【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年8月27日提出
【発行者名】	三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田　隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【事務連絡者氏名】	土屋　裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド
以下「当ファンド」といいます。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
＊ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。
当初元本は１口当たり１円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。
※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。
基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「ＤＣ積N外株」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。

（5）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2020年8月28日から2021年2月25日まで
申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱いますので、委託会社は販売会社としての役割も有します。
販売会社の詳細につきましては、前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

イ　申込証拠金
ありません。
ロ　日本以外の地域における募集
ありません。
ハ　お申込不可日
上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。
ニ　クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の６）の適用
ありません。

ホ　振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、外国株式インデックス・マザーファンドおよびエマージング株式インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式、新興国の株式（預託証書（ＤＲ）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資します。

ロ　当ファンドは、ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマークの詳細については、後述の「２　投資方針」をご参照ください。

ハ　委託会社は、受託会社と合意の上、金1,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ニ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産（収益の源泉）	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

（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、株価指数先物取引）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および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式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「株式」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（日本を除く）	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

≪商品分類表≫

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般					
大型株	年2回	日本			
中小型株					日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性 （　）	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信	（　）		ファンド･オブ･ファンズ	なし	
		アフリカ			
その他資産					

(投資信託証券(資産複合(株式、株価指数先物取引)資産配分変更型))		中近東(中東)			その他 (ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、配当込み、円ベース))
資産複合 (　　) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

2011年４月18日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年９月21日	「三井住友・ＤＣ全海外株式インデックスファンド」から「三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

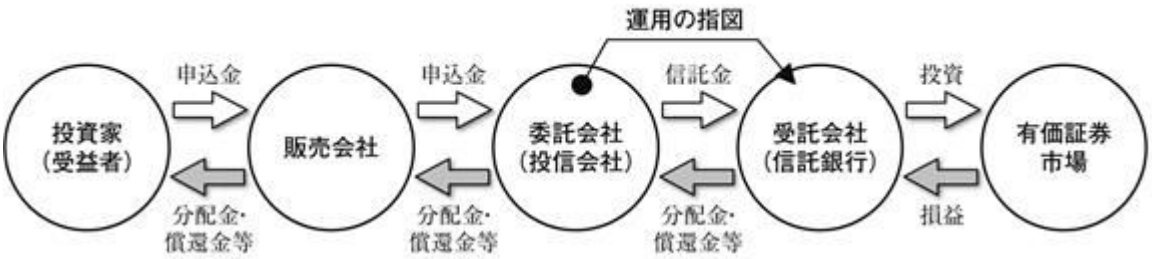
イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行*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、その業務を行うに充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。
＊株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、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が合併して発足しました。

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

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6月30日現在）

（ロ）会社の沿革

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

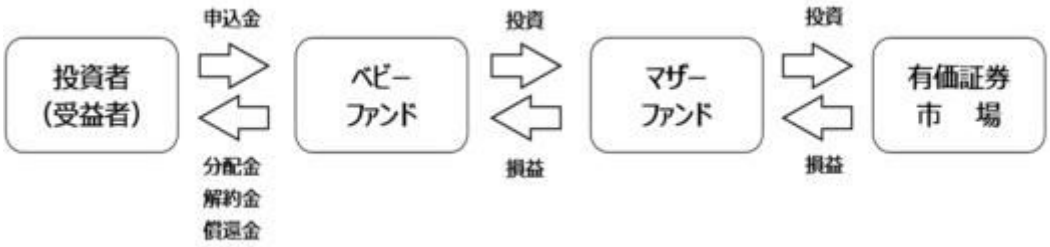
（ハ）大株主の状況

（2020年6月30日現在）

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

ハ　ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ　基本方針

当ファンドは、ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ　投資態度

（イ）マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く先進国の株式、新興国の株式（預託証書（ＤＲ）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

ファンドの特色

1 主として日本を除く先進国の株式、新興国の株式（預託証書（DR）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資します。

預託証書（DR）とは
Depositary Receiptの略で、株式を海外で流通させるために、その株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいい、株式と同様に取引所などで取引されます。

