLDINGS LIMITED | 4,500 | 18.68 | 84,060.00 | |
| | KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD | 7,000 | 7.23 | 50,610.00 | |
| | LEGEND HOLDINGS CORP-H | 2,000 | 8.79 | 17,580.00 | |
| | LENOVO GROUP LTD | 52,000 | 4.10 | 213,200.00 | |
| | SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 5,400 | 106.50 | 575,100.00 | |
| | XIAOMI CORP-CLASS B | 81,400 | 10.00 | 814,000.00 | |
| | ZTE CORPORATION | 6,200 | 22.00 | 136,400.00 | |
| | CHINA MOBILE LTD | 48,500 | 61.05 | 2,960,925.00 | |
| | CHINA TELECOM CORP LTD | 106,000 | 2.62 | 277,720.00 | |
| | CHINA TOWER CORP LTD-H | 338,000 | 1.71 | 577,980.00 | |
| | CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 46,000 | 4.97 | 228,620.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED | 3,500 | 26.40 | 92,400.00 | |
| | BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED | 36,000 | 2.94 | 105,840.00 | |
| | CGN POWER CO LTD-H | 93,000 | 1.94 | 180,420.00 | |
| | CHINA GAS HOLDINGS LIMITED | 13,800 | 25.70 | 354,660.00 | |
| | CHINA LONGYUAN POWER GROUP | 27,000 | 3.58 | 96,660.00 | |
| | CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT | 37,000 | 1.52 | 56,240.00 | |
| | CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 8,000 | 43.05 | 344,400.00 | |
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD | 16,000 | 8.95 | 143,200.00 | |
| | DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD | 12,000 | 1.03 | 12,360.00 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 6,400 | 83.30 | 533,120.00 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT | 22,000 | 15.70 | 345,400.00 | |
| | HUADIAN POWER INTL CORP-H | 12,000 | 2.37 | 28,440.00 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 22,000 | 2.76 | 60,720.00 | |
| | KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 24,000 | 4.63 | 111,120.00 | |
| | TOWNGAS CHINA CO LTD | 4,000 | 3.60 | 14,400.00 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED | 3,000 | 14.04 | 42,120.00 | |
| | SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL | 22,500 | 14.04 | 315,900.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 28,000 | 4.53 | 126,840.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 6,939,298 | | 72,857,442.50 (1,011,261,301) | |
| マレーシアリン ギット | DIALOG GROUP BHD | 29,200 | 3.22 | 94,024.00 | |
| | PETRONAS DAGANGAN BHD | 1,900 | 20.30 | 38,570.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 20,300 | 5.27 | 106,981.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS | 13,100 | 3.75 | 49,125.00 | |
| | GAMUDA BHD | 13,300 | 3.20 | 42,560.00 | |
| | HAP SENG CONSOLIDATED | 3,900 | 7.18 | 28,002.00 | |
| | IJM CORP BHD | 18,500 | 1.65 | 30,525.00 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 23,500 | 2.00 | 47,000.00 | |
| | AIRASIA GROUP BERHAD | 5,500 | 0.77 | 4,262.50 | |

| | | | | | |
|-------|---------------------------------------|---------|--------|------------------------------|--|
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 8,300 | 5.10 | 42,330.00 | |
| | MISC BHD | 11,800 | 7.80 | 92,040.00 | |
| | WESTPORTS HOLDINGS BHD | 3,700 | 3.78 | 13,986.00 | |
| | GENTING BHD | 15,200 | 3.95 | 60,040.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 26,600 | 2.21 | 58,786.00 | |
| | CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B | 1,200 | 27.92 | 33,504.00 | |
| | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 1,200 | 31.26 | 37,512.00 | |
| | GENTING PLANTATIONS BERHAD | 2,500 | 9.15 | 22,875.00 | |
| | IOI CORPORATION BERHAD | 14,000 | 3.83 | 53,620.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD | 3,500 | 20.30 | 71,050.00 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 600 | 138.40 | 83,040.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 4,140 | 16.12 | 66,736.80 | |
| | QL RESOURCES BHD | 5,300 | 8.00 | 42,400.00 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 15,000 | 4.71 | 70,650.00 | |
| | HARTALEGA HOLDINGS BHD | 12,600 | 7.60 | 95,760.00 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 15,600 | 5.11 | 79,716.00 | |
| | TOP GLOVE CORPORATION BHD | 13,800 | 7.17 | 98,946.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BERHAD | 10,100 | 2.96 | 29,896.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 40,900 | 3.50 | 143,150.00 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 4,700 | 13.24 | 62,228.00 | |
| | HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 1,900 | 12.80 | 24,320.00 | |
| | MALAYAN BANKING BERHAD | 29,600 | 7.36 | 217,856.00 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 24,900 | 15.82 | 393,918.00 | |
| | RHB BANK BHD | 11,800 | 4.70 | 55,460.00 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 21,900 | 3.69 | 80,811.00 | |
| | DIGI.COM BHD | 21,800 | 4.36 | 95,048.00 | |
| | MAXIS BERHAD | 18,700 | 5.31 | 99,297.00 | |
| | TELEKOM MALAYSIA BHD | 8,200 | 4.00 | 32,800.00 | |
| | PETRONAS GAS BHD | 6,800 | 15.26 | 103,768.00 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 25,300 | 12.16 | 307,648.00 | |
| | YTL CORP BHD | 16,000 | 0.74 | 11,840.00 | |
| | マレーシアリングット 小計 | 526,840 | | 3,122,081.30 (77,052,966) | |
| タイパーツ | BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR | 37,400 | 5.55 | 207,570.00 | |
| | IRPC PCL-NVDR | 53,200 | 2.54 | 135,128.00 | |
| | PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR | 10,600 | 76.25 | 808,250.00 | |
| | PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR | 91,300 | 34.00 | 3,104,200.00 | |
| | THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR | 9,100 | 39.50 | 359,450.00 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 14,200 | 26.25 | 372,750.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR | 19,300 | 36.75 | 709,275.00 | |
| | SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR | 6,300 | 323.00 | 2,034,900.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR | 34,700 | 58.75 | 2,038,625.00 | |

| | | | |
|--|-----------|--------|-------------------------------|
| BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR | 54,700 | 9.10 | 497,770.00 |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 61,200 | 10.90 | 667,080.00 |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 19,400 | 21.00 | 407,400.00 |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 14,091 | 36.25 | 510,798.75 |
| HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR | 41,800 | 13.10 | 547,580.00 |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR | 7,300 | 41.75 | 304,775.00 |
| CP ALL PCL-NVDR | 46,700 | 66.25 | 3,093,875.00 |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR | 32,900 | 27.50 | 904,750.00 |
| OSOTSPA PCL-NVDR | 7,000 | 41.00 | 287,000.00 |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 21,900 | 12.70 | 278,130.00 |
| BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR | 70,900 | 20.60 | 1,460,540.00 |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR | 3,200 | 119.00 | 380,800.00 |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG | 3,100 | 103.00 | 319,300.00 |
| KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN | 8,900 | 88.50 | 787,650.00 |
| KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR | 5,500 | 88.50 | 486,750.00 |
| KRUNG THAI BANK PCL-NVDR | 29,200 | 10.50 | 306,600.00 |
| SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR | 5,600 | 67.00 | 375,200.00 |
| TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR | 135,700 | 0.91 | 123,487.00 |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 4,200 | 45.00 | 189,000.00 |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 6,300 | 52.00 | 327,600.00 |
| CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR | 17,300 | 47.75 | 826,075.00 |
| LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR | 54,800 | 7.10 | 389,080.00 |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 8,900 | 198.50 | 1,766,650.00 |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 18,900 | 52.50 | 992,250.00 |
| TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR | 4,600 | 45.00 | 207,000.00 |
| TRUE CORPORATION PCL-NVDR | 76,500 | 3.24 | 247,860.00 |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | 6,800 | 43.75 | 297,500.00 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR | 2,500 | 266.00 | 665,000.00 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 14,700 | 39.00 | 573,300.00 |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 5,800 | 69.25 | 401,650.00 |
| GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR | 23,000 | 38.00 | 874,000.00 |
| RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR | 4,800 | 63.25 | 303,600.00 |
| タイパーツ 小計 | 1,094,291 | | 29,570,198.75 (97,877,357) |
| フィリピンペソ | | | |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 16,450 | 40.65 | 668,692.50 |
| AYALA CORPORATION | 2,380 | 550.00 | 1,309,000.00 |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 600 | 443.40 | 266,040.00 |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 24,130 | 49.00 | 1,182,370.00 |
| SM INVESTMENTS CORP | 2,005 | 814.00 | 1,632,070.00 |
| INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 7,270 | 78.00 | 567,060.00 |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 4,110 | 134.30 | 551,973.00 |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | 7,110 | 118.40 | 841,824.00 |

| | | | | | |
|-----------------------|------------------------------------|----------|------------------|------------------|--------------|
| | BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 7,737 | 59.50 | 460,351.50 | |
| | BDO UNIBANK INC | 16,000 | 100.00 | 1,600,000.00 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 13,040 | 39.00 | 508,560.00 | |
| | SECURITY BANK CORP | 2,020 | 102.00 | 206,040.00 | |
| | METRO PACIFIC INVESTMENTS CO | 110,900 | 2.59 | 287,231.00 | |
| | ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW | 146 | 5.19 | 757.74 | |
| | AYALA LAND INC | 55,900 | 28.90 | 1,615,510.00 | |
| | MEGAWORLD CORP | 92,000 | 2.59 | 238,280.00 | |
| | ROBINSONS LAND CO | 17,200 | 15.50 | 266,600.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 76,100 | 28.65 | 2,180,265.00 | |
| | GLOBE TELECOM INC | 220 | 2,208.00 | 485,760.00 | |
| | PLDT INC | 530 | 1,227.00 | 650,310.00 | |
| | ABOITIZ POWER CORP | 12,000 | 26.55 | 318,600.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 1,350 | 256.00 | 345,600.00 | |
| | フィリピンペソ 小計 | 469,198 | | 16,182,894.74 | (34,307,736) |
| インドネシアル ピア | ADARO ENERGY TBK PT | 115,900 | 875.00 | 101,412,500.00 | |
| | BUKIT ASAM TBK PT | 10,400 | 1,850.00 | 19,240,000.00 | |
| | PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES | 12,200 | 16,225.00 | 197,945,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 208,200 | 1,240.00 | 258,168,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 16,100 | 4,950.00 | 79,695,000.00 | |
| | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 13,200 | 10,575.00 | 139,590,000.00 | |
| | PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT | 12,900 | 4,710.00 | 60,759,000.00 | |
| | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 21,300 | 6,700.00 | 142,710,000.00 | |
| | JASA MARGA(PERSERO)TBK PT | 23,600 | 2,550.00 | 60,180,000.00 | |
| | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 163,900 | 3,630.00 | 594,957,000.00 | |
| | ACE HARDWARE INDONESIA | 66,900 | 1,390.00 | 92,991,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 53,600 | 4,080.00 | 218,688,000.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 21,200 | 9,900.00 | 209,880,000.00 | |
| | PT GUDANG GARAM TBK | 4,000 | 42,800.00 | 171,200,000.00 | |
| | PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK | 54,700 | 1,520.00 | 83,144,000.00 | |
| | PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK | 35,600 | 6,325.00 | 225,170,000.00 | |
| | PT UNILEVER INDONESIA TBK | 64,200 | 7,500.00 | 481,500,000.00 | |
| | KALBE FARMA PT | 153,100 | 1,255.00 | 192,140,500.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PT | 62,800 | 3,800.00 | 238,640,000.00 | |
| | BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO | 15,500 | 830.00 | 12,865,000.00 | |
| | PT BANK CENTRAL ASIA TBK | 77,300 | 24,600.00 | 1,901,580,000.00 | |
| | PT BANK MANDIRI | 150,400 | 4,280.00 | 643,712,000.00 | |
| | PT BANK RAKYAT | 442,100 | 2,630.00 | 1,162,723,000.00 | |
| | BUMI SERPONG DAMAI PT | 28,200 | 660.00 | 18,612,000.00 | |
| PAKUWON JATI TBK PT | 79,400 | 350.00 | 27,790,000.00 | | |
| TELEKOMUNIKASI TBK PT | 397,200 | 3,090.00 | 1,227,348,000.00 | | |

| | | | | | |
|--------------------------|--|------------|---------------|----------------------------------|--|
| | XL AXIATA TBK PT | 35,400 | 2,380.00 | 84,252,000.00 | |
| | PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 65,600 | 770.00 | 50,512,000.00 | |
| | インドネシアルピア 小計 | 2,404,900 | | 8,697,404,000.00 (60,881,828) | |
| 韓国ウォン | GS HOLDINGS | 421 | 37,500.00 | 15,787,500.00 | |
| | S-OIL CORPORATION | 310 | 70,300.00 | 21,793,000.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 458 | 97,600.00 | 44,700,800.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORP | 970 | 14,000.00 | 13,580,000.00 | |
| | HYUNDAI STEEL COMPANY | 658 | 18,900.00 | 12,436,200.00 | |
| | KCC CORP | 30 | 154,500.00 | 4,635,000.00 | |
| | KOREA ZINC CO., LTD. | 68 | 390,000.00 | 26,520,000.00 | |
| | KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD | 113 | 70,800.00 | 8,000,400.00 | |
| | LG CHEM LTD | 367 | 353,500.00 | 129,734,500.00 | |
| | LG CHEM LTD | 63 | 163,500.00 | 10,300,500.00 | |
| | LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 122 | 212,500.00 | 25,925,000.00 | |
| | OCI COMPANY LTD | 110 | 37,800.00 | 4,158,000.00 | |
| | POSCO | 629 | 173,000.00 | 108,817,000.00 | |
| | POSCO CHEMUCAL CO LTD | 201 | 51,800.00 | 10,411,800.00 | |
| | CJ CORP | 90 | 71,700.00 | 6,453,000.00 | |
| | DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD | 255 | 81,400.00 | 20,757,000.00 | |
| | DAEWOO ENGINEERING & CONSTR | 2,143 | 3,300.00 | 7,071,900.00 | |
| | DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING | 415 | 17,700.00 | 7,345,500.00 | |
| | DOOSAN BOBCAT INC | 289 | 22,600.00 | 6,531,400.00 | |
| | GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 512 | 24,100.00 | 12,339,200.00 | |
| | HANWHA CORPORATION | 165 | 18,450.00 | 3,044,250.00 | |
| | HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN | 192 | 17,500.00 | 3,360,000.00 | |
| | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO | 562 | 33,000.00 | 18,546,000.00 | |
| | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS | 70 | 229,000.00 | 16,030,000.00 | |
| | KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 596 | 25,450.00 | 15,168,200.00 | |
| | KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN | 274 | 76,400.00 | 20,933,600.00 | |
| | LG CORP | 783 | 62,000.00 | 48,546,000.00 | |
| | LOTTE CORPORATION | 108 | 26,500.00 | 2,862,000.00 | |
| | POSCO INTERNATIONAL CORP | 441 | 13,350.00 | 5,887,350.00 | |
| | SAMSUNG C&T CORPORATION | 643 | 98,700.00 | 63,464,100.00 | |
| | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 1,267 | 10,900.00 | 13,810,300.00 | |
| | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD. | 3,170 | 4,170.00 | 13,218,900.00 | |
| SK HOLDINGS CO LTD | 289 | 175,500.00 | 50,719,500.00 | | |
| S1 CORPORATION | 106 | 83,400.00 | 8,840,400.00 | | |
| CJ LOGISTICS CORPORATION | 74 | 146,000.00 | 10,804,000.00 | | |
| GLOVIS CO LTD | 153 | 98,300.00 | 15,039,900.00 | | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 295 | 19,800.00 | 5,841,000.00 | | |
| PAN OCEAN CO LTD | 2,212 | 3,370.00 | 7,454,440.00 | | |

| | | | |
|----------------------------------|-------|--------------|----------------|
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | 611 | 20,650.00 | 12,617,150.00 |
| HANON SYSTEMS | 1,587 | 8,760.00 | 13,902,120.00 |
| HYUNDAI MOBIS | 535 | 169,000.00 | 90,415,000.00 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 1,195 | 90,100.00 | 107,669,500.00 |
| HYUNDAI MOTOR COMPANY | 265 | 57,500.00 | 15,237,500.00 |
| HYUNDAI MOTOR COMPANY | 180 | 55,900.00 | 10,062,000.00 |
| KIA MOTORS CORPORATION | 1,966 | 27,700.00 | 54,458,200.00 |
| COWAY CO LTD | 364 | 59,400.00 | 21,621,600.00 |
| FILA HOLDINGS CORP | 358 | 33,200.00 | 11,885,600.00 |
| HLB INC | 261 | 95,400.00 | 24,899,400.00 |
| HLB INC--RIGHTS-NEW | 26 | 28,032.00 | 728,832.00 |
| LG ELECTRONICS INC | 878 | 52,600.00 | 46,182,800.00 |
| KANGWON LAND INC | 845 | 24,150.00 | 20,406,750.00 |
| CHEIL COMMUNICATIONS INC | 533 | 17,100.00 | 9,114,300.00 |
| KAKAO CORP | 420 | 183,000.00 | 76,860,000.00 |
| NAVER CORPORATION | 1,113 | 192,500.00 | 214,252,500.00 |
| NCSOFT CORP | 124 | 653,000.00 | 80,972,000.00 |
| NETMARBLE CORPORATION | 232 | 90,900.00 | 21,088,800.00 |
| PEARLABYSS CORP | 54 | 201,100.00 | 10,859,400.00 |
| CJ ENM CO LTD | 57 | 110,700.00 | 6,309,900.00 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 258 | 76,900.00 | 19,840,200.00 |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD | 132 | 67,500.00 | 8,910,000.00 |
| LOTTE SHOPPING CO LTD | 60 | 84,700.00 | 5,082,000.00 |
| SHINSEGAE CO LTD | 63 | 243,500.00 | 15,340,500.00 |
| BGF RETAIL CO LTD | 61 | 148,500.00 | 9,058,500.00 |
| E-MART INC | 171 | 108,500.00 | 18,553,500.00 |
| GS RETAIL CO LTD | 290 | 31,300.00 | 9,077,000.00 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 70 | 259,000.00 | 18,130,000.00 |
| KT&G CORPORATION | 872 | 78,900.00 | 68,800,800.00 |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 179 | 121,500.00 | 21,748,500.00 |
| OTTOGI CORPORATION | 4 | 539,000.00 | 2,156,000.00 |
| AMOREPACIFIC CORP | 268 | 171,000.00 | 45,828,000.00 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 33 | 62,000.00 | 2,046,000.00 |
| AMOREPACIFIC GROUP | 240 | 57,600.00 | 13,824,000.00 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 76 | 1,434,000.00 | 108,984,000.00 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF | 17 | 763,000.00 | 12,971,000.00 |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 435 | 85,000.00 | 36,975,000.00 |
| CELLTRION INC | 755 | 211,500.00 | 159,682,500.00 |
| HANMI PHARM CO LTD | 55 | 254,000.00 | 13,970,000.00 |
| HELIXMITH CO LTD | 137 | 66,400.00 | 9,096,800.00 |
| HELIXMITH CO LTD(NEW) | 34 | 66,400.00 | 2,257,600.00 |
| MEDY-TOC INC | 23 | 110,000.00 | 2,530,000.00 |

| | | | | | |
|-------|---------------------------------------|---------|------------|-----------------------------------|--|
| | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 136 | 591,000.00 | 80,376,000.00 | |
| | YUHAN CORPORATION | 395 | 46,950.00 | 18,545,250.00 | |
| | BS FINANCIAL GROUP INC | 2,009 | 4,635.00 | 9,311,715.00 | |
| | HANA FINANCIAL GROUP INC. | 2,246 | 23,150.00 | 51,994,900.00 | |
| | INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 1,867 | 7,200.00 | 13,442,400.00 | |
| | KB FINANCIAL GROUP INC | 3,185 | 31,100.00 | 99,053,500.00 | |
| | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 3,673 | 27,150.00 | 99,721,950.00 | |
| | WOORI FINANCIAL GROUP INC | 4,533 | 7,850.00 | 35,584,050.00 | |
| | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 303 | 46,000.00 | 13,938,000.00 | |
| | MERITZ SECURITIES CO LTD | 1,580 | 2,980.00 | 4,708,400.00 | |
| | MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 2,873 | 5,150.00 | 14,795,950.00 | |
| | SAMSUNG CARD CO LTD | 310 | 27,800.00 | 8,618,000.00 | |
| | SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD. | 453 | 27,300.00 | 12,366,900.00 | |
| | WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD | 748 | 8,680.00 | 6,492,640.00 | |
| | DB INSURANCE CO LTD | 359 | 42,500.00 | 15,257,500.00 | |
| | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 954 | 1,685.00 | 1,607,490.00 | |
| | HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 333 | 25,400.00 | 8,458,200.00 | |
| | SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 223 | 184,500.00 | 41,143,500.00 | |
| | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD. | 490 | 46,900.00 | 22,981,000.00 | |
| | SAMSUNG SDS CO LTD | 288 | 157,000.00 | 45,216,000.00 | |
| | KMW CO LTD | 241 | 61,700.00 | 14,869,700.00 | |
| | LG DISPLAY CO LTD | 1,686 | 10,550.00 | 17,787,300.00 | |
| | LG INNOTEK CO LTD | 115 | 126,000.00 | 14,490,000.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 459 | 107,500.00 | 49,342,500.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 37,472 | 49,350.00 | 1,849,243,200.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 6,448 | 42,500.00 | 274,040,000.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 440 | 277,000.00 | 121,880,000.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 1,886 | 12,750.00 | 24,046,500.00 | |
| | SK TELECOM CO LTD | 141 | 209,500.00 | 29,539,500.00 | |
| | KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION | 2,129 | 22,550.00 | 48,008,950.00 | |
| | KOREA GAS CORPORATION | 265 | 26,250.00 | 6,956,250.00 | |
| | HYNIX SEMICONDUCTOR INC | 4,308 | 81,400.00 | 350,671,200.00 | |
| | 韓国ウォン 小計 | 118,009 | | 5,679,761,337.00 (495,843,164) | |
| 新台幣ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 11,000 | 81.00 | 891,000.00 | |
| | ASIA CEMENT CORPORATION | 16,000 | 41.70 | 667,200.00 | |
| | CHINA STEEL CORP | 88,000 | 19.15 | 1,685,200.00 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION | 28,000 | 68.30 | 1,912,400.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORPORATION | 36,000 | 80.00 | 2,880,000.00 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 41,000 | 57.00 | 2,337,000.00 | |
| | TAIWAN CEMENT CORPORATION | 40,073 | 42.00 | 1,683,066.00 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 1,000 | 496.00 | 496,000.00 | |

| | | | |
|---|---------|--------|--------------|
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 25,000 | 23.75 | 593,750.00 |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 2,060 | 238.00 | 490,280.00 |
| CHINA AIRLINES LTD | 10,000 | 7.03 | 70,300.00 |
| EVA AIRWAYS CORP | 18,897 | 9.90 | 187,080.30 |
| EVERGREEN MARINE CORPORATION | 22,740 | 9.94 | 226,035.60 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 17,000 | 31.50 | 535,500.00 |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD | 14,000 | 30.60 | 428,400.00 |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 2,000 | 275.00 | 550,000.00 |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 2,200 | 146.00 | 321,200.00 |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD | 10,000 | 31.10 | 311,000.00 |
| GIANT MANUFACTURING CO LTD | 2,000 | 150.50 | 301,000.00 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 1,000 | 209.00 | 209,000.00 |
| POU CHEN | 19,000 | 26.60 | 505,400.00 |
| RUENTEX INDUSTRIES LIMITED | 1,200 | 66.30 | 79,560.00 |
| TATUNG CO LTD | 10,000 | 21.40 | 214,000.00 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 2,000 | 485.50 | 971,000.00 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 5,000 | 288.00 | 1,440,000.00 |
| STANDARD FOODS CORPORATION | 2,000 | 65.90 | 131,800.00 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 39,000 | 66.60 | 2,597,400.00 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 46,253 | 18.90 | 874,181.70 |
| CHINATRUST FINANCIAL HOLDING | 148,000 | 18.60 | 2,752,800.00 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 78,785 | 25.70 | 2,024,774.50 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 74,863 | 20.60 | 1,542,177.80 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 60,359 | 18.05 | 1,089,479.95 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 87,000 | 28.20 | 2,453,400.00 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD. | 89,760 | 11.25 | 1,009,800.00 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS | 79,643 | 11.70 | 931,823.10 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 44,288 | 10.15 | 449,523.20 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO | 69,276 | 19.00 | 1,316,244.00 |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 25,299 | 40.60 | 1,027,139.40 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 8,262 | 98.70 | 815,459.40 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 72,000 | 16.10 | 1,159,200.00 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 63,000 | 37.05 | 2,334,150.00 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 107,000 | 8.40 | 898,800.00 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 21,540 | 19.25 | 414,645.00 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 50,000 | 39.20 | 1,960,000.00 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD | 91,432 | 8.08 | 738,770.56 |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 6,000 | 40.55 | 243,300.00 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 1,800 | 41.70 | 75,060.00 |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 5,000 | 195.00 | 975,000.00 |
| ACER INC | 18,000 | 15.65 | 281,700.00 |
| ADVANTECH CO LTD | 3,000 | 264.50 | 793,500.00 |

| | | | | |
|--------|--|-----------|----------|---------------------------------|
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 5,000 | 193.00 | 965,000.00 |
| | AU OPTRONICS CORP | 78,000 | 7.45 | 581,100.00 |
| | CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 5,000 | 219.50 | 1,097,500.00 |
| | CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 4,010 | 82.20 | 329,622.00 |
| | COMPAL ELECTRONICS | 37,000 | 18.55 | 686,350.00 |
| | DELTA ELECTRONICS INC | 15,000 | 131.00 | 1,965,000.00 |
| | FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 7,000 | 53.60 | 375,200.00 |
| | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 97,800 | 73.80 | 7,217,640.00 |
| | INNOLUX DISPLAY CORPORATION | 65,000 | 6.14 | 399,100.00 |
| | INVENTEC CORPORATION | 24,000 | 23.10 | 554,400.00 |
| | LARGAN PRECISION CO LTD | 780 | 3,740.00 | 2,917,200.00 |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 15,000 | 43.80 | 657,000.00 |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 4,000 | 92.00 | 368,000.00 |
| | PEGATRON CORP | 14,000 | 64.70 | 905,800.00 |
| | QUANTA COMPUTER INC | 20,000 | 62.40 | 1,248,000.00 |
| | SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 10,000 | 38.05 | 380,500.00 |
| | WALSIN TECHNOLOGY CORP | 2,000 | 207.50 | 415,000.00 |
| | WISTRON CORPORATION | 25,293 | 26.00 | 657,618.00 |
| | WIWYNN CORP | 1,000 | 669.00 | 669,000.00 |
| | WPG HOLDINGS CO LTD | 9,520 | 37.30 | 355,096.00 |
| | YAGEO CORPORATION | 2,198 | 345.00 | 758,310.00 |
| | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 4,000 | 99.30 | 397,200.00 |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 30,000 | 108.50 | 3,255,000.00 |
| | FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 11,000 | 65.50 | 720,500.00 |
| | TAIWAN MOBILE CO LTD | 13,000 | 106.00 | 1,378,000.00 |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 27,000 | 63.10 | 1,703,700.00 |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 2,000 | 360.00 | 720,000.00 |
| | MEDIATEK INCORPORATION | 12,000 | 348.50 | 4,182,000.00 |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 10,000 | 59.10 | 591,000.00 |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD | 4,000 | 176.00 | 704,000.00 |
| | PHISON ELECTRONICS CORP | 1,000 | 263.50 | 263,500.00 |
| | POWERTECH TECHNOLOGY INC | 6,000 | 98.70 | 592,200.00 |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 4,000 | 231.50 | 926,000.00 |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 193,000 | 294.00 | 56,742,000.00 |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION | 80,000 | 15.90 | 1,272,000.00 |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR | 7,000 | 66.80 | 467,600.00 |
| | WIN SEMICONDUCTORS CORP | 3,000 | 251.00 | 753,000.00 |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 20,000 | 13.00 | 260,000.00 |
| | 新台湾ドル 小計 | 2,585,331 | | 147,305,636.51 (527,354,178) |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 5,014 | 350.45 | 1,757,156.30 |
| | COAL INDIA LTD | 8,717 | 137.00 | 1,194,229.00 |

| | | | |
|---|--------|-----------|---------------|
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 4,473 | 201.40 | 900,862.20 |
| INDIAN OIL CORP LTD | 13,301 | 81.50 | 1,084,031.50 |
| OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED | 17,465 | 67.60 | 1,180,634.00 |
| PETRONET LNG LTD | 4,423 | 218.50 | 966,425.50 |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 22,471 | 1,417.00 | 31,841,407.00 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 4,499 | 167.95 | 755,607.05 |
| ASIAN PAINTS LTD | 2,345 | 1,827.55 | 4,285,604.75 |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 2,004 | 519.70 | 1,041,478.80 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 2,103 | 499.05 | 1,049,502.15 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 9,223 | 103.65 | 955,963.95 |
| JSW STEEL LTD | 6,718 | 153.25 | 1,029,533.50 |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 886 | 1,505.20 | 1,333,607.20 |
| SHREE CEMENT LTD | 61 | 18,587.45 | 1,133,834.45 |
| TATA STEEL LTD | 3,137 | 267.55 | 839,304.35 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 830 | 3,307.95 | 2,745,598.50 |
| UPL LTD | 3,725 | 335.85 | 1,251,041.25 |
| VEDANTA LTD | 13,075 | 77.95 | 1,019,196.25 |
| ASHOK LEYLAND LIMITED | 10,356 | 44.95 | 465,502.20 |
| HAVELLS INDIA LTD | 2,221 | 525.60 | 1,167,357.60 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 3,569 | 851.20 | 3,037,932.80 |
| SIEMENS LTD | 617 | 1,145.90 | 707,020.30 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 4,400 | 270.65 | 1,190,860.00 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED | 1,604 | 361.10 | 579,204.40 |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 676 | 891.75 | 602,823.00 |
| BAJAJ AUTO LTD | 657 | 2,445.35 | 1,606,594.95 |
| BHARAT FORGE LTD | 2,003 | 263.25 | 527,289.75 |
| BOSCH LIMITED | 55 | 10,212.45 | 561,684.75 |
| EICHER MOTORS LTD | 103 | 13,589.20 | 1,399,687.60 |
| HERO MOTOCORP LTD | 688 | 1,894.80 | 1,303,622.40 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 6,175 | 334.30 | 2,064,302.50 |
| MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED | 788 | 5,045.65 | 3,975,972.20 |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 7,442 | 72.00 | 535,824.00 |
| TATA MOTORS LTD | 12,440 | 74.20 | 923,048.00 |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 46 | 17,854.35 | 821,300.10 |
| TITAN CO LTD | 2,567 | 906.05 | 2,325,830.35 |
| INFO EDGE INDIA LTD | 500 | 2,327.10 | 1,163,550.00 |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 5,651 | 145.15 | 820,242.65 |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 1,054 | 2,310.50 | 2,435,267.00 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED | 426 | 3,062.15 | 1,304,475.90 |
| ITC LIMITED | 25,552 | 180.05 | 4,600,637.60 |
| NESTLE INDIA LTD | 178 | 17,406.05 | 3,098,276.90 |
| UNITED SPIRITS LTD | 2,109 | 519.50 | 1,095,625.50 |

| | | | | |
|---|---------|----------|---------------------------------|--|
| COLGATE PALMOLIVE INDIA | 573 | 1,483.65 | 850,131.45 | |
| DABUR INDIA LIMITED | 4,168 | 499.05 | 2,080,040.40 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 2,808 | 534.40 | 1,500,595.20 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 6,440 | 2,283.10 | 14,703,164.00 | |
| MARICO LTD | 3,281 | 306.10 | 1,004,314.10 | |
| AUROBINDO PHARMA LIMITED | 1,539 | 624.45 | 961,028.55 | |
| CIPLA LTD | 3,110 | 599.30 | 1,863,823.00 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 596 | 2,425.40 | 1,445,538.40 | |
| DR.REDDY'S LABORATORIES | 950 | 4,002.80 | 3,802,660.00 | |
| LUPIN LTD | 1,307 | 877.35 | 1,146,696.45 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 909 | 864.45 | 785,785.05 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD | 7,019 | 485.55 | 3,408,075.45 | |
| AXIS BANK LIMITED | 16,577 | 403.95 | 6,696,279.15 | |
| BANDHAN BANK LTD | 2,530 | 198.45 | 502,078.50 | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION | 12,937 | 1,580.30 | 20,444,341.10 | |
| ICICI BANK LIMITED | 37,805 | 334.85 | 12,659,004.25 | |
| LIC HOUSING FINANCE LTD | 2,812 | 260.65 | 732,947.80 | |
| STATE BANK OF INDIA | 14,494 | 179.75 | 2,605,296.50 | |
| BAJAJ FINANCE LIMITED | 1,449 | 1,976.25 | 2,863,586.25 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 350 | 2,427.75 | 849,712.50 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 2,348 | 140.45 | 329,776.60 | |
| REC LTD | 5,374 | 89.35 | 480,166.90 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 785 | 668.20 | 524,537.00 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 294 | 4,389.80 | 1,290,601.20 | |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 3,535 | 453.35 | 1,602,592.25 | |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | 1,428 | 1,136.50 | 1,622,922.00 | |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 2,564 | 336.55 | 862,914.20 | |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 2,697 | 679.15 | 1,831,667.55 | |
| DLF LIMITED | 4,986 | 128.20 | 639,205.20 | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 8,583 | 468.10 | 4,017,702.30 | |
| INFOSYS LIMITED | 26,905 | 658.00 | 17,703,490.00 | |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD | 7,057 | 1,818.55 | 12,833,507.35 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 3,833 | 503.45 | 1,929,723.85 | |
| WIPRO LTD | 8,396 | 177.75 | 1,492,389.00 | |
| BHARTI AIRTEL LIMITED | 19,555 | 494.25 | 9,665,058.75 | |
| BHARTI INFRATEL LTD | 3,387 | 152.00 | 514,824.00 | |
| GAIL INDIA LIMITED | 13,856 | 81.50 | 1,129,264.00 | |
| NTPC LTD | 18,498 | 93.40 | 1,727,713.20 | |
| POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED | 15,235 | 159.15 | 2,424,650.25 | |
| TATA POWER CO LTD | 4,120 | 31.05 | 127,926.00 | |
| インドルピー 小計 | 491,437 | | 238,334,679.85 (338,435,245) | |

| | | | | |
|--------------------------------|---|--------|------------|---------------------------|
| エジプトbond | ELSEWEDY ELECTRIC CO | 5,455 | 9.49 | 51,767.95 |
| | EASTERN TOBACCO | 5,913 | 12.06 | 71,310.78 |
| | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE | 11,199 | 62.40 | 698,817.60 |
| エジプトbond 小計 | | 22,567 | | 821,896.33 (5,597,114) |
| 南アフリカbond | EXXARO RESOURCES LIMITED | 1,848 | 106.57 | 196,941.36 |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 416 | 935.20 | 389,043.20 |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED | 3,120 | 518.28 | 1,617,033.60 |
| | GOLD FIELDS LIMITED | 6,802 | 157.84 | 1,073,627.68 |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED | 6,071 | 110.07 | 668,234.97 |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 490 | 346.85 | 169,956.50 |
| | NORTHAM PLATINUM LTD | 2,882 | 92.65 | 267,017.30 |
| | SASOL LTD. | 4,187 | 67.00 | 280,529.00 |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 18,668 | 38.05 | 710,317.40 |
| | BIDVEST GROUP LTD | 2,459 | 141.75 | 348,563.25 |
| | MULTICHOICE GROUP LTD | 3,068 | 89.97 | 276,027.96 |
| | MR PRICE GROUP LTD | 2,037 | 130.69 | 266,215.53 |
| | NASPERS LIMITED-N SHS | 3,498 | 2,904.00 | 10,158,192.00 |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 7,054 | 10.30 | 72,656.20 |
| | THE FOSCHINI GROUP | 2,131 | 69.15 | 147,358.65 |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED | 7,756 | 27.77 | 215,384.12 |
| | BID CORP LTD | 2,744 | 229.16 | 628,815.04 |
| | CLICKS GROUP LTD | 2,022 | 229.02 | 463,078.44 |
| | PICK N PAY STORES LTD | 3,137 | 60.57 | 190,008.09 |
| | SHOPRITE HOLDINGS LIMITED | 3,329 | 111.00 | 369,519.00 |
| | SPAR GROUP LIMITED | 1,720 | 189.50 | 325,940.00 |
| | TIGER BRANDS LTD | 929 | 179.21 | 166,486.09 |
| | LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD | 10,359 | 18.39 | 190,502.01 |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 3,076 | 109.89 | 338,021.64 |
| | ABSA GROUP LTD | 5,907 | 79.22 | 467,952.54 |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 327 | 933.00 | 305,091.00 |
| | NEDBANK GROUP LTD | 2,834 | 87.98 | 249,335.32 |
| | STANDARD BANK GROUP LIMITED | 10,384 | 93.12 | 966,958.08 |
| | FIRSTRAND LIMITED | 26,994 | 39.43 | 1,064,373.42 |
| | INVESTEC LTD | 2,223 | 36.91 | 82,050.93 |
| | PSG GROUP LTD | 1,359 | 162.23 | 220,470.57 |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 1,066 | 287.00 | 305,942.00 |
| REMGRO LTD | 4,353 | 128.92 | 561,188.76 | |
| RMB HOLDINGS LTD | 5,468 | 52.08 | 284,773.44 | |
| DISCOVERY LTD | 3,105 | 85.48 | 265,415.40 | |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 472 | 63.82 | 30,123.04 | |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS | 8,911 | 16.39 | 146,051.29 | |

| | | | |
|--|------------|--------|----------------------------------|
| OLD MUTUAL LTD | 39,043 | 12.13 | 473,591.59 |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE | 5,957 | 24.22 | 144,278.54 |
| SANLAM LTD | 13,975 | 56.18 | 785,115.50 |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 3,006 | 78.91 | 237,203.46 |
| MTN GROUP LIMITED | 12,626 | 42.75 | 539,761.50 |
| TELKOM SA SOC LTD | 2,170 | 18.94 | 41,099.80 |
| VODACOM GROUP LIMITED | 5,340 | 124.22 | 663,334.80 |
| 南アフリカランド 小計 | 255,323 | | 27,363,580.01 (154,604,227) |
| 合 計 | 19,156,120 | | 3,662,360,965 (3,662,360,965) |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|----------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 40銘柄 | 7.8% | 13.6% |
| メキシコペソ | 株式 24銘柄 | 1.1% | 1.9% |
| ブラジルレアル | 株式 52銘柄 | 2.9% | 5.0% |
| チリペソ | 株式 17銘柄 | 0.4% | 0.7% |
| コロンビアペソ | 株式 7銘柄 | 0.1% | 0.3% |
| ユーロ | 株式 9銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| トルコリラ | 株式 15銘柄 | 0.3% | 0.5% |
| チェココルナ | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| ハンガリーフォリント | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.3% |
| ポーランドズロチ | 株式 18銘柄 | 0.5% | 0.8% |
| 香港ドル | 株式 205銘柄 | 15.9% | 27.6% |
| マレーシアリングット | 株式 40銘柄 | 1.2% | 2.1% |
| タイバーツ | 株式 41銘柄 | 1.5% | 2.7% |
| フィリピンペソ | 株式 22銘柄 | 0.5% | 0.9% |
| インドネシアルピア | 株式 28銘柄 | 1.0% | 1.7% |
| 韓国ウォン | 株式 112銘柄 | 7.8% | 13.5% |
| 新台湾ドル | 株式 88銘柄 | 8.3% | 14.4% |
| インドルピー | 株式 84銘柄 | 5.3% | 9.2% |
| エジプトポンド | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| 南アフリカランド | 株式 44銘柄 | 2.4% | 4.2% |