2 ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

■各マザーファンドへの投資割合は、原則としてそれぞれのマザーファンドが連動の目標とする株価指数（インデックス）の時価総額の比率とします。

3 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

ファンドのしくみ

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

各マザーファンドの投資方針等

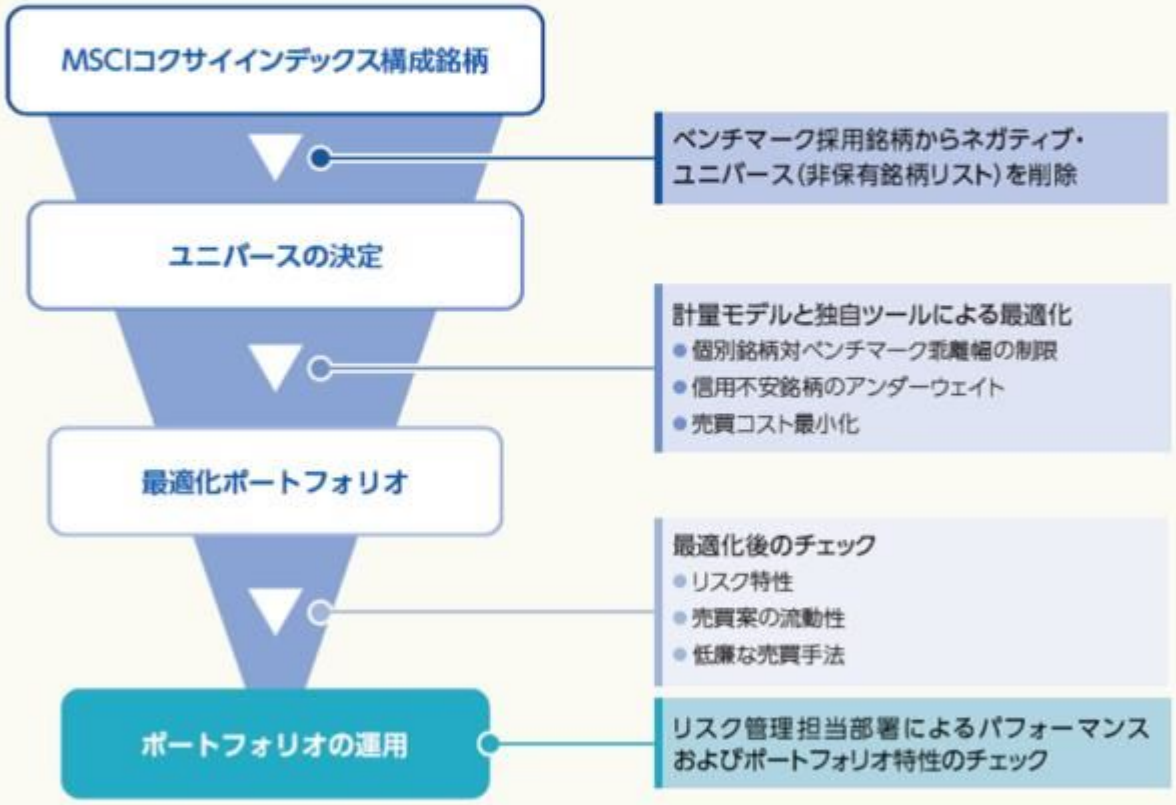
▶外国株式インデックス・マザーファンド

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

■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。

■株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

［運用プロセス］



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

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

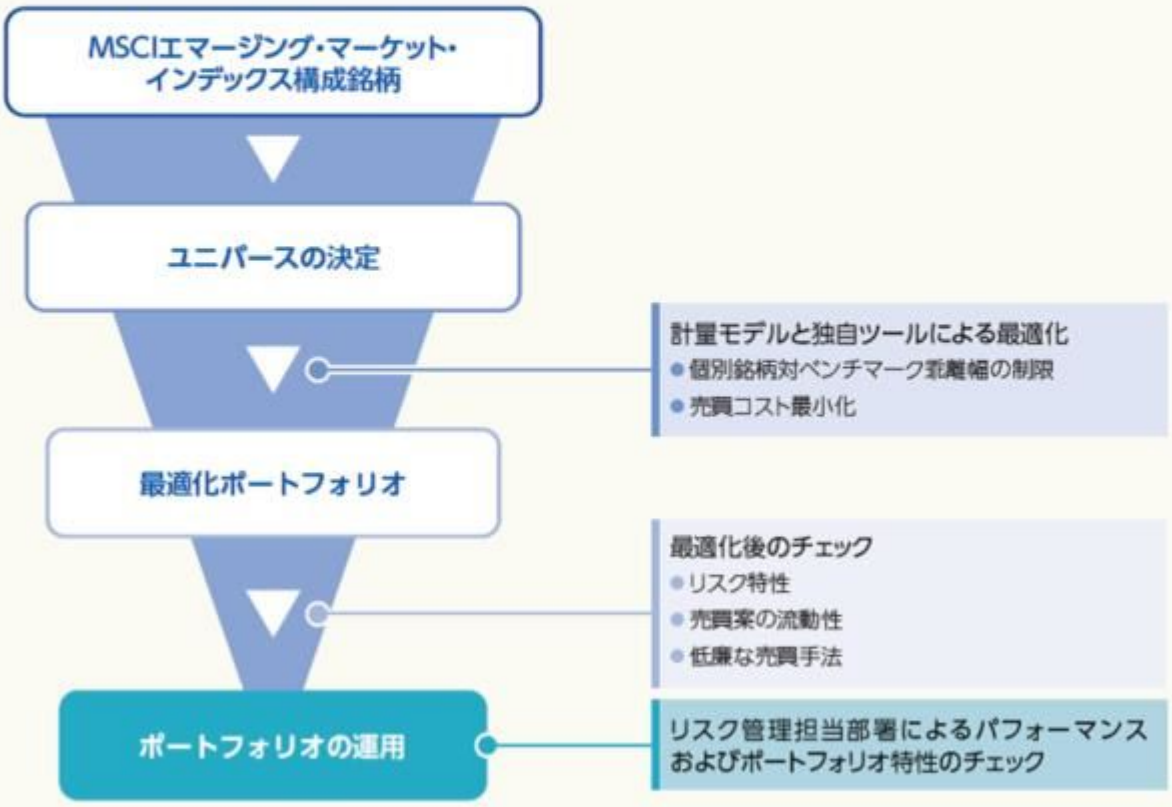
エマージング株式インデックス・マザーファンド

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

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

■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。

［ 運用プロセス ］



※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）との連動性を維持するため、上記の現物株式と株価指数先物取引を組み合わせた運用を行います。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本）とは

■MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除いた先進22ヵ国・地域と新興26ヵ国・地域の48ヵ国・地域で構成されている世界の株式市場の値動きを示す指標です。

[先進国・地域]

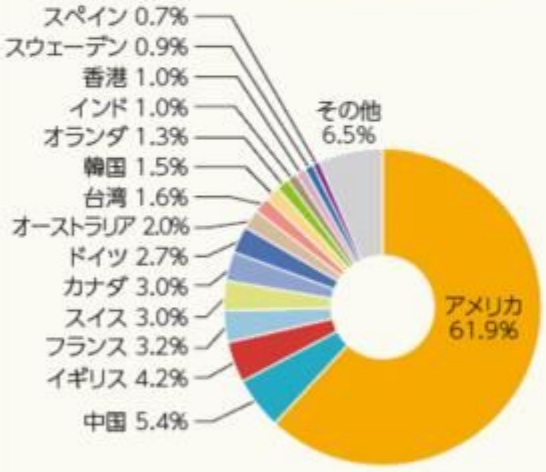
オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イスラエル、イタリア、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、イギリス、アメリカ

[新興国・地域]

アルゼンチン、ブラジル、チリ、中国、コロンビア、チェコ、エジプト、ギリシャ、ハンガリー、インド、インドネシア、韓国、マレーシア、メキシコ、パキスタン、ペルー、フィリピン、ポーランド、カタール、ロシア、サウジアラビア、南アフリカ、台湾、タイ、トルコ、アラブ首長国連邦

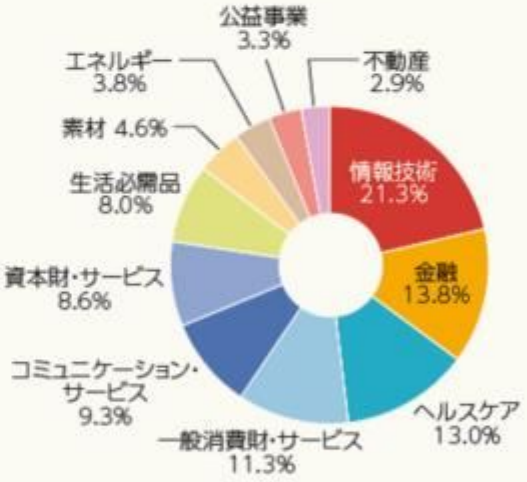
(注1)データは、2020年6月末現在。
(注2)同インデックスに関する知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。
また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