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|-----|----------------------------|--------|--------------|----|
| 投資信託受益証券 | 米ドル | GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF | 1,853 | 10,432.39 | |
| | | ISHARES MSCI QATAR ETF | 25,362 | 389,945.82 | |
| | | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | 44,379 | 1,355,112.76 | |

| | | | | | |
|------------|--------------|--|---------|---------------|---------------|
| | | ISHARES MSCI UAE ETF | 22,888 | 227,735.60 | |
| | 米ドル 小計 | | 94,482 | 1,983,226.57 | (213,395,178) |
| | 中国元（オフショア） | CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF | 338,000 | 13,046,800.00 | |
| | 中国元（オフショア）小計 | | 338,000 | 13,046,800.00 | (198,050,424) |
| 投資信託受益証券合計 | | | | 411,445,602 | (411,445,602) |
| 投資証券 | 米ドル | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 41,650 | 1,015,843.50 | |
| | 米ドル 小計 | | 41,650 | 1,015,843.50 | (109,304,760) |
| | メキシコペソ | DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR) | 23,200 | 426,184.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 23,200 | 426,184.00 | (1,836,853) |
| | ブラジルレアル | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 3,200 | 75,008.00 | |
| | | KLABIN SA-UNIT | 5,900 | 101,775.00 | |
| | | SUL AMERICA SA-UNITS | 2,300 | 101,867.00 | |
| | ブラジルレアル 小計 | | 11,400 | 278,650.00 | (5,364,012) |
| | 南アフリカランド | FORTRESS REIT LTD-A | 9,022 | 90,129.78 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 25,563 | 329,762.70 | |
| | | REDEFINE PROPERTIES LTD | 43,761 | 95,836.59 | |
| | | RESILIENT REIT LTD | 115 | 3,845.60 | |
| | 南アフリカランド 小計 | | 78,461 | 519,574.67 | (2,935,596) |
| 投資証券合計 | | | | 119,441,221 | (119,441,221) |
| 合計 | | | | 530,886,823 | (530,886,823) |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資信託受益証券 時価比率 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する 比率 |
|------------|--------------|--------------------|----------------|----------------|
| 米ドル | 投資信託受益証券 4銘柄 | 3.4% | - | 40.2% |
| | 投資証券 1銘柄 | - | 1.7% | 20.6% |
| メキシコペソ | 投資証券 1銘柄 | - | 0.0% | 0.3% |
| ブラジルレアル | 投資証券 3銘柄 | - | 0.1% | 1.0% |
| 南アフリカランド | 投資証券 4銘柄 | - | 0.0% | 0.6% |
| 中国元（オフショア） | 投資信託受益証券 1銘柄 | 3.1% | - | 37.3% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

| （単位：円） | |
|-----------------|----------------------|
| （2020年 4月27日現在） | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 29,223,710 |
| コール・ローン | 29,959,559 |
| 投資証券 | 3,952,989,000 |
| 未収入金 | 102,225 |
| 未収配当金 | 45,102,963 |
| 前払金 | 14,135,500 |
| 差入委託証拠金 | 15,120,000 |
| 流動資産合計 | <u>4,086,632,957</u> |
| 資産合計 | <u>4,086,632,957</u> |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 14,148,700 |
| 未払解約金 | 2,285,580 |
| 未払利息 | 86 |
| その他未払費用 | 10,403 |
| 流動負債合計 | <u>16,444,769</u> |
| 負債合計 | <u>16,444,769</u> |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 2,079,734,759 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | <u>1,990,453,429</u> |
| 元本等合計 | <u>4,070,188,188</u> |
| 純資産合計 | <u>4,070,188,188</u> |
| 負債純資産合計 | <u>4,086,632,957</u> |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項 目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----|--------------------------------|
|-----|--------------------------------|

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | |
|-----------------------|-------------------|----------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 2,079,734,759口 | |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 | 1.9571円 |
| | (10,000口当たりの純資産額) | 19,571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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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。 | |
| | (1)金融商品の内容 | |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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27日現在) |
|-----|-----------------|

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|------|------------|-------------|-------|------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |
| | 東証REIT指数先物 | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |
| | 合計 | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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）

| （2020年 4月27日現在） | |
|--|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,088,186,762円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 460,275,364円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,468,727,367円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 152,382,989円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 310,073,497円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 261,721,272円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,177,332,621円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 5,392,698円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） | 25,359,901円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） | 17,271,591円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） | 48,367,096円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） | 24,397,339円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） | 20,133,135円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 10,128,064円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,159,286円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 383,164円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 5,389,396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> | 4,214,611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> | 6,211,193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> | 9,816,906円 |
| 合計 | 2,079,734,759円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------------|------------------------------|------------|-------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 58 | 5,562,200 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 70 | 6,545,000 | |
| | S O S i L A物流リート投資法人 | 107 | 12,925,600 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 160 | 101,280,000 | |
| | M C U B S M i d C i t y 投資法人 | 618 | 46,350,000 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 554 | 78,058,600 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 622 | 92,429,200 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 457 | 146,468,500 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 315 | 52,762,500 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 242 | 77,440,000 | |
| | G L P 投資法人 | 1,200 | 161,880,000 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 210 | 67,515,000 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 726 | 207,853,800 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 74 | 28,675,000 | |
| | O n e リート投資法人 | 75 | 18,022,500 | |
| | イオンリート投資法人 | 519 | 56,571,000 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 411 | 49,278,900 | |
| | 日本リート投資法人 | 157 | 51,182,000 | |
| | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 3,095 | 45,806,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 1,408 | 94,054,400 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 104 | 10,566,400 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 187 | 31,846,100 | |
| | ヘルスケア&メディカル投資法人 | 104 | 12,199,200 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 94 | 8,685,600 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 1,556 | 199,323,600 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 82 | 4,928,200 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 448 | 69,395,200 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 162 | 14,256,000 | |
| | マリモ地方創生リート投資法人 | 46 | 4,365,400 | |
| | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 137 | 60,622,500 | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 84 | 4,846,800 | | |
| さくら総合リート投資法人 | 104 | 7,820,800 | | |
| 投資法人みらい | 548 | 22,084,400 | | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 114 | 9,986,400 | | |

| | | | |
|-----------------------|--------|---------------|--|
| 三菱地所物流リート投資法人 | 95 | 32,727,500 | |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 91 | 13,031,200 | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 70 | 6,685,000 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 137 | 11,864,200 | |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 100 | 12,300,000 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 467 | 299,814,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 482 | 283,416,000 | |
| 日本リテールファンド投資法人 | 911 | 109,137,800 | |
| オリックス不動産投資法人 | 961 | 127,620,800 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 317 | 97,794,500 | |
| プレミア投資法人 | 435 | 49,242,000 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 323 | 47,610,200 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 335 | 30,853,500 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,082 | 120,102,000 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 346 | 42,350,400 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 2,113 | 59,692,250 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 171 | 52,240,500 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 302 | 28,508,800 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 315 | 79,726,500 | |
| 福岡リート投資法人 | 250 | 27,575,000 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 149 | 82,993,000 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 374 | 25,619,000 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 111 | 68,154,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 218 | 25,658,600 | |
| スターツプロシード投資法人 | 75 | 14,430,000 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 688 | 180,324,800 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1,555 | 55,902,250 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 581 | 51,941,400 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 447 | 54,087,000 | |
| 合計 | 28,349 | 3,952,989,000 | |

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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

| (単位：円) | |
|-----------------|----------------------|
| (2020年 4月27日現在) | |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 51,118,215 |
| 金銭信託 | 3,963,979 |
| コール・ローン | 4,063,792 |
| 投資証券 | 5,478,909,884 |
| 派生商品評価勘定 | 5,199 |
| 未収入金 | 2,163 |
| 未収配当金 | 5,165,802 |
| 流動資産合計 | <u>5,543,229,034</u> |
| 資産合計 | <u>5,543,229,034</u> |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 5,197 |
| 未払金 | 5,641,591 |
| 未払利息 | 11 |
| その他未払費用 | 1,101 |
| 流動負債合計 | <u>5,647,900</u> |
| 負債合計 | <u>5,647,900</u> |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 3,351,152,062 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 2,186,429,072 |
| 元本等合計 | <u>5,537,581,134</u> |
| 純資産合計 | <u>5,537,581,134</u> |
| 負債純資産合計 | <u>5,543,229,034</u> |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|---------------------------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 3,351,152,062口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.6524円 |
| | (10,000口当たりの純資産額 16,524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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| | (1) 金融商品の内容 |

| 項 目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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せん。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</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27日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|-----------|-----------|-----------|-------|-----------|-------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 5,500,000 | - | 5,500,602 | 602 |
| | 米ドル | 4,500,000 | - | 4,495,403 | 4,597 |
| | ユーロ | 500,000 | - | 501,768 | 1,768 |
| | オーストラリアドル | 500,000 | - | 503,431 | 3,431 |
| | 売建 | 2,430,180 | - | 2,430,780 | 600 |
| | カナダドル | 610,080 | - | 610,080 | - |
| | 英ポンド | 1,064,400 | - | 1,064,800 | 400 |
| | シンガポールドル | 755,700 | - | 755,900 | 200 |
| | 合計 | 7,930,180 | - | 7,931,382 | 2 |

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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)

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,048,191,413円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 512,908,214円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 209,947,565円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 37,376,988円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 37,514,775円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 28,930,639円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 3,048,076,760円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 2,560,043円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 27,304,661円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 18,240,993円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 55,898,575円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 27,687,998円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 22,576,318円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 35,818,994円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 450,246円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 449,158円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,818,172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> | 5,447,742円 |
| 合計 | 3,351,152,062円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------------------|--------|---|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ACADIA REALTY TRUST | 5,392 | 56,939.52 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 2,607 | 158,427.39 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 136 | 38,974.88 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 6,483 | 969,143.67 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 2,052 | 53,310.96 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC | 7,839 | 234,229.32 | |
| | | AMERICAN FINANCE TRUST INC | 6,262 | 39,638.46 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 13,226 | 304,462.52 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 10,375 | 325,152.50 | |
| | | APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A | 8,345 | 292,826.05 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 10,088 | 84,234.80 | |
| | | ARA US HOSPITALITY TRUST | 20,000 | 8,200.00 | |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 6,012 | 3,765.91 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 7,244 | 1,147,304.72 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 600 | 3,408.00 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 7,314 | 660,893.04 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 602 | 1,438.78 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 9,810 | 97,315.20 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 14,299 | 131,121.83 | |
| | | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 2,361 | 19,619.91 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 500 | 4,425.00 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 5,289 | 442,636.41 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 4,198 | 63,011.98 | |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 7,201 | 1,944.99 | |
| | | CEDAR REALTY TRUST INC | 2,130 | 1,725.30 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 4,019 | 24,797.23 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 4,603 | 39,263.59 | |
| | | CLIPPER REALTY INC | 800 | 3,848.00 | |
| | | COLONY CAPITAL INC-CLASS A | 22,060 | 42,355.20 | |
| | | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 7,180 | 88,816.60 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1,483 | 50,362.68 | |
| | | CORECIVIC INC | 5,301 | 59,159.16 | |
| | | CORESITE REALTY CORPORATION | 2,166 | 261,544.50 | |
| | | CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 6,389 | 166,305.67 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 7,553 | 210,577.64 | | | |
| CUBESMART | 10,448 | 264,125.44 | | | |
| CYRUSONE INC | 6,276 | 456,579.00 | | | |

| | | | |
|--|--------|--------------|--|
| DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY | 10,330 | 52,269.80 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 13,703 | 2,055,861.09 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 10,696 | 28,130.48 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 8,554 | 252,343.00 | |
| DUKE REALTY CORP | 18,801 | 644,874.30 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20,000 | 2,740.00 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 4,292 | 114,982.68 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 1,928 | 201,842.32 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 6,910 | 53,759.80 | |
| EPR PROPERTIES | 3,634 | 86,198.48 | |
| EQUINIX INC | 4,425 | 3,031,567.50 | |
| EQUITY COMMONWEALTH REIT | 6,082 | 207,882.76 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 9,499 | 574,024.57 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 18,477 | 1,182,343.23 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST | 4,017 | 43,343.43 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3,528 | 852,400.08 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 6,687 | 594,407.43 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 300 | 1,938.00 | |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 3,495 | 242,063.70 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 6,809 | 245,328.27 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 3,339 | 65,544.57 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION | 3,700 | 18,870.00 | |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 2,000 | 24,640.00 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 11,012 | 275,410.12 | |
| GEO GROUP INC | 5,536 | 64,826.56 | |
| GETTY REALTY CORPORATION | 1,428 | 34,514.76 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION | 1,440 | 20,044.80 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 600 | 8,112.00 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1,000 | 10,370.00 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 3,433 | 42,912.50 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 7,220 | 204,253.80 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 10,166 | 235,952.86 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 26,682 | 646,504.86 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 1,018 | 4,479.20 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 5,651 | 198,745.67 | |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 39,806 | 441,846.60 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 7,433 | 164,715.28 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST | 4,641 | 42,975.66 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 4,808 | 80,389.76 | |

| | | |
|--|--------|--------------|
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 878 | 65,094.92 |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 323 | 17,923.27 |
| INVITATION HOMES INC | 27,981 | 609,426.18 |
| IRON MOUNTAIN INC | 14,979 | 352,455.87 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 5,796 | 183,965.04 |
| KILROY REALTY CORP | 5,239 | 323,822.59 |
| KIMCO REALTY CORPORATION | 19,534 | 167,992.40 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 3,261 | 24,783.60 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 12,897 | 130,775.58 |
| LIFE STORAGE INC | 2,449 | 216,173.23 |
| LTC PROPERTIES INC | 1,576 | 50,368.96 |
| MACERICH COMPANY/THE | 4,415 | 26,357.55 |
| MACK-CALI REALTY CORPORATION | 4,669 | 69,007.82 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 63,400 | 43,112.00 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 28,119 | 446,248.53 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 5,921 | 630,172.03 |
| MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP | 7,136 | 88,058.24 |
| NATIONAL HEALTH INVESTORS INC | 2,692 | 134,250.04 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 8,720 | 256,804.00 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 3,311 | 91,052.50 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 2,800 | 7,532.00 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 1,760 | 46,992.00 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 1,919 | 47,783.10 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 11,098 | 297,648.36 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 1,000 | 13,970.00 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 8,400 | 70,224.00 |
| PARK HOTELS AND RESORTS INC | 11,136 | 82,517.76 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 5,931 | 62,572.05 |
| PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 2,331 | 1,969.22 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 11,532 | 166,983.36 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 7,882 | 126,112.00 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 2,900 | 19,546.00 |
| PRIME US REIT | 15,000 | 10,500.00 |
| PROLOGIS INC | 38,262 | 3,406,848.48 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 938 | 116,443.32 |
| PUBLIC STORAGE | 7,836 | 1,467,134.28 |
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 2,764 | 176,260.28 |
| REALTY INCOME CORPORATION | 18,299 | 913,486.08 |
| REGENCY CENTERS CORP | 8,552 | 302,997.36 |
| | 7,539 | 60,010.44 |

| | | |
|---|--------|------------|
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | | |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA | 10,355 | 49,186.25 |
| RETAIL VALUE INC | 617 | 6,447.65 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 5,655 | 218,565.75 |
| RLJ LODGING TRUST | 7,377 | 59,311.08 |
| RPT REALTY | 2,740 | 14,439.80 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2,795 | 76,694.80 |
| SABRA HEALTH CARE REIT | 10,004 | 116,446.56 |
| SAFEHOLD INC | 600 | 29,154.00 |
| SAUL CENTERS INC | 703 | 19,698.06 |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 1,500 | 13,230.00 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 7,445 | 42,287.60 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 15,773 | 812,151.77 |
| SITE CENTERS CORP | 5,797 | 28,057.48 |
| SL GREEN REALTY CORP | 4,328 | 193,548.16 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 4,896 | 127,296.00 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 8,656 | 218,390.88 |
| STORE CAPITAL CORP | 10,261 | 162,021.19 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 4,300 | 20,640.00 |
| SUN COMMUNITIES INC | 4,973 | 630,278.02 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 9,659 | 80,845.83 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC | 3,736 | 21,071.04 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 2,883 | 107,910.69 |
| TERRENO REALTY CORP | 3,957 | 206,080.56 |
| UDR INC | 15,754 | 571,712.66 |
| UMH PROPERTIES INC | 800 | 9,000.00 |
| UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 775 | 72,439.25 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 6,559 | 59,358.95 |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A | 2,927 | 33,162.91 |
| VENTAS INC | 19,977 | 553,562.67 |
| VEREIT INC | 51,987 | 243,299.16 |
| VICI PROPERTIES INC | 25,299 | 394,158.42 |
| VORNADO REALTY TRUST | 7,768 | 293,397.36 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 6,130 | 4,229.70 |
| WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4,917 | 107,043.09 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 5,598 | 81,730.80 |
| WELLTOWER INC | 21,363 | 941,253.78 |
| WP CAREY INC | 9,267 | 544,158.24 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 6,674 | 56,128.34 |