［国・地域別構成比率］



(注)2020年6月末現在。
数値は四捨五入の関係上、合計が100%にならない場合があります。
(出所)FactSetのデータを基に委託会社作成

［業種別構成比率］



(注1)2020年6月末現在。
数値は四捨五入の関係上、合計が100%にならない場合があります。
(注2)世界産業分類基準(GICS)による11セクターの分類。
(出所)FactSetのデータを基に委託会社作成

※グラフ・データは、上記指数等の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券
２．デリバティブ取引にかかる権利
３．約束手形
４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

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

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

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

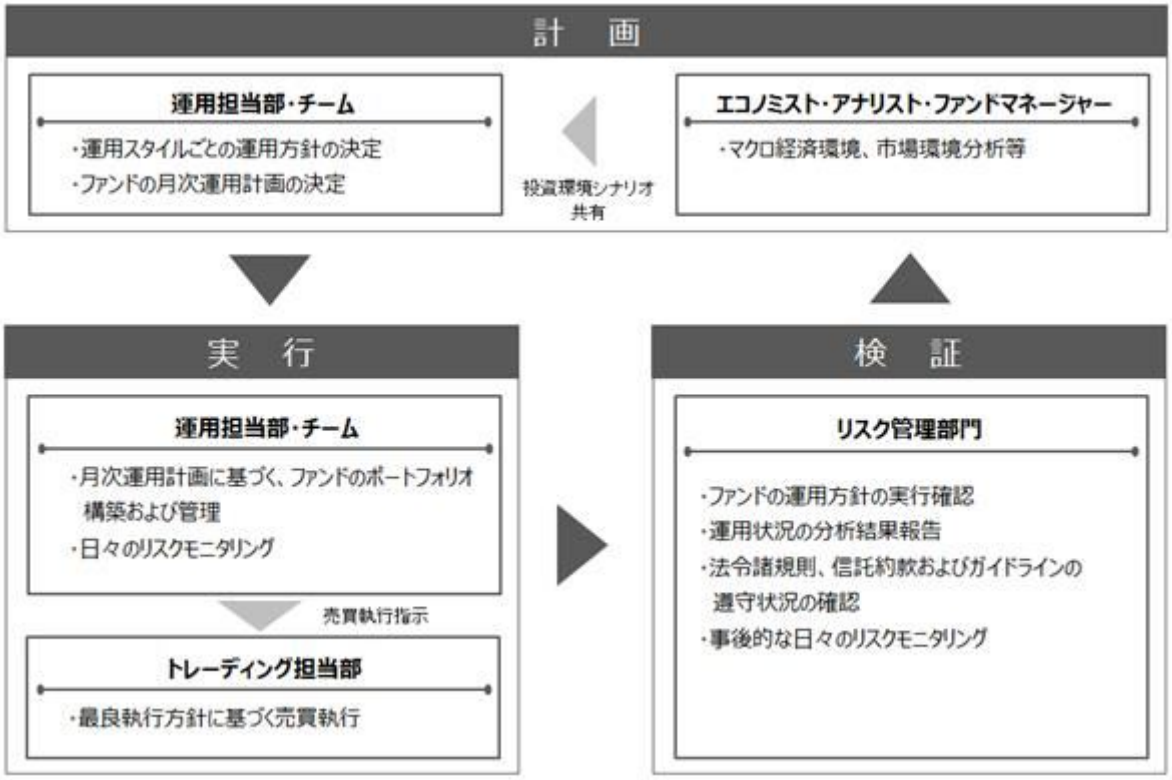
ハ　投資対象とする金融商品

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

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

（３）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制



※リスク管理部門の人員数は、約50名です。
※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年11月30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　分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

ロ　収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
ハ　留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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

（５）【投資制限】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ　株式への実質投資割合には制限を設けません。
※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
ロ　外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ハ　投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。
ニ　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ホ　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
ヘ　外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

Ⅱ　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　投資する株式等の範囲
（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
ロ　信用取引の指図
（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
（ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
（ニ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が

信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ　先物取引等の指図

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

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

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

ニ　スワップ取引の指図

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

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

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

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

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

ホ　金利先渡取引および為替先渡取引の指図

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

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

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

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

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

（ヘ）「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定め

た金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

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

ヘ　有価証券の貸付けの指図

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

１．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

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

ト　有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ　有価証券の借入れの指図

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

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場

合には、制約されることがあります。

ヌ　外国為替予約取引の指図

（イ）委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ル　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ　デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

III　法令に基づく投資制限

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

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

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

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリ

バティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第５号、第10号から第21号に掲げるもの（ただし、投資法人債券は除きます。）に投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

（ホ）外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と

同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

（エマージング株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

（ハ）外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

（ニ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

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

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

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）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。

（ハ）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。

（ニ）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。

（ホ）市場流動性リスク

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

（ヘ）指数の動きと連動しない要因

当ファンドは、ＭＳＣＩオール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物とインデックスの動きとの不一致等から、上記インデックスの動きに連動しないことがあります。

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

（チ）換金制限等に関する留意点

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

（リ）収益分配金に関する留意事項

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

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

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

ロ　投資リスクの管理体制

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

［ ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 ］

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

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

［ ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 ］

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

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

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

純資産総額に年0.275%（税抜き0.25%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
信託報酬の実質的配分は以下の通りです。
＜信託報酬の配分（税抜き）＞

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.11%	ファンドの運用等の対価
販売会社	年0.1%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.04%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。
※委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

（４）【その他の手数料等】

イ　信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0077%（税抜き0.007%）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、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

※　上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあ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。）

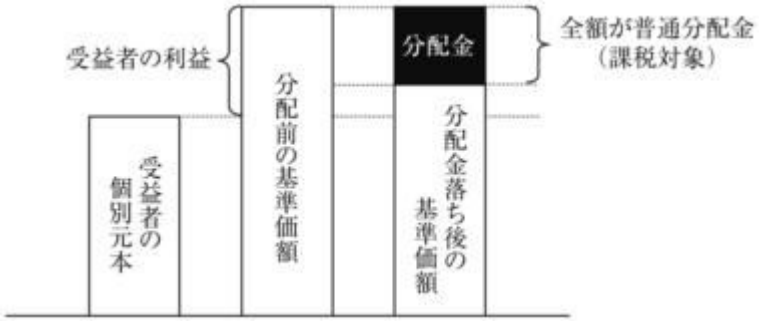
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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。