| | | | |
|--|--|-----------|----------------------------------|
| 米ドル 小計 | | 1,247,703 | 38,409,058.71 (4,132,814,717) |
| カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE | 3,629 | 153,034.93 |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 2,233 | 19,025.16 |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 735 | 18,683.70 |
| | CAN APARTMENT PROP | 4,246 | 195,061.24 |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 5,671 | 69,583.17 |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR | 8,945 | 73,706.80 |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,500 | 18,855.00 |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,200 | 39,200.00 |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 3,700 | 35,409.00 |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 1,476 | 31,512.60 |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 4,657 | 63,428.34 |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 1,731 | 109,226.10 |
| | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7,692 | 66,920.40 |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 2,479 | 35,424.91 |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 3,017 | 50,534.75 |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 303 | 6,108.48 |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RE | 1,557 | 21,128.49 |
| | NORTHVIEW APARTMENT REIT | 1,844 | 63,691.76 |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 4,111 | 37,574.54 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6,629 | 100,363.06 |
| SLATE OFFICE REIT | 1,000 | 3,740.00 | |
| SLATE RETAIL REIT | 500 | 4,400.00 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 3,256 | 65,836.32 | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 6,456 | 63,204.24 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST | 1,000 | 5,530.00 | |
| カナダドル 小計 | | 81,567 | 1,351,182.99 (103,054,726) |
| ユーロ | AEDIFICA | 1,453 | 126,411.00 |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 7,936 | 105,231.36 |
| | ALTAREA | 80 | 8,464.00 |
| | BEFIMMO SCA | 1,112 | 42,812.00 |
| | COFINIMMO | 1,474 | 175,700.80 |
| | COVIVIO | 2,060 | 122,364.00 |
| | EUROCOMMERCIAL | 2,113 | 18,256.32 |
| | GECINA SA | 3,010 | 332,605.00 |
| | HAMBORNER REIT AG | 6,085 | 47,286.53 |

| | | | |
|------|---------------------------------------|---------|-------------------------------|
| | HIBERNIA REIT PLC | 25,270 | 27,241.06 |
| | ICADE | 1,437 | 99,512.25 |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 3,408 | 11,928.00 |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 11,858 | 92,018.08 |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 1,302 | 28,578.90 |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 10,100 | 11,695.80 |
| | KLEPIERRE | 10,551 | 170,451.40 |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 2,620 | 9,576.10 |
| | MERCIALYS | 2,280 | 17,578.80 |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 18,605 | 134,979.27 |
| | MONTEA | 430 | 33,669.00 |
| | NSI NV | 727 | 26,353.75 |
| | RETAIL ESTATES | 512 | 25,267.20 |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 7,447 | 373,839.40 |
| | VASTNED RETAIL | 925 | 13,523.50 |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 7,293 | 175,177.86 |
| | WERELDHAVE NV | 3,304 | 23,954.00 |
| | ユーロ 小計 | 133,392 | 2,254,475.38 (262,285,665) |
| 英ポンド | ASSURA PLC | 116,800 | 89,235.20 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 10,081 | 105,447.26 |
| | BRITISH LAND CO PLC | 50,779 | 193,417.21 |
| | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 43,000 | 69,015.00 |
| | CAPITAL & REGIONAL PLC | 2,000 | 2,040.00 |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 19,661 | 19,425.06 |
| | DERWENT LONDON PLC | 5,161 | 160,403.88 |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 20,000 | 12,520.00 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 13,270 | 90,501.40 |
| | HAMMERSON PLC | 36,480 | 21,384.57 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 28,500 | 1,556.10 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 38,148 | 240,027.21 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 49,553 | 90,731.54 |
| | LXI REIT PLC | 36,635 | 37,367.70 |
| | NEWRIVER REIT PLC | 17,642 | 10,055.94 |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 15,000 | 10,215.00 |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 63,444 | 97,830.64 |
| | RDI REIT PLC | 8,020 | 4,138.32 |
| | REGIONAL REIT LTD | 45,664 | 29,955.58 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 12,933 | 89,755.02 |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,000 | 6,217.50 |

| | | | |
|------------|---|-----------|-------------------------------|
| | SEGRO PLC | 56,237 | 463,055.45 |
| | SHAFTESBURY PLC | 11,737 | 71,360.96 |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 10,000 | 10,100.00 |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 93,936 | 107,274.91 |
| | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 35,000 | 21,070.00 |
| | UNITE GROUP PLC | 17,621 | 137,796.22 |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 6,465 | 47,226.82 |
| | 英債券 小計 | 878,767 | 2,239,124.49 (298,049,860) |
| オーストラリアドル | ABACUS PROPERTY GROUP | 23,209 | 56,397.87 |
| | APN INDUSTRIA REIT | 1,000 | 2,050.00 |
| | ARENA REIT | 12,763 | 28,078.60 |
| | BWP TRUST | 26,090 | 86,879.70 |
| | CENTURIA OFFICE REIT | 24,034 | 42,540.18 |
| | CHARTER HALL GROUP | 23,313 | 162,957.87 |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 25,945 | 115,195.80 |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 24,091 | 75,886.65 |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 7,100 | 15,549.00 |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 82,000 | 61,090.00 |
| | DEXUS | 55,821 | 487,875.54 |
| | GDI PROPERTY GROUP | 18,000 | 18,180.00 |
| | GOODMAN GROUP | 85,465 | 1,106,771.75 |
| | GPT GROUP | 100,476 | 371,761.20 |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUS | 15,930 | 45,719.10 |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 100 | 220.00 |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 8,166 | 29,152.62 |
| | MIRVAC GROUP | 214,822 | 442,533.32 |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 43,936 | 73,153.44 |
| | RURAL FUNDS GROUP | 10,000 | 19,400.00 |
| | SCENTRE GROUP | 297,092 | 597,154.92 |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR | 42,042 | 92,912.82 |
| | STOCKLAND | 139,503 | 371,077.98 |
| | VICINITY CENTRES | 150,809 | 193,789.56 |
| | VIVA ENERGY REIT | 50,503 | 119,692.11 |
| | オーストラリアドル 小計 | 1,482,210 | 4,616,020.03 (318,320,741) |
| ニュージーランドドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 30,000 | 32,700.00 |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 52,430 | 122,686.20 |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 86,057 | 83,905.57 |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 76,088 | 120,599.48 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 19,000 | 47,310.00 |

| | | | |
|----------------------|--|-----------|-------------------------------|
| ニュージーランドドル 小計 | | 263,575 | 407,201.25 (26,386,641) |
| 香港ドル | CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT | 92,000 | 431,480.00 |
| | FORTUNE REIT | 80,000 | 556,800.00 |
| | LINK REIT | 110,800 | 7,368,200.00 |
| | PROSPERITY REIT | 60,000 | 144,000.00 |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 37,000 | 143,190.00 |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 61,000 | 225,700.00 |
| 香港ドル 小計 | | 440,800 | 8,869,370.00 (123,106,855) |
| シンガポールドル | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 23,500 | 26,790.00 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 149,500 | 405,145.00 |
| | ASCOTT TRUST | 117,055 | 95,399.82 |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 27,000 | 13,770.00 |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 137,600 | 196,768.00 |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 155,400 | 261,072.00 |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 61,000 | 76,860.00 |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 34,350 | 30,743.25 |
| | ESR REIT | 57,552 | 18,128.88 |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 46,000 | 22,540.00 |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28,000 | 21,700.00 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 36,800 | 72,864.00 |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 10,000 | 4,850.00 |
| | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST | 172,038 | 167,737.05 |
| | KEPPEL DC REIT | 58,300 | 141,086.00 |
| | KEPPEL REIT | 98,900 | 99,889.00 |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T | 33,000 | 4,521.00 |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 121,000 | 212,960.00 |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 70,200 | 167,076.00 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 139,850 | 241,940.50 |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 83,000 | 72,210.00 |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 100,000 | 39,000.00 |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 29,800 | 98,638.00 |
| | SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT | 31,000 | 9,920.00 |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 20,000 | 13,800.00 |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 26,000 | 9,490.00 |
| | SPH REIT | 74,600 | 57,442.00 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 54,000 | 25,380.00 | |

| | | | | |
|--|----------------------|-----------|---------------|-----------------|
| | SUNTEC REIT | 147,500 | 181,425.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 2,142,945 | 2,789,145.50 | (210,859,399) |
| | イスラエルシェケル REIT 1 LTD | 8,000 | 132,000.00 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | 8,000 | 132,000.00 | (4,031,280) |
| | 合計 | | 5,478,909,884 | (5,478,909,884) |

(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 154銘柄 | 74.6% | 75.4% |
| カナダドル | 投資証券 25銘柄 | 1.9% | 1.9% |
| ユーロ | 投資証券 26銘柄 | 4.7% | 4.8% |
| 英ポンド | 投資証券 28銘柄 | 5.4% | 5.4% |
| オーストラリアドル | 投資証券 25銘柄 | 5.7% | 5.8% |
| ニュージーランドドル | 投資証券 5銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| 香港ドル | 投資証券 6銘柄 | 2.2% | 2.2% |
| シンガポールドル | 投資証券 29銘柄 | 3.8% | 3.8% |
| イスラエルシェケル | 投資証券 1銘柄 | 0.1% | 0.1% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年 4月27日現在)

| | |
|---------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 金銭信託 | 192,151,216 |
| コール・ローン | 196,989,558 |
| 国債証券 | 108,583,603,390 |
| 地方債証券 | 8,517,711,860 |
| 特殊債券 | 13,069,990,511 |
| 社債券 | 5,677,516,000 |
| 未収利息 | 289,194,993 |
| 前払費用 | 8,769,806 |
| 流動資産合計 | 136,535,927,334 |
| 資産合計 | 136,535,927,334 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 267,801,200 |

(2020年 4月27日現在)

| | |
|-------------|-----------------|
| 未払解約金 | 14,451,749 |
| 未払利息 | 568 |
| その他未払費用 | 65,632 |
| 流動負債合計 | 282,319,149 |
| 負債合計 | 282,319,149 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 105,756,496,620 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 30,497,111,565 |
| 元本等合計 | 136,253,608,185 |
| 純資産合計 | 136,253,608,185 |
| 負債純資産合計 | 136,535,927,334 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|---------------------------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 105,756,496,620口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.2884円 |
| | (10,000口当たりの純資産額 12,884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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| 項 目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項 目 | (2020年 4月27日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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)

| (2020年 4月27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 | 106,140,437,914円 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|-----------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 15,790,563,721円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,174,505,015円 |
| 2020年 4月27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) | 4,960,619,822円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 8,292,722,898円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,724,283,160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) | 723,543,579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) | 44,849,500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) | 169,123,013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) | 346,223,015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) | 355,076,247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) | 136,949,340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) | 250,983,539円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 120,216,127円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 3,623,380,687円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 1,332,579,445円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 618,268,109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) | 1,159,440,155円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 367,819,534円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 512,477,144円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 86,973,783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 | 46,310,563円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 3,099,040円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 5,101,208円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 1,062,845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> | 15,284,484,645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> | 6,538,002,991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> | 15,594,252,520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> | 223,691,964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> | 1,857,717,650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> | 1,979,603,373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> | 2,449,603,074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> | 9,079,019,613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) | 1,354,089,917円 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|---|------------------|
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 448,466,921円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 622,144,119円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 170,571,267円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 41,651,607円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,741,366,557円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,265,783,446円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 884,727,878円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 200,322,382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> | 304,049,534円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,571,268,063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> | 1,463,120,766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> | 4,046,048,431円 |
| 合計 | 105,756,496,620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 | 20,074,400 | |
| | 第404回利付国債(2年) | 20,000,000 | 20,079,400 | |
| | 第405回利付国債(2年) | 60,000,000 | 60,261,600 | |
| | 第407回利付国債(2年) | 20,000,000 | 20,094,200 | |
| | 第409回利付国債(2年) | 230,000,000 | 231,159,200 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第410回利付国債(2年) | 3,170,000,000 | 3,186,674,200 | |
| 第411回利付国債(2年) | 1,780,000,000 | 1,789,629,800 | |
| 第130回利付国債(5年) | 90,000,000 | 90,423,000 | |
| 第131回利付国債(5年) | 140,000,000 | 140,757,400 | |
| 第132回利付国債(5年) | 95,000,000 | 95,571,900 | |
| 第133回利付国債(5年) | 108,000,000 | 108,753,840 | |
| 第134回利付国債(5年) | 110,000,000 | 110,848,100 | |
| 第135回利付国債(5年) | 190,000,000 | 191,601,700 | |
| 第136回利付国債(5年) | 400,000,000 | 403,668,000 | |
| 第137回利付国債(5年) | 100,000,000 | 100,974,000 | |
| 第138回利付国債(5年) | 600,000,000 | 606,276,000 | |
| 第139回利付国債(5年) | 100,000,000 | 101,117,000 | |
| 第140回利付国債(5年) | 600,000,000 | 607,014,000 | |
| 第141回利付国債(5年) | 15,000,000 | 15,182,700 | |
| 第142回利付国債(5年) | 2,090,000,000 | 2,116,417,600 | |
| 第1回利付国債(40年) | 40,000,000 | 60,760,800 | |
| 第2回利付国債(40年) | 242,000,000 | 358,532,680 | |
| 第3回利付国債(40年) | 185,000,000 | 276,869,150 | |
| 第4回利付国債(40年) | 247,000,000 | 373,350,380 | |
| 第5回利付国債(40年) | 245,000,000 | 359,434,600 | |
| 第6回利付国債(40年) | 270,000,000 | 391,138,200 | |
| 第7回利付国債(40年) | 265,000,000 | 370,586,600 | |
| 第8回利付国債(40年) | 330,000,000 | 433,032,600 | |
| 第9回利付国債(40年) | 498,000,000 | 491,824,800 | |
| 第10回利付国債(40年) | 490,000,000 | 566,939,800 | |
| 第11回利付国債(40年) | 360,000,000 | 405,381,600 | |
| 第12回利付国債(40年) | 365,000,000 | 372,891,300 | |
| 第317回利付国債(10年) | 55,000,000 | 55,993,850 | |
| 第321回利付国債(10年) | 960,000,000 | 981,609,600 | |
| 第322回利付国債(10年) | 365,000,000 | 372,522,650 | |
| 第323回利付国債(10年) | 310,000,000 | 317,241,600 | |
| 第324回利付国債(10年) | 390,000,000 | 398,271,900 | |
| 第325回利付国債(10年) | 1,265,000,000 | 1,294,993,150 | |
| 第326回利付国債(10年) | 77,000,000 | 78,801,800 | |
| 第327回利付国債(10年) | 25,000,000 | 25,651,500 | |
| 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 | 2,092,909,700 | |
| 第330回利付国債(10年) | 1,285,000,000 | 1,328,265,950 | |
| 第332回利付国債(10年) | 793,000,000 | 815,854,260 | |
| 第333回利付国債(10年) | 815,000,000 | 840,085,700 | |
| 第334回利付国債(10年) | 315,000,000 | 325,259,550 | |
| 第335回利付国債(10年) | 50,000,000 | 51,495,500 | |
| 第336回利付国債(10年) | 340,000,000 | 350,750,800 | |
| 第337回利付国債(10年) | 120,000,000 | 122,670,000 | |
| 第338回利付国債(10年) | 805,000,000 | 827,837,850 | |
| 第339回利付国債(10年) | 785,000,000 | 808,432,250 | |
| 第340回利付国債(10年) | 770,000,000 | 794,124,100 | |
| 第341回利付国債(10年) | 857,000,000 | 880,207,560 | |
| 第342回利付国債(10年) | 890,000,000 | 904,302,300 | |
| 第343回利付国債(10年) | 1,110,000,000 | 1,128,603,600 | |
| 第344回利付国債(10年) | 1,051,000,000 | 1,069,350,460 | |
| 第345回利付国債(10年) | 938,000,000 | 955,024,700 | |
| 第346回利付国債(10年) | 640,000,000 | 651,820,800 | |
| 第347回利付国債(10年) | 430,000,000 | 438,238,800 | |
| 第348回利付国債(10年) | 755,000,000 | 769,692,300 | |
| 第349回利付国債(10年) | 690,000,000 | 703,613,700 | |
| 第350回利付国債(10年) | 980,000,000 | 999,168,800 | |
| 第351回利付国債(10年) | 570,000,000 | 581,029,500 | |
| 第352回利付国債(10年) | 650,000,000 | 662,129,000 | |
| 第353回利付国債(10年) | 800,000,000 | 814,304,000 | |
| 第354回利付国債(10年) | 1,035,000,000 | 1,052,626,050 | |
| 第355回利付国債(10年) | 860,000,000 | 873,854,600 | |
| 第356回利付国債(10年) | 850,000,000 | 862,852,000 | |
| 第357回利付国債(10年) | 1,635,000,000 | 1,657,955,400 | |
| 第2回利付国債(30年) | 510,000,000 | 632,634,600 | |
| 第4回利付国債(30年) | 300,000,000 | 391,908,000 | |
| 第5回利付国債(30年) | 290,000,000 | 359,768,200 | |
| 第7回利付国債(30年) | 474,000,000 | 600,771,300 | |
| 第9回利付国債(30年) | 100,000,000 | 116,380,000 | |
| 第10回利付国債(30年) | 555,000,000 | 625,645,950 | |
| 第11回利付国債(30年) | 430,000,000 | 518,588,600 | |
| 第12回利付国債(30年) | 590,000,000 | 744,521,000 | |