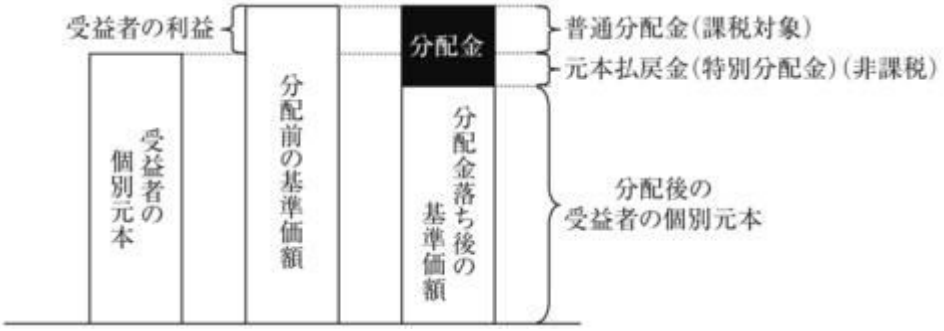
ハ　収益分配金の課税について

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。

①収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



②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①、②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。

ニ　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

ｉ．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。

ⅱ．一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

※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6月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

2020年 6月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	27,154,952,724	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	127,852,397	0.47
合計(純資産総額)		27,282,805,121	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

イ　主要投資銘柄

2020年 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	6,425,915,019	3.8220	24,559,979,896	3.6725	23,599,172,907	86.50
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	2,807,120,721	1.3094	3,675,901,550	1.2667	3,555,779,817	13.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別の投資比率

2020年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.53
合計	99.53

②【投資不動産物件】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

年月日	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期 (2011年11月30日)	791,366	791,366	7,914	7,914
第2期 (2012年11月30日)	999,614	999,614	9,843	9,843
第3期 (2013年12月 2日)	29,875,217	29,875,217	14,932	14,932
第4期 (2014年12月 1日)	126,118,620	126,118,620	18,741	18,741
第5期 (2015年11月30日)	721,863,012	721,863,012	18,775	18,775
第6期 (2016年11月30日)	3,297,102,247	3,297,102,247	17,768	17,768
第7期 (2017年11月30日)	6,144,123,719	6,144,123,719	21,823	21,823
第8期 (2018年11月30日)	10,190,306,886	10,190,306,886	21,975	21,975
第9期 (2019年12月 2日)	20,692,014,282	20,692,014,282	24,218	24,218
2019年 6月末日	15,096,544,174	—	22,587	—
7月末日	16,328,037,323	—	23,101	—
8月末日	16,336,167,376	—	21,870	—
9月末日	17,645,413,230	—	22,586	—
10月末日	19,253,435,436	—	23,520	—
11月末日	20,778,423,151	—	24,319	—
12月末日	22,385,590,712	—	25,151	—
2020年 1月末日	23,463,603,150	—	25,012	—
2月末日	22,608,749,925	—	23,171	—
3月末日	20,032,330,320	—	19,593	—
4月末日	23,154,726,590	—	21,476	—
5月末日	25,343,903,867	—	22,289	—
6月末日	27,282,805,121	—	22,886	—

②【分配の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）

第1期	2011年 4月18日～2011年11月30日	0
第2期	2011年12月 1日～2012年11月30日	0
第3期	2012年12月 1日～2013年12月 2日	0
第4期	2013年12月 3日～2014年12月 1日	0
第5期	2014年12月 2日～2015年11月30日	0
第6期	2015年12月 1日～2016年11月30日	0
第7期	2016年12月 1日～2017年11月30日	0
第8期	2017年12月 1日～2018年11月30日	0
第9期	2018年12月 1日～2019年12月 2日	0

③【収益率の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

	収益率（%）
第1期	△20.9
第2期	24.4
第3期	51.7
第4期	25.5
第5期	0.2
第6期	△5.4
第7期	22.8
第8期	0.7
第9期	10.2
第10期（中間期）	△6.9

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	15,534	0
第3期	20,834,698	1,842,388
第4期	58,155,597	10,867,675
第5期	355,289,173	38,096,333
第6期	1,781,501,937	310,380,580
第7期	1,649,677,938	689,858,998
第8期	2,464,729,536	642,849,931

第9期	4,664,111,679	757,404,262
第10期（中間期）	3,469,175,407	571,774,014

（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

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 6月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	アメリカ	139,364,742,703	64.76
	イギリス	9,725,696,309	4.52
	スイス	8,004,974,667	3.72
	フランス	7,326,694,425	3.40
	カナダ	7,244,330,686	3.37
	ドイツ	6,544,963,790	3.04
	オーストラリア	4,184,586,494	1.94
	オランダ	4,018,010,081	1.87
	アイルランド	3,703,193,711	1.72
	スウェーデン	2,085,184,293	0.97
	スペイン	1,757,685,783	0.82
	香港	1,753,552,582	0.81
	デンマーク	1,693,796,418	0.79
	イタリア	1,389,670,970	0.65
	フィンランド	859,767,405	0.40
	バミューダ	690,414,828	0.32
	シンガポール	679,930,336	0.32
	ベルギー	651,437,233	0.30
	ジャージー	645,409,313	0.30
	イスラエル	450,358,495	0.21
	ケイマン諸島	402,977,986	0.19
	ノルウェー	376,782,351	0.18
	ニュージーランド	228,140,869	0.11
	ルクセンブルグ	159,037,437	0.07

	キュラソー	142,510,547	0.07
	ポルトガル	124,732,293	0.06
	オーストリア	123,286,429	0.06
	リベリア	48,968,994	0.02
	マン島	23,646,445	0.01
	パプアニューギニア	19,274,014	0.01
	小計	204,423,757,887	94.99
投資証券	アメリカ	4,209,889,203	1.96
	オーストラリア	535,875,204	0.25
	香港	128,461,645	0.06
	フランス	124,105,732	0.06
	シンガポール	119,901,779	0.06
	イギリス	116,817,533	0.05
	カナダ	36,630,980	0.02
	小計	5,271,682,076	2.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	5,510,082,737	2.56
合計(純資産総額)		215,205,522,700	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	4,301,505,493	1.99
	買建	ドイツ	963,595,807	0.44
	買建	イギリス	279,443,713	0.12
	買建	オーストラリア	225,236,109	0.10
合計	買建	―	5,769,781,122	2.65

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	―	857,567,900	0.39

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 6月30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	1,305,446,673	15.36
	台湾	634,121,864	7.46
	韓国	615,102,307	7.24
	インド	428,522,828	5.04
	中国	392,515,818	4.62
	ブラジル	272,303,611	3.20
	南アフリカ	193,866,592	2.28
	香港	176,422,965	2.08
	タイ	119,165,241	1.40
	マレーシア	93,094,918	1.10
	メキシコ	90,095,497	1.06
	インドネシア	78,686,725	0.93
	フィリピン	43,551,382	0.51
	バミューダ	42,765,261	0.50
	ポーランド	37,886,160	0.45
	チリ	31,411,498	0.37
	トルコ	23,667,812	0.28
	アメリカ	19,231,267	0.23
	ハンガリー	12,308,477	0.14
	コロンビア	9,769,972	0.11
	ギリシャ	7,762,806	0.09
	ルクセンブルグ	6,397,131	0.08
	エジプト	6,154,237	0.07
	チェコ	5,838,786	0.07
	ペルー	1,804,321	0.02
	アルゼンチン	1,752,588	0.02
	マン島	1,670,482	0.02
	シンガポール	1,275,603	0.02
	小計	4,652,592,822	54.75
投資信託受益証券	アメリカ	250,439,287	2.95
	香港	247,218,355	2.91
	小計	497,657,642	5.86
投資証券	アメリカ	140,873,659	1.66

	ブラジル	6,340,131	0.07
	南アフリカ	2,228,012	0.03
	メキシコ	1,973,044	0.02
	小計	151,414,846	1.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,195,704,027	37.61
合計(純資産総額)		8,497,369,337	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	3,220,885,145	37.90
合計	買建	―	3,220,885,145	37.90

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	―	1,964,186,845	23.11
	売建	―	215,151	△0.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	223,779	28,742.87	6,432,052,317	38,978.17	8,722,497,516	4.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	369,525	16,381.86	6,053,509,403	21,379.92	7,900,417,007	3.67
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,635	196,701.99	4,255,647,671	288,784.14	6,247,844,895	2.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	123,132	21,452.11	2,641,441,381	23,771.75	2,927,063,564	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,707	139,351.99	2,188,801,760	150,294.06	2,360,668,923	1.10

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,349	139,348.76	2,138,864,135	150,531.09	2,310,501,789	1.07
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	134,440	14,752.83	1,983,371,568	14,980.16	2,013,934,001	0.94
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	151,844	11,672.98	1,772,472,279	11,879.04	1,803,761,314	0.84
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	87,010	19,679.78	1,712,338,388	20,619.28	1,794,083,657	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	126,393	12,995.59	1,642,552,719	12,676.68	1,602,244,677	0.74
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	156,751	13,797.18	2,162,722,452	10,019.82	1,570,616,805	0.73
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	48,347	29,888.15	1,445,002,553	31,218.74	1,509,332,539	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	55,593	23,570.27	1,310,342,564	26,516.96	1,474,157,846	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	45,605	31,088.37	1,417,785,433	31,560.27	1,439,306,487	0.67
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	217,923	6,201.51	1,351,452,623	6,278.00	1,368,122,730	0.64
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	70,612	23,104.84	1,631,479,174	19,090.45	1,348,014,898	0.63
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	35,828	34,800.43	1,246,829,857	37,526.76	1,344,509,080	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	211,684	6,405.14	1,355,866,291	5,892.30	1,247,305,760	0.58
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	31,160	24,795.28	772,621,037	39,648.31	1,235,441,651	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	365,193	3,952.98	1,443,600,844	3,222.50	1,176,835,684	0.55
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	24,532	33,429.56	820,094,143	45,703.30	1,121,193,552	0.52
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	92,407	15,748.35	1,455,258,315	12,015.16	1,110,285,334	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	22,459	34,584.54	776,734,184	48,185.63	1,082,201,235	0.50
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	215,779	4,814.90	1,038,954,437	4,972.20	1,072,896,560	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	129,501	9,249.47	1,197,816,780	8,201.16	1,062,059,561	0.49
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	109,269	10,199.98	1,114,542,685	9,439.15	1,031,406,634	0.48
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	215,380	7,006.33	1,509,023,829	4,775.03	1,028,447,426	0.48
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	56,664	11,686.55	662,207,111	18,138.02	1,027,773,275	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	399,768	3,465.99	1,385,594,209	2,520.03	1,007,430,791	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	71,120	14,464.09	1,028,686,436	14,122.55	1,004,396,410	0.47

ロ　種類別・業種別の投資比率

2020年 6月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	3.37
		素材	4.19
		資本財	6.03
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.14
		耐久消費財・アパレル	1.69
		消費者サービス	1.43
		メディア・娯楽	6.36
		小売	5.84
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.50
		家庭用品・パーソナル用品	2.12
		ヘルスケア機器・サービス	5.18
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.76
		銀行	5.35
		各種金融	4.16
		保険	3.10
		不動産	0.53
		ソフトウェア・サービス	11.94
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.58
		電気通信サービス	2.13
		公益事業	3.39
		半導体・半導体製造装置	3.80
投資証券	―	―	2.45
合計			97.44

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 6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額 単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	15,974	21,711.88	346,825,698	23,166.25	370,057,754	4.35
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	48,700	4,762.29	231,923,769	6,755.40	328,987,980	3.87