| | | | |
|---------------|-------------|-------------|--|
| 第14回利付国債(30年) | 742,000,000 | 971,188,960 | |
| 第16回利付国債(30年) | 465,000,000 | 618,998,700 | |
| 第18回利付国債(30年) | 450,000,000 | 589,225,500 | |
| 第19回利付国債(30年) | 490,000,000 | 643,624,800 | |
| 第21回利付国債(30年) | 345,000,000 | 455,610,450 | |
| 第22回利付国債(30年) | 315,000,000 | 426,598,200 | |
| 第23回利付国債(30年) | 329,000,000 | 446,999,140 | |
| 第24回利付国債(30年) | 310,000,000 | 422,526,900 | |
| 第25回利付国債(30年) | 300,000,000 | 400,203,000 | |
| 第26回利付国債(30年) | 363,000,000 | 491,491,110 | |
| 第27回利付国債(30年) | 440,000,000 | 606,570,800 | |
| 第28回利付国債(30年) | 386,000,000 | 535,204,440 | |
| 第29回利付国債(30年) | 177,000,000 | 243,716,610 | |
| 第30回利付国債(30年) | 472,000,000 | 644,818,080 | |
| 第31回利付国債(30年) | 315,000,000 | 427,054,950 | |
| 第32回利付国債(30年) | 390,000,000 | 539,463,600 | |
| 第33回利付国債(30年) | 378,000,000 | 503,446,860 | |
| 第34回利付国債(30年) | 457,000,000 | 630,189,290 | |
| 第35回利付国債(30年) | 390,000,000 | 524,358,900 | |
| 第36回利付国債(30年) | 100,000,000 | 135,063,000 | |
| 第37回利付国債(30年) | 495,000,000 | 660,523,050 | |
| 第38回利付国債(30年) | 370,000,000 | 487,323,300 | |
| 第39回利付国債(30年) | 170,000,000 | 228,126,400 | |
| 第40回利付国債(30年) | 340,000,000 | 449,531,000 | |
| 第41回利付国債(30年) | 310,000,000 | 403,598,300 | |
| 第42回利付国債(30年) | 220,000,000 | 286,750,200 | |
| 第43回利付国債(30年) | 315,000,000 | 411,506,550 | |
| 第44回利付国債(30年) | 290,000,000 | 379,279,400 | |
| 第45回利付国債(30年) | 355,000,000 | 448,134,250 | |
| 第46回利付国債(30年) | 345,000,000 | 435,845,400 | |
| 第47回利付国債(30年) | 330,000,000 | 425,333,700 | |
| 第48回利付国債(30年) | 345,000,000 | 428,490,000 | |
| 第49回利付国債(30年) | 335,000,000 | 416,311,200 | |
| 第50回利付国債(30年) | 385,000,000 | 422,121,700 | |
| 第51回利付国債(30年) | 405,000,000 | 394,012,350 | |
| 第52回利付国債(30年) | 333,000,000 | 340,136,190 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第53回利付国債(30年) | 197,000,000 | 206,237,330 | |
| 第54回利付国債(30年) | 65,000,000 | 71,312,800 | |
| 第55回利付国債(30年) | 425,000,000 | 466,624,500 | |
| 第56回利付国債(30年) | 390,000,000 | 428,516,400 | |
| 第57回利付国債(30年) | 505,000,000 | 555,282,850 | |
| 第58回利付国債(30年) | 400,000,000 | 439,596,000 | |
| 第59回利付国債(30年) | 400,000,000 | 429,268,000 | |
| 第60回利付国債(30年) | 360,000,000 | 405,900,000 | |
| 第61回利付国債(30年) | 315,000,000 | 338,417,100 | |
| 第62回利付国債(30年) | 115,000,000 | 117,370,150 | |
| 第63回利付国債(30年) | 380,000,000 | 377,533,800 | |
| 第64回利付国債(30年) | 335,000,000 | 332,376,950 | |
| 第65回利付国債(30年) | 295,000,000 | 292,672,450 | |
| 第56回利付国債(20年) | 818,000,000 | 856,486,900 | |
| 第59回利付国債(20年) | 1,455,000,000 | 1,527,735,450 | |
| 第61回利付国債(20年) | 1,215,000,000 | 1,256,686,650 | |
| 第64回利付国債(20年) | 1,025,000,000 | 1,097,867,250 | |
| 第65回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 1,097,866,800 | |
| 第69回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 1,111,177,800 | |
| 第70回利付国債(20年) | 780,000,000 | 863,857,800 | |
| 第72回利付国債(20年) | 753,000,000 | 828,721,680 | |
| 第74回利付国債(20年) | 664,000,000 | 734,589,840 | |
| 第75回利付国債(20年) | 490,000,000 | 544,880,000 | |
| 第78回利付国債(20年) | 590,000,000 | 653,389,600 | |
| 第82回利付国債(20年) | 620,000,000 | 696,663,000 | |
| 第84回利付国債(20年) | 850,000,000 | 955,153,500 | |
| 第85回利付国債(20年) | 645,000,000 | 731,939,550 | |
| 第88回利付国債(20年) | 742,000,000 | 855,281,140 | |
| 第89回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,929,200 | |
| 第90回利付国債(20年) | 580,000,000 | 668,467,400 | |
| 第92回利付国債(20年) | 734,000,000 | 845,435,880 | |
| 第93回利付国債(20年) | 632,000,000 | 726,894,800 | |
| 第95回利付国債(20年) | 305,000,000 | 359,097,850 | |
| 第97回利付国債(20年) | 677,000,000 | 796,003,060 | |
| 第99回利付国債(20年) | 693,000,000 | 813,297,870 | |
| 第100回利付国債(20年) | 207,000,000 | 245,562,030 | |

| | | | |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第101回利付国債(20年) | 355,000,000 | 426,795,200 | |
| 第102回利付国債(20年) | 457,000,000 | 551,955,460 | |
| 第105回利付国債(20年) | 390,000,000 | 463,245,900 | |
| 第106回利付国債(20年) | 370,000,000 | 442,627,300 | |
| 第107回利付国債(20年) | 378,000,000 | 450,530,640 | |
| 第108回利付国債(20年) | 390,000,000 | 458,027,700 | |
| 第109回利付国債(20年) | 340,000,000 | 400,475,800 | |
| 第111回利付国債(20年) | 386,000,000 | 466,646,980 | |
| 第113回利付国債(20年) | 427,000,000 | 513,920,120 | |
| 第114回利付国債(20年) | 363,000,000 | 438,438,660 | |
| 第116回利付国債(20年) | 200,000,000 | 244,376,000 | |
| 第118回利付国債(20年) | 200,000,000 | 241,068,000 | |
| 第119回利付国債(20年) | 295,000,000 | 349,577,950 | |
| 第120回利付国債(20年) | 200,000,000 | 232,936,000 | |
| 第121回利付国債(20年) | 255,000,000 | 305,691,450 | |
| 第122回利付国債(20年) | 330,000,000 | 392,165,400 | |
| 第123回利付国債(20年) | 80,000,000 | 97,833,600 | |
| 第124回利付国債(20年) | 190,000,000 | 230,333,200 | |
| 第125回利付国債(20年) | 205,000,000 | 253,712,100 | |
| 第126回利付国債(20年) | 180,000,000 | 218,856,600 | |
| 第127回利付国債(20年) | 145,000,000 | 174,725,000 | |
| 第128回利付国債(20年) | 215,000,000 | 259,803,850 | |
| 第129回利付国債(20年) | 190,000,000 | 227,481,300 | |
| 第130回利付国債(20年) | 135,000,000 | 161,956,800 | |
| 第131回利付国債(20年) | 560,000,000 | 665,464,800 | |
| 第132回利付国債(20年) | 300,000,000 | 357,315,000 | |
| 第133回利付国債(20年) | 190,000,000 | 228,499,700 | |
| 第134回利付国債(20年) | 200,000,000 | 241,094,000 | |
| 第135回利付国債(20年) | 295,000,000 | 352,129,700 | |
| 第136回利付国債(20年) | 120,000,000 | 141,822,000 | |
| 第137回利付国債(20年) | 45,000,000 | 53,833,050 | |
| 第138回利付国債(20年) | 25,000,000 | 29,305,250 | |
| 第139回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,685,000 | |
| 第140回利付国債(20年) | 530,000,000 | 635,395,800 | |
| 第141回利付国債(20年) | 270,000,000 | 324,353,700 | |
| 第142回利付国債(20年) | 110,000,000 | 133,520,200 | |

| | | | | |
|-------|------------------|----------------|-----------------|--|
| | 第143回利付国債(20年) | 170,000,000 | 202,458,100 | |
| | 第144回利付国債(20年) | 170,000,000 | 200,294,000 | |
| | 第145回利付国債(20年) | 200,000,000 | 241,204,000 | |
| | 第146回利付国債(20年) | 85,000,000 | 102,707,200 | |
| | 第147回利付国債(20年) | 400,000,000 | 478,840,000 | |
| | 第148回利付国債(20年) | 229,000,000 | 271,442,860 | |
| | 第149回利付国債(20年) | 695,000,000 | 824,958,050 | |
| | 第150回利付国債(20年) | 401,000,000 | 470,974,500 | |
| | 第151回利付国債(20年) | 730,000,000 | 837,448,700 | |
| | 第152回利付国債(20年) | 335,000,000 | 384,559,900 | |
| | 第153回利付国債(20年) | 227,000,000 | 264,287,020 | |
| | 第154回利付国債(20年) | 700,000,000 | 805,161,000 | |
| | 第155回利付国債(20年) | 330,000,000 | 369,771,600 | |
| | 第156回利付国債(20年) | 420,000,000 | 431,277,000 | |
| | 第157回利付国債(20年) | 375,000,000 | 372,956,250 | |
| | 第158回利付国債(20年) | 330,000,000 | 343,533,300 | |
| | 第159回利付国債(20年) | 448,000,000 | 473,432,960 | |
| | 第160回利付国債(20年) | 335,000,000 | 359,431,550 | |
| | 第161回利付国債(20年) | 610,000,000 | 644,038,000 | |
| | 第162回利付国債(20年) | 180,000,000 | 190,027,800 | |
| | 第163回利付国債(20年) | 720,000,000 | 760,017,600 | |
| | 第164回利付国債(20年) | 215,000,000 | 223,058,200 | |
| | 第165回利付国債(20年) | 560,000,000 | 580,770,400 | |
| | 第166回利付国債(20年) | 335,000,000 | 359,300,900 | |
| | 第167回利付国債(20年) | 500,000,000 | 518,115,000 | |
| | 第168回利付国債(20年) | 190,000,000 | 193,395,300 | |
| | 第169回利付国債(20年) | 630,000,000 | 629,426,700 | |
| | 第170回利付国債(20年) | 325,000,000 | 324,405,250 | |
| | 第171回利付国債(20年) | 425,000,000 | 424,209,500 | |
| | 国債証券合計 | 97,435,000,000 | 108,583,603,390 | |
| 地方債証券 | 第1回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 104,765,000 | |
| | 第1回東京都公募公債(30年) | 100,000,000 | 125,197,000 | |
| | 第6回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 109,682,000 | |
| | 第8回東京都公募公債(30年) | 400,000,000 | 530,400,000 | |
| | 第13回東京都公募公債(30年) | 500,000,000 | 652,665,000 | |
| | 第688回東京都公募公債 | 193,500,000 | 194,196,600 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第705回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,955,000 | |
| 第710回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,685,000 | |
| 平成24年度第1回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,888,000 | |
| 平成24年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000 | 102,142,000 | |
| 平成26年度第15回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,906,000 | |
| 平成29年度第6回北海道公募公債(5年) | 300,000,000 | 299,763,000 | |
| 第1回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 110,506,000 | |
| 第3回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 110,518,000 | |
| 第7回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 114,744,000 | |
| 第342回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 200,988,000 | |
| 第361回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 203,836,000 | |
| 第373回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,749,000 | |
| 第377回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,440,000 | |
| 平成22年度第5回京都府公募公債 | 110,000,000 | 110,884,400 | |
| 平成27年度第4回京都府公募公債 | 100,000,000 | 102,528,000 | |
| 平成29年度第12回京都府公募公債 | 300,000,000 | 300,129,000 | |
| 第5回兵庫県公募公債(15年) | 300,000,000 | 328,707,000 | |
| 第7回静岡県公募公債(30年) | 100,000,000 | 132,794,000 | |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 111,402,000 | |
| 平成22年度第12回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,629,000 | |
| 平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年) | 200,000,000 | 199,940,000 | |
| 平成25年度第11回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 102,582,000 | |
| 平成26年度第10回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 102,095,000 | |
| 第9回群馬県公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,001,000 | |
| 第111回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 203,732,000 | |
| 第112回共同発行市場公募地方債 | 150,000,000 | 152,740,500 | |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,734,000 | |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,911,000 | |
| 第118回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,238,000 | |
| 第137回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 204,728,000 | |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 504,850,000 | |
| 第1回名古屋市公募公債(20年) | 200,000,000 | 214,366,000 | |
| 第3回名古屋市公募公債(20年) | 100,000,000 | 110,107,000 | |
| 第1回京都市公募公債(30年) | 100,000,000 | 136,736,000 | |
| 第7回京都市公募公債(20年) | 100,000,000 | 118,947,000 | |

| | | | | |
|--------------------------------|--------------------------------|---------------|---------------|--|
| | 平成 2 9 年度第 5 回京都市公募公債 | 100,000,000 | 100,043,000 | |
| | 平成 2 6 年度第 1 7 回神戸市公募公債 | 100,000,000 | 101,236,000 | |
| | 第 4 回横浜市公募公債（ 2 0 年） | 100,000,000 | 109,829,000 | |
| | 第 9 回横浜市公募公債（ 2 0 年） | 100,000,000 | 113,947,000 | |
| | 第 1 4 回横浜市公募公債（ 2 0 年） | 100,000,000 | 117,510,000 | |
| | 第 4 7 回横浜市公募公債（ 5 年） | 100,000,000 | 100,041,000 | |
| | 平成 2 6 年度第 4 回札幌市公募公債（ 1 0 年） | 100,000,000 | 102,175,000 | |
| | 第 4 回川崎市 1 5 年公募公債 | 100,000,000 | 103,437,000 | |
| | 平成 2 4 年度第 2 回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 101,783,000 | |
| | 平成 2 3 年度第 9 回福岡市公募公債 | 147,000,000 | 149,775,360 | |
| | 平成 2 9 年度第 1 1 回福岡市公募公債（ 5 年） | 300,000,000 | 300,129,000 | |
| 地方債証券合計 | | 7,900,500,000 | 8,517,711,860 | |
| 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 | 215,334,000 | |
| | 第 1 5 回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 103,368,000 | |
| | 第 2 7 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 100,114,000 | |
| | 第 3 4 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 300,000,000 | 300,006,000 | |
| | 第 3 6 回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 114,899,000 | |
| | 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 | 303,675,000 | |
| | 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 | 101,765,000 | |
| | 第 9 回道路債券 | 100,000,000 | 131,877,000 | |
| | 第 1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 156,921,000 | |
| | 第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 456,636,000 | |
| | 第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 240,990,000 | |
| | 第 8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 237,196,000 | |
| | 第 8 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 136,232,000 | |
| | 第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 357,801,000 | |
| | 第 9 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 | 120,936,000 | |
| | 第 1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,475,000 | |
| 第 1 3 7 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 | 1,014,510,000 | | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,560,000 | |
| 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 | 305,691,000 | |
| 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 | 204,858,000 | |
| 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 | 306,885,000 | |
| 第2回地方公営企業等金融機構債券(20年) | 100,000,000 | 119,469,000 | |
| 第3回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 102,943,000 | |
| 第5回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 107,101,000 | |
| 第17回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 113,644,000 | |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 800,000,000 | 800,016,000 | |
| 第22回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 115,657,000 | |
| 第24回公営企業債券(20年) | 200,000,000 | 234,644,000 | |
| 第26回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 304,149,000 | |
| 第27回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 202,682,000 | |
| 第42回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,034,000 | |
| 第45回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 204,408,000 | |
| 第61回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,767,000 | |
| 第62回地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 410,244,000 | |
| 第63回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,391,000 | |
| 第67回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,180,000 | |
| 第15回首都高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 100,078,000 | |
| 第342回東京交通債券 | 100,000,000 | 104,857,000 | |
| 第51回政府保証関西国際空港債券 | 100,000,000 | 104,924,000 | |
| 第209回政府保証預金保険機構債 | 600,000,000 | 600,498,000 | |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 11,463,000 | 11,679,879 | |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 13,749,000 | 14,321,370 | |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 11,955,000 | 12,188,959 | |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 15,266,000 | 15,999,836 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 26,106,000 | 27,085,497 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 15,377,000 | 16,246,415 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 40,293,000 | 41,817,284 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 15,265,000 | 16,082,288 | |
| | 16,347,000 | 17,331,089 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | | | |
| 第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 10,510,000 | 10,593,344 | |
| 第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 12,390,000 | 12,543,512 | |
| 第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券 | 30,020,000 | 30,636,310 | |
| 第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 20,090,000 | 21,422,770 | |
| 第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,342,000 | 44,458,359 | |
| 第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 63,669,000 | 68,290,096 | |
| 第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,232,000 | 24,940,016 | |
| 第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 25,092,000 | 26,928,734 | |
| 第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 12,728,000 | 13,089,220 | |
| 第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 27,947,000 | 30,118,481 | |
| 第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 27,427,000 | 29,576,728 | |
| 第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 14,141,000 | 14,597,471 | |
| 第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 54,070,000 | 57,830,027 | |
| 第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 14,921,000 | 15,515,900 | |
| 第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 29,419,000 | 31,358,006 | |
| 第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 29,347,000 | 31,138,047 | |
| 第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,432,000 | 13,907,089 | |
| 第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 14,672,000 | 15,364,224 | |
| 第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 27,792,000 | 29,175,485 | |
| 第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,941,000 | 41,393,893 | |
| 第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 32,082,000 | 34,227,002 | |
| 第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 60,316,000 | 64,251,619 | |
| 第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 29,944,000 | 31,819,093 | |
| 第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,207,000 | 13,747,298 | |
| 第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 66,542,000 | 70,571,118 | |
| 第 5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 119,135,000 | |
| 第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,864,000 | 14,502,298 | |
| 第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,166,000 | 92,327,098 | |
| 第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 41,540,000 | 44,021,184 | |
| 第 5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 44,108,000 | 46,724,045 | |
| 第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,006,000 | 90,097,009 | |
| 第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 133,104,000 | 140,587,106 | |
| 第 6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 42,859,000 | 45,115,097 | |

| | | | | |
|-----|------------------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,633,000 | 50,909,024 | |
| | 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,608,000 | 104,184,282 | |
| | 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,724,000 | 91,251,860 | |
| | 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,888,000 | 51,681,949 | |
| | 第95回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 101,994,000 | |
| | 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,853,000 | 74,655,985 | |
| | 第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,087,000 | 90,499,028 | |
| | 第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 88,906,000 | 90,069,779 | |
| | 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,317,000 | 90,482,586 | |
| | 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 90,366,000 | 91,410,630 | |
| | 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 90,091,000 | 91,258,579 | |
| | 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 90,978,000 | 92,401,805 | |
| | 第130回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 237,836,000 | |
| | 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,080,000 | 95,633,260 | |
| | 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 26,118,000 | 26,954,820 | |
| | 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,946,000 | 30,308,198 | |
| | 第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 14,228,000 | 14,872,812 | |
| | 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 13,767,000 | 14,298,681 | |
| | 第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 29,662,000 | 31,097,937 | |
| | い第810号農林債 | 300,000,000 | 300,036,000 | |
| | 第12回国際協力機構債券 | 100,000,000 | 101,902,000 | |
| | 第35回東日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 200,168,000 | |
| | 第45回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 102,108,000 | |
| | 第20回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 102,458,000 | |
| | 第23回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 102,347,000 | |
| | 特殊債券合計 | 12,246,993,000 | 13,069,990,511 | |
| 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 | 199,976,000 | |
| | 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 | 199,978,000 | |
| | 第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,494,000 | |
| | 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 | 101,297,000 | |
| | 第30回東レ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,895,000 | |
| | 第7回株式会社クラレ無担保社債 | 100,000,000 | 99,537,000 | |
| | 第56回住友化学株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,952,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | 99,933,000 | |
| 第13回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 99,613,000 | |
| 第3回新日鐵住金株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,594,000 | |
| 第8回株式会社ジェイテクト無担保社債 | 100,000,000 | 99,838,000 | |
| 第16回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 102,078,000 | |
| 第63回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 113,236,000 | |
| 第47回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,819,000 | |
| 第69回株式会社クレディセゾン無担保社債 | 100,000,000 | 99,470,000 | |
| 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 | 115,052,000 | |
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 300,000,000 | 301,572,000 | |
| 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 | 100,007,000 | |
| 第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,330,000 | |
| 第8回住友信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 111,794,000 | |
| 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 | 100,625,000 | |
| 第24回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 101,416,000 | |
| 第9回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 111,418,000 | |
| 第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,050,000 | |
| 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 | 99,766,000 | |
| 第58回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 127,556,000 | |
| 第38回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,751,000 | |
| 第15回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 100,836,000 | |
| 第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 125,011,000 | |
| 第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 116,165,000 | |
| 第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 117,761,000 | |
| 第27回KDDI株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,261,000 | |
| 第547回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,396,000 | |
| 第507回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,836,000 | |
| 第512回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,022,000 | |
| 第527回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,047,000 | |
| 第308回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,310,000 | |

| | | | |
|-------------------------|---------------|-----------------|--|
| 第471回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,463,000 | |
| 第472回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,766,000 | |
| 第508回東北電力株式会社社債 | 200,000,000 | 200,784,000 | |
| 第253回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,508,000 | |
| 第328回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,546,000 | |
| 第11回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,367,000 | |
| 第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 200,000,000 | 200,304,000 | |
| 第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 206,938,000 | |
| 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 | 102,376,000 | |
| 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 | 99,772,000 | |
| 社債券合計 | 5,500,000,000 | 5,677,516,000 | |
| 合計 | | 135,848,821,761 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年4月27日現在)

| | |
|---------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 360,106,290 |
| 金銭信託 | 541,173,851 |
| コール・ローン | 554,800,539 |
| 国債証券 | 151,493,147,031 |
| 未収入金 | 603,699,765 |
| 未収利息 | 1,214,583,803 |
| 前払費用 | 24,133,730 |
| 流動資産合計 | 154,791,645,009 |
| 資産合計 | 154,791,645,009 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 24,888,000 |
| 未払利息 | 1,600 |
| その他未払費用 | 96,959 |
| 流動負債合計 | 24,986,559 |
| 負債合計 | 24,986,559 |
| 純資産の部 | |

(2020年 4月27日現在)

| | |
|-------------|-----------------|
| 元本等 | |
| 元本 | 84,222,011,513 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 70,544,646,937 |
| 元本等合計 | 154,766,658,450 |
| 純資産合計 | 154,766,658,450 |
| 負債純資産合計 | 154,791,645,009 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|---------------------------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 84,222,011,513口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.8376円 |
| | (10,000口当たりの純資産額 18,376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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|-----------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

| 項 目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 |
|----------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。 |

・ 金融商品の時価等に関する事項

| 項 目 | (2020年 4月27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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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）

| (2020年 4月27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 | 92,716,959,106円 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|---|-----------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 3,574,435,093円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 12,069,382,686円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 21,729,513,907円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 624,392,248円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,639,945,488円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 795,329,382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) | 129,517,808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) | 7,529,832円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,214,262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) | 86,193,258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) | 124,470,791円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 70,383,469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) | 145,145,162円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 22,380,605円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 71,914,897円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 92,768,309円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 72,967,241円 |
| 三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050 | 5,928,646円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 62,281,421円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 62,871,730円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 127,695,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 45,528,590円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 20,498,377円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド | 42,824,955円 |
| 三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド | 3,298,976円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型) | 392,647円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型) | 1,011,591円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型) | 493,390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> | 1,998,553,072円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定> | 65,167,979円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 9,424,682,581円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 4,879,897,341円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 10,719,433,443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> | 35,972,335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> | 89,375,303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> | 383,602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> | 618,347,209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> | 107,986,579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> | 1,121,811,212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> | 1,345,145,307円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用> | 1,698,058,269円 |

| (2020年 4月27日現在) | |
|---|-----------------|
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 5,414,915,975円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,474,614円 |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 9,204,968,865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) | 362,540,257円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 155,841,347円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 99,751,871円 |
| SMAM・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 |
| SMAM・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 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 128,196,997円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 486,454,418円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 144,536,692円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 41,239,972円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,161,186円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,191,024,810円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 18,574,156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> | 1,842,966,759円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 1,211,426,201円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 4,904,594,450円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 517,849,138円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 39,007,369円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 40,310,514円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 34,933,875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> | 43,080,625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> | 165,294,757円 |
| 合計 | 84,222,011,513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 | 3,034,218.75 | |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | 4,500,000.00 | 4,552,382.83 | |
| | | US TREASURY N/B 1.125 | 2,700,000.00 | 2,733,960.95 | |

| | | |
|-----------------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B 1.125 | 2,100,000.00 | 2,127,070.32 |
| US TREASURY N/B 1.25 | 3,600,000.00 | 3,636,562.50 |
| US TREASURY N/B 1.25 | 4,500,000.00 | 4,569,960.96 |
| US TREASURY N/B 1.25 | 3,000,000.00 | 3,093,984.39 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,400,000.00 | 2,430,187.51 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 4,052,812.52 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 4,110,000.00 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 3,093,281.25 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,500,000.00 | 3,620,859.37 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,500,000.00 | 2,590,625.00 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 3,110,156.25 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 1,000,000.00 | 1,047,734.38 |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,600,000.00 | 2,745,640.63 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,066,796.89 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,500,000.00 | 3,604,179.70 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,104,296.89 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,107,578.14 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 2,000,000.00 | 2,105,000.00 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 1,500,000.00 | 1,594,921.87 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 1,000,000.00 | 1,066,250.00 |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,500,000.00 | 3,799,960.95 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,000,000.00 | 2,063,593.76 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,400,000.00 | 3,508,640.64 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,500,000.00 | 3,621,406.25 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,000,000.00 | 4,143,437.52 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,121,640.64 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,125,859.39 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,137,578.14 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,400,000.00 | 2,561,062.51 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 6,050,000.00 | 6,465,937.50 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 5,000,000.00 | 5,359,375.00 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,219,609.39 |
| US TREASURY N/B 1.625 | 5,450,000.00 | 5,967,324.24 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 10,500,000.00 | 10,706,718.75 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,072,421.89 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,083,671.89 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1,800,000.00 | 1,852,875.00 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,400,000.00 | 2,472,937.51 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 4,100,000.00 | 4,227,804.70 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,094,453.14 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,097,968.75 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,108,984.39 |

| | | |
|-----------------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,121,875.00 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,700,000.00 | 2,820,234.37 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 11,800,000.00 | 12,490,484.43 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 850,000.00 | 900,601.56 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,400,000.00 | 2,597,625.00 |
| US TREASURY N/B 1.75 | 4,000,000.00 | 4,431,562.52 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 2,400,000.00 | 2,469,375.00 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 2,000,000.00 | 2,063,125.00 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,098,437.50 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,102,656.25 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,700,000.00 | 1,763,351.57 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 4,800,000.00 | 4,984,125.02 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,121,171.89 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,800,000.00 | 1,919,250.00 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,500,000.00 | 3,798,867.20 |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,200,000.00 | 3,477,500.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,060,468.75 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,072,890.64 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,080,859.39 |
| US TREASURY N/B 2 | 4,300,000.00 | 4,418,250.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,500,000.00 | 3,605,000.00 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,100,000.00 | 3,198,812.50 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,119,296.89 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,500,000.00 | 3,652,304.70 |
| US TREASURY N/B 2 | 5,000,000.00 | 5,224,609.40 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,800,000.00 | 3,984,656.25 |
| US TREASURY N/B 2 | 2,000,000.00 | 2,132,968.76 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,300,000.00 | 3,523,523.45 |
| US TREASURY N/B 2 | 2,500,000.00 | 2,672,070.32 |
| US TREASURY N/B 2 | 3,500,000.00 | 3,769,882.83 |
| US TREASURY N/B 2 | 4,300,000.00 | 4,656,429.70 |
| US TREASURY N/B 2 | 5,000,000.00 | 5,484,765.65 |
| US TREASURY N/B 2 | 1,000,000.00 | 1,206,484.38 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 1,700,000.00 | 1,739,046.87 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,100,625.00 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,081,796.89 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,095,859.39 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,500,000.00 | 4,673,320.33 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,122,812.50 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,198,750.00 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,100,000.00 | 3,300,289.07 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 2,000,000.00 | 2,137,812.50 |
| US TREASURY N/B 2.125 | 6,500,000.00 | 6,957,031.25 |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,500,000.00 | 3,764,960.95 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,313,125.00 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 1,800,000.00 | 1,944,562.50 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,900,000.00 | 5,323,007.83 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,900,000.00 | 4,289,695.33 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,000,000.00 | 3,058,359.39 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,500,000.00 | 4,595,273.46 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,800,000.00 | 2,873,281.26 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,300,000.00 | 4,469,984.37 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,000,000.00 | 3,211,875.00 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,200,000.00 | 2,359,671.88 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,800,000.00 | 4,090,937.50 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 1,500,000.00 | 1,626,914.07 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 6,300,000.00 | 6,837,960.96 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,100,000.00 | 3,372,218.75 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,000,000.00 | 4,398,125.00 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,700,000.00 | 2,982,867.20 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,400,000.00 | 4,914,593.77 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,200,000.00 | 4,723,687.50 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,400,000.00 | 4,961,687.50 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,850,000.00 | 3,534,890.62 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,500,000.00 | 4,426,269.54 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 3,000,000.00 | 3,059,062.50 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 2,000,000.00 | 2,043,281.26 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 3,600,000.00 | 3,745,125.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 1,200,000.00 | 1,269,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 3,700,000.00 | 3,990,218.75 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 5,600,000.00 | 6,083,437.52 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 4,900,000.00 | 5,533,937.50 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 5,200,000.00 | 6,025,500.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 1,200,000.00 | 1,557,562.49 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 1,900,000.00 | 1,973,773.44 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,500,000.00 | 3,642,734.37 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,000,000.00 | 5,364,062.50 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,700,000.00 | 6,195,632.84 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,400,000.00 | 3,742,390.64 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 1,400,000.00 | 1,565,484.38 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 4,100,000.00 | 5,271,222.64 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 2,900,000.00 | 3,750,062.50 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 4,100,000.00 | 5,311,421.87 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 500,000.00 | 512,968.75 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,110,937.52 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,118,437.52 |
| US TREASURY N/B 2.625 | 3,000,000.00 | 3,117,187.50 |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,267,187.52 |
| US TREASURY N/B 2.625 | 2,300,000.00 | 2,551,742.19 |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,800,000.00 | 5,388,750.00 |
| US TREASURY N/B 2.625 | 6,300,000.00 | 7,412,343.75 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,000,000.00 | 4,133,125.00 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 1,400,000.00 | 1,449,109.38 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,900,000.00 | 3,115,007.82 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,159,218.76 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 3,800,000.00 | 4,111,718.75 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,200,000.00 | 4,560,609.39 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 5,100,000.00 | 5,564,578.12 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,228,125.00 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 5,000,000.00 | 5,601,562.50 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,100,000.00 | 2,359,218.75 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,800,000.00 | 5,610,750.00 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,638,125.00 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,800,000.00 | 3,695,781.26 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 3,800,000.00 | 5,188,484.39 |
| US TREASURY N/B 2.75 | 1,500,000.00 | 2,052,421.87 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000.00 | 4,164,375.00 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000.00 | 4,357,500.00 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,000,000.00 | 2,182,812.50 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,200,000.00 | 2,471,734.38 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 1,100,000.00 | 1,237,500.00 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,500,000.00 | 2,837,109.37 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000.00 | 4,733,437.52 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 5,500,000.00 | 6,536,835.96 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,000,000.00 | 4,048,593.75 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000.00 | 5,489,687.52 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,600,000.00 | 4,997,250.00 |
| US TREASURY N/B 2.875 | 900,000.00 | 1,276,453.12 |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000.00 | 4,554,687.52 |
| US TREASURY N/B 3 | 3,100,000.00 | 3,533,515.62 |
| US TREASURY N/B 3 | 800,000.00 | 1,096,718.75 |
| US TREASURY N/B 3 | 3,500,000.00 | 4,867,187.50 |
| US TREASURY N/B 3 | 3,000,000.00 | 4,191,796.89 |
| US TREASURY N/B 3 | 3,700,000.00 | 5,195,609.37 |
| US TREASURY N/B 3 | 2,500,000.00 | 3,554,101.57 |
| US TREASURY N/B 3 | 2,200,000.00 | 3,130,703.13 |
| US TREASURY N/B 3 | 3,100,000.00 | 4,433,968.75 |
| US TREASURY N/B 3 | 5,400,000.00 | 7,762,921.90 |

| | | | |
|-------|-----------------------|----------------|------------------------------------|
| | US TREASURY N/B 3 | 3,800,000.00 | 5,490,703.14 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3,000,000.00 | 3,094,453.14 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 5,700,000.00 | 6,918,820.34 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 1,100,000.00 | 1,531,578.12 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 1,000,000.00 | 1,394,531.25 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 2,300,000.00 | 3,216,765.62 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 3,800,000.00 | 5,379,671.89 |
| | US TREASURY N/B 3.125 | 2,400,000.00 | 3,515,062.51 |
| | US TREASURY N/B 3.375 | 3,000,000.00 | 4,398,515.64 |
| | US TREASURY N/B 3.375 | 3,100,000.00 | 4,759,226.57 |
| | US TREASURY N/B 3.5 | 800,000.00 | 1,157,531.24 |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 2,400,000.00 | 3,619,687.51 |
| | US TREASURY N/B 3.625 | 3,600,000.00 | 5,461,312.50 |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 1,500,000.00 | 2,267,578.12 |
| | US TREASURY N/B 3.75 | 2,700,000.00 | 4,153,570.32 |
| | US TREASURY N/B 3.875 | 1,500,000.00 | 2,284,453.12 |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 1,000,000.00 | 1,576,484.38 |
| | US TREASURY N/B 4.25 | 600,000.00 | 957,726.56 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 500,000.00 | 790,390.62 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 700,000.00 | 1,124,621.09 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,400,000.00 | 2,255,093.75 |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,800,000.00 | 2,934,843.75 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 750,000.00 | 1,166,250.00 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 200,000.00 | 321,070.31 |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 1,000,000.00 | 1,626,718.75 |
| | US TREASURY N/B 4.625 | 1,600,000.00 | 2,645,875.00 |
| | US TREASURY N/B 4.75 | 1,500,000.00 | 2,543,437.50 |
| | US TREASURY N/B 5 | 500,000.00 | 832,675.78 |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 500,000.00 | 696,601.56 |
| | US TREASURY N/B 5.375 | 320,000.00 | 480,325.00 |
| | US TREASURY N/B 5.5 | 500,000.00 | 701,328.12 |
| | US TREASURY N/B 6 | 1,000,000.00 | 1,319,609.38 |
| | US TREASURY N/B 6.125 | 1,000,000.00 | 1,417,109.38 |
| | US TREASURY N/B 6.25 | 800,000.00 | 957,437.50 |
| | US TREASURY N/B 6.5 | 500,000.00 | 695,429.69 |
| | US TREASURY N/B 8 | 1,300,000.00 | 1,457,218.75 |
| | 米ドル 小計 | 636,870,000.00 | 719,386,791.11 (77,406,018,723) |
| カナダドル | CANADA-GOV'T 0.5 | 2,000,000.00 | 2,006,700.00 |
| | CANADA-GOV'T 0.75 | 500,000.00 | 500,105.00 |
| | CANADA-GOV'T 0.75 | 2,000,000.00 | 2,007,366.00 |
| | CANADA-GOV'T 0.75 | 2,000,000.00 | 2,011,600.00 |

| | | | |
|--------|--------------------|----------------|-----------------------------------|
| | CANADA-GOV'T 1 | 3,000,000.00 | 3,047,040.00 |
| | CANADA-GOV'T 1 | 1,300,000.00 | 1,347,099.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.25 | 300,000.00 | 319,620.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,000,000.00 | 2,072,600.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,046,020.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,063,050.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.75 | 1,100,000.00 | 1,144,396.00 |
| | CANADA-GOV'T 2 | 900,000.00 | 1,006,650.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,000,000.00 | 1,070,070.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,400,000.00 | 1,529,248.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 600,000.00 | 691,620.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.5 | 2,100,000.00 | 2,277,492.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 1,800,000.00 | 1,891,080.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 1,100,000.00 | 1,514,458.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 500,000.00 | 769,470.00 |
| | CANADA-GOV'T 3.25 | 1,000,000.00 | 1,031,950.00 |
| | CANADA-GOV'T 3.5 | 1,500,000.00 | 2,264,550.00 |
| | CANADA-GOV'T 4 | 1,500,000.00 | 2,305,095.00 |
| | CANADA-GOV'T 5 | 1,450,000.00 | 2,360,643.50 |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 250,000.00 | 364,762.50 |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 500,000.00 | 807,740.00 |
| | CANADA-GOV'T 8 | 700,000.00 | 1,065,155.00 |
| | カナダドル 小計 | 32,500,000.00 | 37,515,580.00 (2,861,313,286) |
| メキシコペソ | MEXICAN BONOS 10 | 32,000,000.00 | 37,456,960.00 |
| | MEXICAN BONOS 5.75 | 20,000,000.00 | 19,697,400.00 |
| | MEXICAN BONOS 6.5 | 52,000,000.00 | 53,170,384.80 |
| | MEXICAN BONOS 7.5 | 25,000,000.00 | 26,382,800.00 |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 6,000,000.00 | 6,294,351.60 |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 11,000,000.00 | 11,402,211.70 |
| | MEXICAN BONOS 8 | 27,000,000.00 | 29,326,590.00 |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 16,000,000.00 | 17,728,320.00 |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 40,000,000.00 | 42,487,032.00 |
| | メキシコペソ 小計 | 229,000,000.00 | 243,946,050.10 (1,051,407,475) |
| ユーロ | BELGIAN 0326 4 | 700,000.00 | 1,014,006.00 |
| | BELGIAN 0.8 | 800,000.00 | 843,752.00 |
| | BELGIAN 0.8 | 700,000.00 | 744,947.00 |
| | BELGIAN 0.8 | 500,000.00 | 533,840.00 |
| | BELGIAN 0291 5.5 | 2,000,000.00 | 2,883,440.00 |
| | BELGIAN 0304 5 | 1,600,000.00 | 2,684,208.00 |
| | BELGIAN 0308 4 | 700,000.00 | 760,935.00 |
| | BELGIAN 0320 4.25 | 1,200,000.00 | 2,068,248.00 |