香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	385,200	599.02	230,745,018	641.79	247,218,355	2.91
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	210,000	1,112.57	233,640,749	1,138.80	239,148,000	2.81
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	40,666	4,566.61	185,706,110	4,716.00	191,780,856	2.26
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	47,598	4,393.34	209,114,464	3,699.79	176,102,681	2.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	48,825	3,104.82	151,593,171	2,885.27	140,873,659	1.66
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	3,794	13,616.05	51,659,308	19,396.98	73,592,144	0.87
ケイマン諸島	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	30,400	1,812.20	55,090,887	2,386.63	72,553,552	0.85
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	818,000	86.73	70,953,014	86.59	70,836,346	0.83
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	24,378	2,188.99	53,363,398	2,481.33	60,490,009	0.71
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	50,500	1,210.55	61,132,857	1,081.42	54,611,710	0.64
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	7,210	4,091.82	29,502,068	6,419.14	46,282,066	0.54
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	—	25,392	1,874.16	47,588,846	1,723.83	43,771,745	0.52
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	52,500	819.29	43,012,840	720.02	37,801,050	0.44
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	14,098	3,229.18	45,525,107	2,507.25	35,347,295	0.42
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	4,677	7,361.75	34,430,924	7,524.00	35,189,748	0.41
ブラジル	株式	VALE SA	素材	31,700	1,003.25	31,803,253	1,108.70	35,145,977	0.41
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	513,000	77.45	39,734,803	66.02	33,870,825	0.40
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	106,800	317.55	33,915,041	310.98	33,212,664	0.39
ケイマン諸島	株式	NETEASE.COM INC -ADR	メディア・娯楽	693	36,179.31	25,072,263	46,612.63	32,302,555	0.38
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	29,218	1,010.58	29,527,336	1,053.72	30,787,591	0.36
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,334	12,677.70	29,589,755	13,067.78	30,500,209	0.36
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI UAE ETF	—	27,211	1,393.91	37,929,769	1,085.48	29,537,009	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	7,063	3,730.06	26,345,433	4,144.49	29,272,603	0.34
中国	株式	BANK OF CHINA LTD	銀行	676,000	43.39	29,331,873	40.17	27,155,596	0.32
台湾	株式	MEDIATEK INCORPORATION	半導体・半導体製造装置	13,000	1,533.55	19,936,187	2,062.25	26,809,250	0.32
韓国	株式	NAVER CORPORATION	メディア・娯楽	1,060	15,550.73	16,483,784	23,760.00	25,185,600	0.30
ケイマン諸島	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	消費者サービス	3,261	4,947.48	16,133,756	7,265.98	23,694,379	0.28
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	7,745	2,954.15	22,879,898	3,026.37	23,439,282	0.28

ロ　種類別・業種別の投資比率

2020年 6月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	2.46
		素材	3.21
		資本財	1.49
		商業・専門サービス	0.16
		運輸	0.86
		自動車・自動車部品	1.10
		耐久消費財・アパレル	0.70
		消費者サービス	1.02
		メディア・娯楽	5.86
		小売	7.80
		食品・生活必需品小売り	0.83
		食品・飲料・タバコ	1.80
		家庭用品・パーソナル用品	0.74
		ヘルスケア機器・サービス	0.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.64
		銀行	6.56
		各種金融	1.04
		保険	1.94
		不動産	1.38
		ソフトウェア・サービス	1.11
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.77
		電気通信サービス	2.07
		公益事業	1.27
		半導体・半導体製造装置	4.21
投資信託受益証券	—	—	5.86
投資証券	—	—	1.78
合計			62.39

②投資不動産物件

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。

③その他投資資産の主要なもの

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 6月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価（円）	評価額	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMINI 2009	買建	262	米ドル	39,662,376	4,273,224,389	39,924,870	4,301,505,493	1.99
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 2009	買建	247	ユーロ	7,780,809	942,100,354	7,958,340	963,595,807	0.44
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2009	買建	21	オーストラリアドル	3,064,744.5	226,423,324	3,048,675	225,236,109	0.10
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 2009	買建	34	英ポンド	2,058,403	272,758,981	2,108,850	279,443,713	0.12

（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 6月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	6,200,000.00	665,840,215	667,926,000	0.31
	カナダドル	買建	310,000.00	24,348,300	24,424,900	0.01
	ユーロ	買建	470,000.00	56,723,800	56,907,600	0.02
	英ポンド	買建	270,000.00	35,762,800	35,775,000	0.01
	スイスフラン	買建	220,000.00	24,893,800	24,908,400	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	610,000.00	7,018,577	7,045,500	0.00
	ノルウェークローネ	買建	90,000.00	995,334	1,001,700	0.00
	デンマーククローネ	買建	380,000.00	6,143,372	6,175,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	270,000.00	19,888,200	19,944,900	0.00
	ニュージーランドドル	買建	10,000.00	688,300	690,800	0.00
	香港ドル	買建	640,000.00	8,864,486	8,889,600	0.00
	シンガポールドル	買建	30,000.00	2,312,780	2,319,000	0.00
	イスラエルシュケル	買建	50,000.00	1,563,400	1,559,500	0.00

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 6月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価（円）	評価額	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 2009	買建	604	米ドル	29,679,769	3,197,698,312	29,894,980	3,220,885,145	37.90

（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 6月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	18,251,130.19	1,948,114,171	1,964,186,845	23.11
	ブラジルレアル	売建	668.63	13,071	13,325	△0.00
	香港ドル	売建	14,530.48	201,100	201,826	△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。

≪参考情報≫

基準日:2020年6月30日

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

基準価額・純資産の推移

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2019年12月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11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。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■三井住友・ＤＣつみたてNISA・全海外株インデックスファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.47
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	86.50
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	13.03

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	64.76
	イギリス	4.52
	スイス	3.72
	フランス	3.40
	カナダ	3.37
	ドイツ	3.04
	その他	12.18
投資証券	アメリカ・その他	2.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.56
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て2.65%

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	4.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.67
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.10
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.07
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.94
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.84
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	0.74

※比率は、当ファンド、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。
※「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。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	15.36
	台湾	7.46
	韓国	7.24
	インド	5.04
	中国	4.62
	その他	15.03
投資信託受益証券	アメリカ・その他	5.86
投資証券	アメリカ・その他	1.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		37.61
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て37.90%

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	4.35
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	3.87
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	2.91
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	2.81
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	2.26
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	1.66
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	0.87
ケイマン諸島	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	0.85
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	0.83

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。
※2011年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2011年4月18日)から年末までの騰落率を表示しています。
※2020年の収益率は、年初から2020年6月30日までの騰落率を表示しています。
※ベンチマーク(MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、配当込み、円ベース))の情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の２つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

（ニ）申込不可日
上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ロ　申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ　申込手数料
ありません。

ニ　申込単位
お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先
手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	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。

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所
販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日
取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。
お買付けの販売会社にお申し出ください。
ただし、ニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、解約請求の受付けは行いません。
解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。
なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
一部解約金は、解約請求受付日から起算して６営業日目からお支払いします。
一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。
一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（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付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

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

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「ＤＣ積Ｎ外株」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】

2011年４月18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12月１日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

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

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

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、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

（ロ）償還金

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

ハ　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発します。

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知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。