| | | |
|-------------------|--------------|--------------|
| BELGIAN 0321 4.25 | 2,300,000.00 | 2,455,158.00 |
| BELGIAN 0324 4.5 | 1,000,000.00 | 1,279,680.00 |
| BELGIAN 0325 4.25 | 1,700,000.00 | 1,896,962.00 |
| BELGIAN 0328 2.25 | 1,500,000.00 | 1,628,205.00 |
| BELGIAN 0332 2.6 | 500,000.00 | 561,570.00 |
| BELGIAN 0333 3 | 700,000.00 | 962,962.00 |
| BELGIAN 0338 0.5 | 1,000,000.00 | 1,036,310.00 |
| BELGIAN 0338 2.25 | 500,000.00 | 735,805.00 |
| BELGIAN 0344 1.45 | 400,000.00 | 465,964.00 |
| BELGIAN 0347 0.9 | 800,000.00 | 862,568.00 |
| BELGIAN 0348 1.7 | 300,000.00 | 379,680.00 |
| BELGIAN 1 | 1,400,000.00 | 1,501,262.00 |
| BELGIAN 1 | 1,000,000.00 | 1,092,390.00 |
| BELGIAN 1.25 | 400,000.00 | 452,260.00 |
| BELGIAN 1.6 | 850,000.00 | 1,047,829.00 |
| BELGIAN 1.9 | 500,000.00 | 622,920.00 |
| BELGIAN 2.15 | 500,000.00 | 751,935.00 |
| BELGIAN 3.75 | 800,000.00 | 1,383,968.00 |
| BTPS 0.05 | 1,000,000.00 | 995,300.00 |
| BTPS 0.35 | 1,500,000.00 | 1,490,835.00 |
| BTPS 0.35 | 500,000.00 | 476,965.00 |
| BTPS 0.45 | 1,500,000.00 | 1,497,000.00 |
| BTPS 0.65 | 2,000,000.00 | 1,972,360.00 |
| BTPS 0.85 | 700,000.00 | 667,464.00 |
| BTPS 0.9 | 2,250,000.00 | 2,249,617.50 |
| BTPS 0.95 | 2,000,000.00 | 1,997,880.00 |
| BTPS 0.95 | 2,000,000.00 | 1,997,940.00 |
| BTPS 1 | 1,000,000.00 | 1,002,700.00 |
| BTPS 1.2 | 1,000,000.00 | 1,006,020.00 |
| BTPS 1.25 | 1,600,000.00 | 1,571,344.00 |
| BTPS 1.35 | 2,000,000.00 | 2,016,580.00 |
| BTPS 1.45 | 2,000,000.00 | 2,024,400.00 |
| BTPS 1.45 | 1,800,000.00 | 1,811,394.00 |
| BTPS 1.45 | 1,000,000.00 | 1,002,470.00 |
| BTPS 1.5 | 2,700,000.00 | 2,711,097.00 |
| BTPS 1.6 | 1,200,000.00 | 1,205,892.00 |
| BTPS 1.65 | 1,700,000.00 | 1,649,153.00 |
| BTPS 1.85 | 1,000,000.00 | 1,024,580.00 |
| BTPS 2 | 1,300,000.00 | 1,337,154.00 |
| BTPS 2 | 1,600,000.00 | 1,638,896.00 |
| BTPS 2.05 | 1,500,000.00 | 1,539,660.00 |
| BTPS 2.1 | 1,000,000.00 | 1,032,460.00 |
| BTPS 2.15 | 500,000.00 | 510,640.00 |

| | | | |
|-----------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 2.2 | 1,000,000.00 | 1,037,270.00 | |
| BTPS 2.25 | 1,200,000.00 | 1,209,300.00 | |
| BTPS 2.3 | 600,000.00 | 612,846.00 | |
| BTPS 2.45 | 1,100,000.00 | 1,144,660.00 | |
| BTPS 2.45 | 400,000.00 | 384,160.00 | |
| BTPS 2.5 | 600,000.00 | 630,810.00 | |
| BTPS 2.5 | 1,100,000.00 | 1,159,521.00 | |
| BTPS 2.7 | 1,550,000.00 | 1,584,642.50 | |
| BTPS 2.8 | 300,000.00 | 324,615.00 | |
| BTPS 2.8 | 900,000.00 | 909,972.00 | |
| BTPS 2.95 | 1,000,000.00 | 1,084,710.00 | |
| BTPS 3 | 3,500,000.00 | 3,849,895.00 | |
| BTPS 3.1 | 700,000.00 | 770,721.00 | |
| BTPS 3.25 | 1,500,000.00 | 1,677,675.00 | |
| BTPS 3.35 | 850,000.00 | 974,516.50 | |
| BTPS 3.45 | 1,400,000.00 | 1,619,758.00 | |
| BTPS 3.5 | 1,900,000.00 | 2,172,878.00 | |
| BTPS 3.75 | 2,000,000.00 | 2,061,540.00 | |
| BTPS 3.75 | 2,200,000.00 | 2,282,236.00 | |
| BTPS 3.75 | 2,000,000.00 | 2,203,500.00 | |
| BTPS 3.85 | 400,000.00 | 494,380.00 | |
| BTPS 4 | 1,600,000.00 | 1,971,520.00 | |
| BTPS 4.5 | 2,300,000.00 | 2,536,693.00 | |
| BTPS 4.5 | 3,000,000.00 | 3,370,620.00 | |
| BTPS 4.5 | 1,800,000.00 | 2,100,186.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,600,000.00 | 2,737,904.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,500,000.00 | 2,794,175.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,500,000.00 | 3,079,850.00 | |
| BTPS 4.75 | 1,600,000.00 | 2,203,568.00 | |
| BTPS 5 | 2,000,000.00 | 2,151,060.00 | |
| BTPS 5 | 1,000,000.00 | 1,168,970.00 | |
| BTPS 5 | 2,070,000.00 | 2,776,946.40 | |
| BTPS 5 | 1,800,000.00 | 2,506,590.00 | |
| BTPS 5 | 1,700,000.00 | 2,371,551.00 | |
| BTPS 5.5 | 1,200,000.00 | 1,326,024.00 | |
| BTPS 5.5 | 2,000,000.00 | 2,223,100.00 | |
| BTPS 5.75 | 1,700,000.00 | 2,382,346.00 | |
| BTPS 6 | 2,200,000.00 | 3,066,954.00 | |
| BTPS 6.5 | 1,700,000.00 | 2,273,121.00 | |
| BTPS 7.25 | 400,000.00 | 539,952.00 | |
| BTPS 9 | 300,000.00 | 381,285.00 | |
| BUNDESÖBL-173 0 | 2,200,000.00 | 2,213,090.00 | |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| BUNDESUBL-174 0 | 3,000,000.00 | 3,030,450.00 |
| BUNDESUBL-176 0 | 2,000,000.00 | 2,034,940.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 2,400,000.00 | 2,500,368.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 500,000.00 | 524,215.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 300,000.00 | 308,400.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 1,800,000.00 | 1,910,754.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 2,900,000.00 | 3,101,405.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 1,900,000.00 | 2,035,831.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 2,500,000.00 | 2,645,775.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 1,400,000.00 | 1,496,656.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 1,500,000.00 | 1,624,215.00 |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 2,000,000.00 | 2,173,400.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 1,300,000.00 | 1,396,382.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 2,050,000.00 | 2,236,427.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.25 | 1,250,000.00 | 1,740,375.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 500,000.00 | 531,495.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1,300,000.00 | 1,388,686.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,000,000.00 | 2,181,140.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 2,200,000.00 | 2,319,020.00 |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 3,000,000.00 | 3,284,820.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2 | 1,500,000.00 | 1,636,155.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.25 | 1,400,000.00 | 1,455,902.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,200,000.00 | 3,658,138.00 |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,100,000.00 | 3,586,779.00 |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 1,200,000.00 | 2,142,828.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 1,800,000.00 | 3,122,640.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 950,000.00 | 1,792,099.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,600,000.00 | 2,307,504.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,400,000.00 | 2,444,470.00 |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,150,000.00 | 2,339,962.50 |
| DEUTSCHLAND REP 5.5 | 900,000.00 | 1,488,051.00 |
| DEUTSCHLAND REP 5.625 | 1,000,000.00 | 1,487,010.00 |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,200,000.00 | 1,510,008.00 |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 500,000.00 | 834,480.00 |
| DEUTSCHLAND REP 6.5 | 1,000,000.00 | 1,521,140.00 |
| FINNISH GOV'T 0 | 400,000.00 | 404,396.00 |
| FINNISH GOV'T 0.5 | 400,000.00 | 420,192.00 |
| FINNISH GOV'T 0.5 | 800,000.00 | 841,376.00 |
| FINNISH GOV'T 0.75 | 500,000.00 | 540,425.00 |
| FINNISH GOV'T 1.125 | 200,000.00 | 227,790.00 |
| FINNISH GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,058,910.00 |
| FINNISH GOV'T 1.625 | 1,000,000.00 | 1,051,870.00 |
| FINNISH GOV'T 2 | 1,000,000.00 | 1,098,340.00 |

| | | |
|---------------------|--------------|--------------|
| FINNISH GOV'T 2.625 | 500,000.00 | 760,230.00 |
| FINNISH GOV'T 2.75 | 600,000.00 | 741,822.00 |
| FINNISH GOV'T 3.5 | 1,000,000.00 | 1,038,920.00 |
| FINNISH GOV'T 4 | 1,000,000.00 | 1,229,270.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 1,400,000.00 | 1,407,126.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,000,000.00 | 2,020,420.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,200,000.00 | 2,225,256.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,000,000.00 | 2,029,760.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 4,000,000.00 | 4,069,120.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 1,200,000.00 | 1,220,160.00 |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,000,000.00 | 1,996,240.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.25 | 2,400,000.00 | 2,470,800.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 2,900,000.00 | 3,026,498.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 1,500,000.00 | 1,568,910.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 3,300,000.00 | 3,456,915.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.75 | 2,500,000.00 | 2,671,600.00 |
| FRANCE O.A.T. 0.75 | 1,700,000.00 | 1,819,000.00 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 2,050,000.00 | 2,197,702.50 |
| FRANCE O.A.T. 1 | 2,500,000.00 | 2,706,400.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.25 | 1,700,000.00 | 1,929,993.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.25 | 2,400,000.00 | 2,734,920.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.5 | 3,650,000.00 | 4,215,421.50 |
| FRANCE O.A.T. 1.5 | 1,400,000.00 | 1,714,160.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 3,000,000.00 | 3,210,780.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 2,300,000.00 | 2,527,240.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 1,500,000.00 | 1,859,970.00 |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 800,000.00 | 1,105,528.00 |
| FRANCE O.A.T. 2 | 1,900,000.00 | 2,559,300.00 |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 1,900,000.00 | 2,033,570.00 |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 3,400,000.00 | 3,774,884.00 |
| FRANCE O.A.T. 2.5 | 3,500,000.00 | 4,367,090.00 |
| FRANCE O.A.T. 2.75 | 2,550,000.00 | 3,109,189.50 |
| FRANCE O.A.T. 3 | 5,000,000.00 | 5,354,350.00 |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 2,500,000.00 | 2,642,575.00 |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 2,200,000.00 | 3,566,596.00 |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 2,500,000.00 | 3,066,225.00 |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 3,400,000.00 | 3,542,936.00 |
| FRANCE O.A.T. 4 | 2,000,000.00 | 3,276,280.00 |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,370,000.00 | 2,762,728.30 |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,400,000.00 | 2,972,942.00 |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 3,000,000.00 | 3,502,050.00 |
| FRANCE O.A.T. 4.5 | 2,900,000.00 | 5,220,348.00 |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| FRANCE O.A.T. 4.75 | 2,200,000.00 | 3,646,830.00 |
| FRANCE O.A.T. 5.5 | 2,750,000.00 | 4,124,367.50 |
| FRANCE O.A.T. 5.75 | 2,100,000.00 | 3,556,749.00 |
| FRANCE O.A.T. 6 | 3,000,000.00 | 4,046,580.00 |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 600,000.00 | 762,804.00 |
| IRISH GOVT 0 | 400,000.00 | 403,432.00 |
| IRISH GOVT 0.8 | 700,000.00 | 715,848.00 |
| IRISH GOVT 0.9 | 700,000.00 | 743,715.00 |
| IRISH GOVT 1 | 1,000,000.00 | 1,062,310.00 |
| IRISH GOVT 1.1 | 600,000.00 | 648,288.00 |
| IRISH GOVT 1.5 | 400,000.00 | 467,812.00 |
| IRISH GOVT 1.7 | 300,000.00 | 352,554.00 |
| IRISH GOVT 2 | 1,000,000.00 | 1,289,650.00 |
| IRISH GOVT 2.4 | 600,000.00 | 726,798.00 |
| IRISH GOVT 3.4 | 500,000.00 | 570,835.00 |
| IRISH GOVT 3.9 | 500,000.00 | 561,250.00 |
| IRISH GOVT 5.4 | 800,000.00 | 1,015,976.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0 | 1,800,000.00 | 1,818,216.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0 | 1,000,000.00 | 1,021,210.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 1,000,000.00 | 1,039,890.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 1,300,000.00 | 1,362,062.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.5 | 1,200,000.00 | 1,271,292.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.5 | 300,000.00 | 330,810.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.75 | 900,000.00 | 974,349.00 |
| NETHERLANDS GOVT 0.75 | 1,000,000.00 | 1,089,010.00 |
| NETHERLANDS GOVT 1.75 | 1,600,000.00 | 1,721,216.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2 | 1,000,000.00 | 1,108,940.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.25 | 1,500,000.00 | 1,595,625.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 1,000,000.00 | 1,338,730.00 |
| NETHERLANDS GOVT 2.75 | 1,200,000.00 | 2,067,552.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.25 | 800,000.00 | 837,448.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 700,000.00 | 783,643.00 |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 1,300,000.00 | 2,366,533.00 |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,100,000.00 | 1,855,194.00 |
| NETHERLANDS GOVT 5.5 | 700,000.00 | 1,019,333.00 |
| REP OF AUSTRIA 0 | 1,100,000.00 | 1,116,874.00 |
| REP OF AUSTRIA 0.5 | 800,000.00 | 838,032.00 |
| REP OF AUSTRIA 0.5 | 850,000.00 | 893,188.50 |
| REP OF AUSTRIA 0.75 | 900,000.00 | 958,230.00 |
| REP OF AUSTRIA 0.75 | 700,000.00 | 747,404.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.2 | 1,000,000.00 | 1,084,200.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.5 | 200,000.00 | 288,292.00 |
| REP OF AUSTRIA 1.5 | 400,000.00 | 518,604.00 |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| REP OF AUSTRIA 1.65 | 1,100,000.00 | 1,201,563.00 | |
| REP OF AUSTRIA 1.75 | 1,000,000.00 | 1,078,130.00 | |
| REP OF AUSTRIA 2.4 | 600,000.00 | 788,538.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.15 | 600,000.00 | 1,005,756.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.4 | 1,100,000.00 | 1,211,859.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.5 | 1,000,000.00 | 1,056,600.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.65 | 1,000,000.00 | 1,083,690.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.8 | 700,000.00 | 1,581,258.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.15 | 1,300,000.00 | 2,160,847.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.85 | 500,000.00 | 652,530.00 | |
| REP OF AUSTRIA 6.25 | 1,000,000.00 | 1,463,370.00 | |
| SPANISH GOV'T 0 | 500,000.00 | 488,880.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.25 | 1,000,000.00 | 993,390.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.4 | 2,000,000.00 | 2,013,660.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.45 | 500,000.00 | 503,985.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.75 | 2,000,000.00 | 2,019,020.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.3 | 2,700,000.00 | 2,807,352.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.4 | 2,000,000.00 | 2,091,220.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.4 | 1,600,000.00 | 1,673,680.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.45 | 600,000.00 | 628,956.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.45 | 2,900,000.00 | 3,045,116.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.5 | 1,200,000.00 | 1,262,688.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.6 | 2,200,000.00 | 2,320,648.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.85 | 400,000.00 | 433,264.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.95 | 1,200,000.00 | 1,294,248.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.95 | 1,700,000.00 | 1,863,608.00 | |
| SPANISH GOV'T 2.15 | 2,000,000.00 | 2,172,720.00 | |
| SPANISH GOV'T 2.35 | 1,700,000.00 | 1,953,385.00 | |
| SPANISH GOV'T 2.7 | 850,000.00 | 1,059,057.50 | |
| SPANISH GOV'T 2.75 | 2,100,000.00 | 2,316,552.00 | |
| SPANISH GOV'T 2.9 | 1,400,000.00 | 1,793,456.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.45 | 900,000.00 | 1,357,533.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.8 | 1,900,000.00 | 2,158,685.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.2 | 1,650,000.00 | 2,375,406.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.4 | 2,000,000.00 | 2,285,940.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.65 | 1,800,000.00 | 2,184,984.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.7 | 1,500,000.00 | 2,388,330.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.8 | 1,500,000.00 | 1,750,185.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.9 | 1,500,000.00 | 2,420,115.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.15 | 1,500,000.00 | 2,030,610.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.15 | 1,200,000.00 | 2,077,116.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.4 | 2,250,000.00 | 2,570,805.00 | |

| | | | |
|-------|--------------------|----------------|------------------------------------|
| | SPANISH GOV'T 5.5 | 2,700,000.00 | 2,850,228.00 |
| | SPANISH GOV'T 5.75 | 1,500,000.00 | 2,311,950.00 |
| | SPANISH GOV'T 5.85 | 2,200,000.00 | 2,423,740.00 |
| | SPANISH GOV'T 5.9 | 500,000.00 | 660,300.00 |
| | SPANISH GOV'T 6 | 2,200,000.00 | 3,149,586.00 |
| | ユーロ 小計 | 389,840,000.00 | 462,342,377.70 (53,788,912,221) |
| 英bond | UK TSY GILT 0.5 | 1,800,000.00 | 1,817,784.00 |
| | UK TSY GILT 0.625 | 1,000,000.00 | 1,023,220.00 |
| | UK TSY GILT 0.75 | 750,000.00 | 765,892.50 |
| | UK TSY GILT 0.875 | 2,000,000.00 | 2,118,020.00 |
| | UK TSY GILT 1 | 1,300,000.00 | 1,345,097.00 |
| | UK TSY GILT 1.25 | 1,000,000.00 | 1,078,680.00 |
| | UK TSY GILT 1.5 | 1,000,000.00 | 1,084,610.00 |
| | UK TSY GILT 1.5 | 1,700,000.00 | 2,076,448.00 |
| | UK TSY GILT 1.625 | 550,000.00 | 874,450.50 |
| | UK TSY GILT 1.625 | 2,000,000.00 | 2,243,380.00 |
| | UK TSY GILT 1.625 | 300,000.00 | 402,975.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 1,200,000.00 | 1,247,508.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 1,500,000.00 | 1,786,140.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 750,000.00 | 973,192.50 |
| | UK TSY GILT 2 | 1,100,000.00 | 1,212,706.00 |
| | UK TSY GILT 2.25 | 2,700,000.00 | 2,895,966.00 |
| | UK TSY GILT 2.5 | 1,600,000.00 | 2,950,928.00 |
| | UK TSY GILT 2.75 | 1,300,000.00 | 1,448,148.00 |
| | UK TSY GILT 3.25 | 1,600,000.00 | 2,518,624.00 |
| | UK TSY GILT 3.5 | 1,650,000.00 | 2,730,717.00 |
| | UK TSY GILT 3.5 | 1,450,000.00 | 3,396,219.00 |
| | UK TSY GILT 3.75 | 1,500,000.00 | 1,574,640.00 |
| | UK TSY GILT 3.75 | 1,600,000.00 | 3,112,304.00 |
| | UK TSY GILT 4 | 1,500,000.00 | 1,609,920.00 |
| | UK TSY GILT 4 | 1,700,000.00 | 3,895,312.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,100,000.00 | 1,437,447.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 900,000.00 | 1,308,564.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,050,000.00 | 1,642,599.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 850,000.00 | 1,419,542.50 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,300,000.00 | 2,217,085.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,500,000.00 | 2,830,905.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 900,000.00 | 1,787,256.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,700,000.00 | 3,778,998.00 |
| | UK TSY GILT 4.5 | 1,100,000.00 | 1,711,721.00 |
| | UK TSY GILT 4.5 | 1,350,000.00 | 2,454,880.50 |
| | UK TSY GILT 4.75 | 1,150,000.00 | 1,685,693.00 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | UK TSY GILT 4.75 | 1,200,000.00 | 2,086,692.00 | |
| | UK TSY GILT 5 | 1,300,000.00 | 1,603,927.00 | |
| | UK TSY GILT 6 | 650,000.00 | 971,750.00 | |
| | UK TSY GILT 8 | 820,000.00 | 891,979.60 | |
| 英債券 小計 | | 51,420,000.00 | 74,011,921.10 | (9,851,726,817) |
| スウェーデンクローナ | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 4,000,000.00 | 4,284,320.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 1 | 4,400,000.00 | 4,745,752.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 7,000,000.00 | 7,450,660.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 5,000,000.00 | 5,701,400.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 8,000,000.00 | 8,647,760.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 4,600,000.00 | 7,259,536.00 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 33,000,000.00 | 38,089,428.00 | (407,937,773) |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOV'T 1.375 | 2,000,000.00 | 2,113,200.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.5 | 3,500,000.00 | 3,689,350.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 3,000,000.00 | 3,179,700.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 2,700,000.00 | 2,941,380.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 2 | 6,000,000.00 | 6,287,400.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 2 | 4,000,000.00 | 4,408,800.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 3 | 4,000,000.00 | 4,390,000.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 3.75 | 6,000,000.00 | 6,219,900.00 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 31,200,000.00 | 33,229,730.00 | (336,949,462) |
| デンマーククローネ | DENMARK - BULLET 0.5 | 8,100,000.00 | 8,578,710.00 | |
| | DENMARK - BULLET 1.5 | 5,000,000.00 | 5,336,500.00 | |
| | DENMARK - BULLET 1.75 | 6,000,000.00 | 6,711,600.00 | |
| | DENMARK - BULLET 3 | 5,000,000.00 | 5,249,000.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4.5 | 10,500,000.00 | 19,651,800.00 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 34,600,000.00 | 45,527,610.00 | (710,230,716) |
| ポーランドズロチ | POLAND GOVT BOND 1.75 | 3,000,000.00 | 3,045,570.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2 | 2,000,000.00 | 2,030,280.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 4,500,000.00 | 4,878,990.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 3,000,000.00 | 3,266,640.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.75 | 1,000,000.00 | 1,123,740.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 3.25 | 6,900,000.00 | 7,701,090.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 4 | 2,700,000.00 | 3,009,636.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 4,000,000.00 | 4,312,440.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 2,400,000.00 | 2,693,448.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 1,400,000.00 | 1,912,974.00 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 30,900,000.00 | 33,974,808.00 | |

| | | | |
|-----------------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|
| オーストラリアドル | AUSTRALIAN GOVT. 1.5 | 1,400,000.00 | 1,479,800.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2 | 1,000,000.00 | 1,028,600.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 1,500,000.00 | 1,575,675.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 2,000,000.00 | 2,229,400.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.5 | 1,350,000.00 | 1,557,765.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2,500,000.00 | 2,738,680.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,700,000.00 | 1,952,620.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,800,000.00 | 2,093,536.80 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,300,000.00 | 1,524,510.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 800,000.00 | 962,160.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3 | 1,400,000.00 | 1,809,315.20 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 1,900,000.00 | 2,145,100.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 2,100,000.00 | 2,497,530.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 850,000.00 | 1,095,055.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.75 | 1,200,000.00 | 1,635,888.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 2,150,000.00 | 2,600,210.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 1,400,000.00 | 1,984,640.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 2,300,000.00 | 2,948,370.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 2,000,000.00 | 2,308,200.00 |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 1,800,000.00 | 1,902,582.00 |
| AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 2,500,000.00 | 2,801,875.00 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 34,950,000.00 | 40,871,512.00 (2,818,499,467) |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOV'T 2.25 | 1,100,000.00 | 1,122,729.30 |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 1,200,000.00 | 1,283,160.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 400,000.00 | 502,800.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 700,000.00 | 899,850.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 2.875 | 400,000.00 | 470,000.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 3 | 700,000.00 | 772,341.50 |
| | SINGAPORE GOV'T 3.125 | 800,000.00 | 849,440.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 3.375 | 650,000.00 | 822,250.00 |
| | SINGAPORE GOV'T 3.5 | 1,500,000.00 | 1,764,000.00 |
| シンガポールドル 小計 | | 7,450,000.00 | 8,486,570.80 (641,584,752) |
| マレーシアリングgit | MALAYSIA GOVT 3.418 | 7,000,000.00 | 7,154,543.90 |
| | MALAYSIA GOVT 3.502 | 7,900,000.00 | 8,311,592.37 |
| | MALAYSIA GOVT 3.955 | 5,300,000.00 | 5,658,482.46 |
| | MALAYSIA GOVT 4.498 | 5,000,000.00 | 5,627,186.00 |
| | MALAYSIA GOVT 4.736 | 3,000,000.00 | 3,520,177.20 |
| マレーシアリングgit 小計 | | 28,200,000.00 | 30,271,981.93 (747,112,514) |
| | | | 151,493,147,031 |

| | |
|----|-------------------|
| 合計 | (151,493,147,031) |
|----|-------------------|

(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 | 50.0% | 51.1% |
| 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 | 34.8% | 35.5% |
| 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% | 1.9% |
| シンガポールドル | 国債証券 9銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| マレーシアリンギット | 国債証券 5銘柄 | 0.5% | 0.5% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネープール・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月27日現在)

資産の部

流動資産

| | |
|---------|-----------------|
| 金銭信託 | 114,743,936,896 |
| コール・ローン | 117,633,174,472 |
| 地方債証券 | 83,974,427,179 |
| 特殊債券 | 31,428,756,697 |
| 未収利息 | 76,708,748 |
| 前払費用 | 9,767,609 |
| 流動資産合計 | 347,866,771,601 |

資産合計

347,866,771,601

負債の部

流動負債

| | |
|---------|----------------|
| 未払金 | 3,399,391,680 |
| 未払解約金 | 9,000,000,000 |
| 未払利息 | 339,331 |
| その他未払費用 | 12,756,053 |
| 流動負債合計 | 12,412,487,064 |

負債合計

12,412,487,064

純資産の部

元本等

| | |
|-----|-----------------|
| 元本 | 334,872,062,439 |
| 剰余金 | |

(2020年 4月27日現在)

| | |
|-------------|-----------------|
| 剰余金又は欠損金（ ） | 582,222,098 |
| 元本等合計 | 335,454,284,537 |
| 純資産合計 | 335,454,284,537 |
| 負債純資産合計 | 347,866,771,601 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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 | (2020年 4月27日現在) |
|-----------------------|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 334,872,062,439口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0017円 (10,000口当たりの純資産額 10,017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 2020年 1月24日 至 2020年 4月27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。 |
| | (1) 金融商品の内容 |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 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27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(地方債証券、特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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)

| |
|---|
| <p style="text-align: center;">自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日</p> |
| <p>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。</p> |

(その他の注記)

| (2020年 4月27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 | 402,242,829,873円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 32,441,585,746円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 99,812,353,180円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| S M B C・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル) | 144,000,000円 |
| S M B C・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド) | 3,474,833円 |
| S M B C・日興ニューワールド債券ファンド(中国元) | 12,046,048円 |
| S M B C・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル) | 50,000,000円 |
| S M B C・日興ニューワールド債券ファンド(円) | 11,000,000円 |
| 三井住友・公益債券投信(毎月決算型) | 8,874,310円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型) | 4,305,812円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |

| | |
|---|------------------|
| 北米エネルギーファンド(毎月決算型) | 9,964,130円 |
| 北米エネルギーファンド(年2回決算型) | 996,413円 |
| 三井住友・公益債券投信(資産成長型) | 941,890円 |
| 日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド | 9,958,176円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 毎月分配型(為替ヘッジなし) | 39,857円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 毎月分配型(為替ヘッジあり) | 239,199円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 資産成長型(為替ヘッジなし) | 39,857円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 資産成長型(為替ヘッジあり) | 229,232円 |
| B N Pパリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) | 1,485,087円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジあり) | 279,064円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジなし) | 1,275,775円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジあり) | 1,953,537円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジなし) | 2,960,215円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 3 <適格機関投資家限定> | 334,605,745,855円 |
| 合計 | 334,872,062,439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 |
|-------|----------------|-------------|-------------|----|
| 地方債証券 | 第5回東京都公募公債(7年) | 200,000,000 | 200,390,000 | |
| | 第684回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,178,000 | |
| | 第685回東京都公募公債 | 600,000,000 | 600,954,000 | |
| | 第686回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,152,000 | |
| | 第689回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,416,000 | |
| | 第690回東京都公募公債 | 500,000,000 | 504,070,000 | |
| | 第691回東京都公募公債 | 500,000,000 | 503,905,000 | |
| | 第692回東京都公募公債 | 600,000,000 | 605,112,000 | |
| | 第693回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,209,000 | |

| | | | |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 第694回東京都公募公債 | 1,210,600,000 | 1,224,909,292 | |
| 第695回東京都公募公債 | 200,000,000 | 202,098,000 | |
| 第11回2号宮城県公募公債(5年) | 2,580,000,000 | 2,581,135,200 | |
| 平成22年度第5回静岡県公募公債 | 400,000,000 | 400,816,000 | |
| 平成22年度第6回静岡県公募公債 | 200,000,000 | 200,542,000 | |
| 平成22年度第8回静岡県公募公債 | 266,000,000 | 266,901,740 | |
| 平成22年度第9回静岡県公募公債 | 300,000,000 | 301,377,000 | |
| 平成22年度第11回静岡県公募公債 | 1,523,910,000 | 1,532,596,287 | |
| 平成22年度第13回静岡県公募公債 | 301,000,000 | 304,521,700 | |
| 平成27年度第4回静岡県公募公債(5年) | 700,000,000 | 700,126,000 | |
| 平成27年度第9回静岡県公募公債(5年) | 5,510,000,000 | 5,511,597,900 | |
| 平成22年度第3回愛知県公募公債(10年) | 500,000,000 | 500,565,000 | |
| 平成22年度第5回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,215,000 | |
| 平成22年度第9回愛知県公募公債(10年) | 360,000,000 | 361,735,200 | |
| 平成22年度第15回愛知県公募公債(10年) | 150,000,000 | 151,276,500 | |
| 平成22年度第16回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,921,000 | |
| 平成22年度第18回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,130,000 | |
| 平成22年度第19回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 202,534,000 | |
| 平成25年度第13回愛知県公募公債(7年) | 100,000,000 | 100,191,000 | |
| 平成26年度第2回愛知県公募公債(7年) | 900,000,000 | 902,952,000 | |
| 平成27年度第4回愛知県公募公債(5年) | 900,000,000 | 900,081,000 | |
| 平成22年度第1回広島県公募公債 | 300,000,000 | 300,330,000 | |
| 平成22年度第3回広島県公募公債 | 100,000,000 | 100,433,000 | |
| 平成22年度第6回広島県公募公債 | 806,000,000 | 813,431,320 | |
| 平成27年度第6回広島県公募公債(5年) | 4,310,000,000 | 4,310,948,200 | |
| 平成22年度第1回埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 200,008,000 | |
| 平成22年度第2回埼玉県公募公債 | 690,000,000 | 690,731,400 | |
| 平成22年度第3回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,203,000 | |
| 平成22年度第4回埼玉県公募公債 | 300,000,000 | 300,864,000 | |
| 平成22年度第6回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,447,000 | |
| 平成22年度第10回埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 201,866,000 | |
| 平成22年度第11回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,044,000 | |
| 平成27年度第10回埼玉県公募公債(5年) | 5,200,000,000 | 5,201,144,000 | |

| | | | | |
|---------|----------------------------|----------------|----------------|--|
| | 平成28年度第2回埼玉県公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,994,000 | |
| | 平成22年度第8回福岡県公募公債 | 320,000,000 | 322,668,800 | |
| | 平成22年度第1回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,194,000 | |
| | 平成27年度第2回福岡県公募公債 | 4,800,000,000 | 4,801,488,000 | |
| | 平成27年度第8回福岡県公募公債 | 5,870,000,000 | 5,873,228,500 | |
| | 平成27年度第1回奈良県公募公債 | 3,440,000,000 | 3,441,513,600 | |
| | 平成22年度第1回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 100,109,000 | |
| | 平成22年度第3回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 200,548,000 | |
| | 平成22年度第6回大阪市公募公債 | 230,000,000 | 231,301,800 | |
| | 平成27年度第5回大阪市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 5,002,150,000 | |
| | 平成27年度第7回大阪市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 5,002,800,000 | |
| | 第1回名古屋市公募公債(7年) | 400,000,000 | 400,348,000 | |
| | 第22回名古屋市公募公債(5年) | 6,400,000,000 | 6,402,688,000 | |
| | 第471回名古屋市公募公債(10年) | 400,000,000 | 400,720,000 | |
| | 第473回名古屋市公募公債(10年) | 291,000,000 | 293,368,740 | |
| | 第2回京都市公募公債(7年) | 1,000,000,000 | 1,002,800,000 | |
| | 平成27年度第3回京都市公募公債 | 3,900,000,000 | 3,901,794,000 | |
| | 平成27年度第6回京都市公募公債 | 3,200,000,000 | 3,199,840,000 | |
| | 平成27年度第6回神戸市公募公債(5年) | 3,200,000,000 | 3,201,152,000 | |
| | 平成22年度第1回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 300,306,000 | |
| | 平成22年度第5回横浜市公募公債 | 600,000,000 | 604,644,000 | |
| | 第43回横浜市公募公債(5年) | 5,000,000,000 | 5,002,050,000 | |
| | 平成27年度第3回福井県公募公債 | 1,900,000,000 | 1,900,836,000 | |
| | 平成22年度第1回岡山県公募公債(10年) | 300,000,000 | 301,827,000 | |
| 地方債証券合計 | | 83,858,510,000 | 83,974,427,179 | |
| 特殊債券 | 第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 349,000,000 | 350,382,040 | |
| | 第24回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 100,089,000 | |
| | 第25回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 300,000,000 | 300,315,000 | |
| | 第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 200,000,000 | 200,228,000 | |
| | 第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 600,000,000 | 607,350,000 | |
| | 第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 500,000,000 | 508,080,000 | |
| | 第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,011,000 | |

| | | | |
|----------------------------|---------------|---------------|--|
| 第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 696,800,000 | 697,608,288 | |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2,966,300,000 | 2,973,211,479 | |
| 第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 3,325,000,000 | 3,334,775,500 | |
| 第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 3,121,000,000 | 3,132,110,760 | |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,533,000,000 | 1,539,775,860 | |
| 第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 3,669,200,000 | 3,686,628,700 | |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,121,000,000 | 1,127,221,550 | |
| 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2,038,500,000 | 2,055,378,780 | |
| 第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 350,000,000 | 353,276,000 | |
| 第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 765,000,000 | 772,887,150 | |
| 第132回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 310,000,000 | 313,695,200 | |
| 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 588,600,000 | 596,516,670 | |
| 第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 203,000,000 | 205,945,530 | |
| 第344回政府保証道路債券 | 2,200,000,000 | 2,207,744,000 | |
| 第1回政府保証公営企業債券(15年) | 600,000,000 | 601,500,000 | |
| 第12回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 515,000,000 | 515,468,650 | |
| 第13回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,167,000 | |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 401,004,000 | |
| 第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 950,000,000 | 950,304,000 | |
| 第15回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 143,000,000 | 143,440,440 | |
| 第15回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 260,000,000 | 260,465,400 | |
| 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 301,188,000 | |
| 第17回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 306,000,000 | 307,386,180 | |
| 第19回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 600,000,000 | 604,680,000 | |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 572,000,000 | 578,669,520 | |
| 第32回政府保証日本政策金融公庫債券 | 1,000,000,000 | 1,000,750,000 | |

| | | | | |
|--------|--------------------|----------------|-----------------|--|
| | 第33回政府保証日本政策金融公庫債券 | 400,000,000 | 400,368,000 | |
| | 第34回政府保証日本政策金融公庫債券 | 100,000,000 | 100,135,000 | |
| 特殊債券合計 | | 31,282,400,000 | 31,428,756,697 | |
| | 合計 | | 115,403,183,876 | |

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DS・DCターゲットイヤーファンド2060

2020年5月29日現在

| | |
|----------------|-------------|
| 資産総額 | 27,141,522円 |
| 負債総額 | 9,189円 |
| 純資産総額（ - ） | 27,132,333円 |
| 発行済口数 | 30,000,000口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.9044円 |
| （1万口当たり純資産額） | （9,044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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

| | |
|--------------|--------------|
| | 2020年5月29日現在 |
| 資本金の額 | 20億円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000,000株 |
| 発行済株式総数 | 33,870,060株 |

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年5月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

| | 本数(本) | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 744 | 7,369,793 |
| 単体型株式投資信託 | 124 | 593,828 |
| 追加型公社債投資信託 | 1 | 28,440 |
| 単体型公社債投資信託 | 184 | 449,003 |
| 合計 | 1,053 | 8,441,066 |

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 | | 当事業年度 | |
|-----------------|-------|-------------|-------|-------------|
| | (自 | 2018年4月1日 | (自 | 2019年4月1日 |
| | 至 | 2019年3月31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 hands 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 | | 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 | 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いません。
 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) その他有価証券 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) その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 その他有価証券の 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 その他有価証券の うち満期があるもの | 151,249 | 2,135,802 | 761,441 | - |
| 長期差入保証金 | - | 524,592 | - | - |
| 合計 | 24,425,455 | 2,660,395 | 761,441 | - |

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

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

第47期（平成31年3月31日）

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

2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

(3) 退職給付費用

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

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

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

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、SMAAMとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、SMAAM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。

□ 販売会社

- (イ) 名称 住友生命保険相互会社
- (ロ) 資本金の額 639,000百万円(2020年3月末現在の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。)
- (ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

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

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6月9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DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2020年1月24日から2020年4月27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DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2020年4月27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。