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

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

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

ニ　反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

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

ホ　販売会社との契約の更改等

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

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト　公告

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

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

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

チ　運用にかかる報告書の開示方法

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

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

４【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

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

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

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

す。

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

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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9期（2018年12月 1日から2019年12月 2日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成30年11月30日現在）	第9期 （令和 1年12月 2日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	104,335,503	-
コール・ローン	19,061,214	218,960,747
親投資信託受益証券	10,089,858,224	20,514,789,908
流動資産合計	10,213,254,941	20,733,750,655
資産合計	10,213,254,941	20,733,750,655
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,291,334	17,535,225
未払受託者報酬	1,968,334	3,765,417
未払委託者報酬	10,333,707	19,768,367
未払利息	55	419
その他未払費用	354,625	666,945
流動負債合計	22,948,055	41,736,373
負債合計	22,948,055	41,736,373
純資産の部		
元本等		
元本	4,637,308,508	8,544,015,925
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,552,998,378	12,147,998,357
元本等合計	10,190,306,886	20,692,014,282
純資産合計	10,190,306,886	20,692,014,282
負債純資産合計	10,213,254,941	20,733,750,655

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　平成29年12月 1日 至　平成30年11月30日	第9期 自　平成30年12月 1日 至　令和 1年12月 2日
営業収益		
有価証券売買等損益	50,937,883	1,844,760,684
営業収益合計	50,937,883	1,844,760,684
営業費用		
支払利息	95,294	96,803
受託者報酬	3,426,586	6,326,297
委託者報酬	17,989,462	33,212,897
その他費用	675,632	1,166,212
営業費用合計	22,186,974	40,802,209
営業利益又は営業損失（△）	28,750,909	1,803,958,475
経常利益又は経常損失（△）	28,750,909	1,803,958,475
当期純利益又は当期純損失（△）	28,750,909	1,803,958,475
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（△）	21,302,079	39,710,552
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,328,694,816	5,552,998,378
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,981,106,668	5,735,454,423
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	2,981,106,668	5,735,454,423
剰余金減少額又は欠損金増加額	764,251,936	904,702,367
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	764,251,936	904,702,367
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（△）	5,552,998,378	12,147,998,357

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第9期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年12月 1日から令和 1年12月 2日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第8期 （平成30年11月30日現在）	第9期 （令和 1年12月 2日現在）
1.　当計算期間の末日における受益権の総数	4,637,308,508口	8,544,015,925口
2.　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.1975円 (10,000口当たりの純資産額　21,975円)	1口当たり純資産額　2.4218円 (10,000口当たりの純資産額　24,218円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第8期 自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日	第9期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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（135,235,492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（4,637,323,934円）、および分配準備積立金（780,438,952円）より、分配対象収益は5,552,998,378円（1万口当たり11,974.60円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（299,655,148円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,351,008,293円）、収益調整金（9,683,428,277円）、および分配準備積立金（813,906,639円）より、分配対象収益は12,147,998,357円（1万口当たり14,218.10円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第9期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

項　目	第9期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
3 .金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。
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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第9期 （令和 1年12月 2日現在）
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第8期（自 平成29年12月 1日　至 平成30年11月30日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	47,107,605円
合計	47,107,605円

第9期（自 平成30年12月 1日　至 令和 1年12月 2日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,840,970,381円
合計	1,840,970,381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9期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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8期 （平成30年11月30日現在）	第9期 （令和 1年12月 2日現在）
期首元本額	2,815,428,903円	4,637,308,508円
期中追加設定元本額	2,464,729,536円	4,664,111,679円
期中一部解約元本額	642,849,931円	757,404,262円

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	4,651,861,582	18,055,270,358	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	1,847,179,535	2,459,519,550	
合計		6,499,041,117	20,514,789,908	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドは、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「エマージング株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	4,680,678,054	2,984,124,159
金銭信託	196,184,929	-
コール・ローン	35,841,328	245,060,770
株式	163,192,743,028	221,190,960,865
投資証券	3,982,954,412	6,160,443,382
派生商品評価勘定	55,262,575	66,900,917
未収入金	5,107,159	9,126,399
未収配当金	314,330,892	388,775,579
前払金	16,690,628	-
差入委託証拠金	1,844,283,764	1,718,072,460
流動資産合計	174,324,076,769	232,763,464,531
資産合計	174,324,076,769	232,763,464,531
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	71,909,043	1,128,330
前受金	-	65,939,896
未払金	-	87,931,440
未払解約金	6,754,706	189,530,582
未払利息	105	469
その他未払費用	25,308	14,063

	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
流動負債合計	78,689,162	344,544,780
負債合計	78,689,162	344,544,780
純資産の部		
元本等		
元本	50,246,578,230	59,882,488,969
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	123,998,809,377	172,536,430,782
元本等合計	174,245,387,607	232,418,919,751
純資産合計	174,245,387,607	232,418,919,751
負債純資産合計	174,324,076,769	232,763,464,531

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	50,246,578,230口	59,882,488,969口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　3.4678円 (10,000口当たりの純資産額　34,678円)	1口当たり純資産額　3.8813円 (10,000口当たりの純資産額　38,813円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3.金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。
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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（令和 1年12月 2日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,748,687,152	-	6,731,996,524	△16,690,628
	SPMINI 1812	4,842,526,567	-	4,842,027,015	△499,552
	DJ EUR 1812	1,161,748,826	-	1,151,511,810	△10,237,016
	FTSE 1812	439,452,080	-	440,096,649	644,569
	SPI200 1812	304,959,679	-	298,361,050	△6,598,629
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	96,521,940	-	96,444,300	△77,640
	米ドル	56,795,000	-	56,715,000	△80,000
	ユーロ	27,111,000	-	27,127,800	16,800
	スイスフラン	4,573,600	-	4,556,000	△17,600
	スウェーデンクローナ	1,130,400	-	1,125,900	△4,500
	デンマーククローネ	1,557,000	-	1,557,900	900
	香港ドル	2,176,650	-	2,175,000	△1,650
	シンガポールドル	1,653,800	-	1,657,200	3,400
	イスラエルシュケル	1,524,490	-	1,529,500	5,010
	売建	35,902,400	-	35,780,600	121,800
	カナダドル	3,420,400	-	3,416,000	4,400
	英ポンド	27,673,500	-	27,548,100	125,400
	ノルウェークローネ	663,500	-	663,500	-
	オーストラリアドル	4,145,000	-	4,153,000	△8,000
合計		6,881,111,492	-	6,864,221,424	△16,646,468

（令和 1年12月 2日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	4,793,912,844	-	4,859,852,740	65,939,896
	SPMINI 1912	3,477,799,248	-	3,534,210,414	56,411,166
	DJ EUR 1912	822,222,666	-	827,733,882	5,511,216
	FTSE 1912	281,274,199	-	281,558,794	284,595
	SPI200 1912	212,616,731	-	216,349,650	3,732,919
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	242,985,191	-	243,152,500	△167,309
	米ドル	169,863,680	-	169,980,500	△116,820
	カナダドル	7,428,763	-	7,434,200	△5,437
	ユーロ	25,346,466	-	25,378,500	△32,034
	英ポンド	12,734,350	-	12,741,700	△7,350
	スイスフラン	7,672,280	-	7,671,300	980
	スウェーデンクローナ	2,291,471	-	2,292,000	△529
	ノルウェークローネ	595,442	-	594,500	942
	デンマーククローネ	1,293,064	-	1,293,600	△536
	オーストラリアドル	8,899,972	-	8,908,800	△8,828
	香港ドル	5,742,274	-	5,740,000	2,274
	シンガポールドル	801,860	-	801,900	△40
	イスラエルシュケル	315,569	-	315,500	69
合計		5,036,898,035	-	5,103,005,240	65,772,587

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成30年11月30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	58,029,292,656円
同期中における追加設定元本額	10,049,653,315円
同期中における一部解約元本額	17,832,367,741円
平成30年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	13,963,534,928円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	292,292,873円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,202,931,749円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	817,090,506円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	93,736,744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）	2,767,111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）	8,246,340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）	23,067,469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）	42,427,347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）	28,725,353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）	74,091,002円
外国株式指数ファンド	515,784,016円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	2,565,814,517円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	315,400,400円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	365,627,690円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	327,166,698円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	5,473,135円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	7,216,701円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	8,212,729円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	29,595,220円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	21,315,967円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	47,876,942円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	8,473,697円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,124,666,265円

バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	9,021,436円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	179,443,768円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,755,823,811円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,622,654,012円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,828,627,561円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	20,758,586円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	109,197,074円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	415,799円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	836,811,730円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	62,459,560円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	192,420,422円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	832,243,444円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	700,715,521円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,758,084,467円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,127,823円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	644,159,199円
三井住友・５資産バランスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	910,046,061円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	144,875,919円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２０＜適格機関投資家専用＞	62,409,967円
三井住友・７資産バランスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,238,982,181円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	26,076,116円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	14,479,541円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	7,145,659円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	50,091,943円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	117,258,620円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	124,968,964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＞	1,290,643,460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＞	176,401,107円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	6,575,845,522円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	330,173,733円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	508,770,876円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	8,425,418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＞	80,662,210円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０５＜適格機関投資家限定＞	38,640,683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＞	95,159,906円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド＜適格機関投資家限定＞	20,732円
合計	50,246,578,230円

（令和 1年12月 2日現在）	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	50,246,578,230円
同期中における追加設定元本額	25,475,610,485円

同期中における一部解約元本額	15,839,699,746円
令和 1年12月 2日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	24,341,482,029円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	309,208,928円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,259,261,163円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	846,574,484円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	95,225,173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）	2,203,478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）	8,569,298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）	23,404,360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）	49,150,528円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	35,973,195円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	84,418,147円
外国株式指数ファンド	519,424,273円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	4,651,861,582円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	467,864,523円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	467,950,368円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	363,716,897円
イオン・バランス戦略ファンド	12,835,702円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	6,924,395円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	38,804,550円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	35,331,600円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	98,630,259円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	53,111,115円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	67,295,491円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	18,283,485円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	27,790円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	41,770円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	56,291円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,410,498,405円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,831,278円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	73,969,974円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,425,257,649円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,437,712,637円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,008,822,640円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	20,208,409円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	101,561,964円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	419,448円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	719,013,252円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	59,112,177円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	171,173,908円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	746,604,437円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	610,403,231円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,481,526,688円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	807,485円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	298,971,151円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	124,994,236円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	17,270,683円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	12,728,159円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	6,672,335円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	41,560,678円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	104,386,931円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	7,900,647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＞	824,759,297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＞	136,799,749円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,661,668,736円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	253,114,771円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	3,894,611,777円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	8,907,868円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	45,206,401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＞	27,976,493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II＜適格機関投資家限定＞	282,124,598円
合計	59,882,488,969円

附属明細表

①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	22.28	424,701.36	
	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	22.42	716,857.08	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	15.94	312,934.08	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	60.54	711,163.38	
	CHEVRON CORPORATION	98,472	117.13	11,534,025.36	
	CONCHO RESOURCES INC	10,172	72.56	738,080.32	
	CONOCOPHILLIPS	58,406	59.94	3,500,855.64	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	30.88	140,040.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,054	21.89	460,872.06	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	77.34	613,538.22	
	EOG RESOURCES INC	31,054	70.90	2,201,728.60	
	EXXON MOBIL CORPORATION	220,825	68.13	15,044,807.25	
	HALLIBURTON CO	44,317	20.99	930,213.83	
	HESS CORPORATION	14,506	62.09	900,677.54	
	HOLLYFRONTIER CORP	9,418	51.55	485,497.90	
	KINDER MORGAN INC	109,144	19.61	2,140,313.84	
	MARATHON OIL CORP	47,030	11.65	547,899.50	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,599	60.64	2,037,443.36	

NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,156	22.55	499,617.80	
NOBLE ENERGY INC	26,757	20.76	555,475.32	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	45,362	38.57	1,749,612.34	
ONEOK INC	20,930	71.05	1,487,076.50	
PHILLIPS 66	23,021	114.72	2,640,969.12	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,540	127.84	1,091,753.60	
SCHLUMBERGER LTD	73,674	36.20	2,666,998.80	
TARGA RESOURCES CORP	11,788	36.53	430,615.64	
TECHNIPFMC PLC	21,584	18.84	406,642.56	
VALERO ENERGY CORP	21,157	95.49	2,020,281.93	
WILLIAMS COS INC	61,445	22.72	1,396,030.40	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,470	236.33	2,710,705.10	
ALBEMARLE CORPORATION	6,316	65.38	412,940.08	
AMCOR PLC	82,302	10.26	844,418.52	
AVERY DENNISON CORP	4,859	130.37	633,467.83	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	28.47	358,437.30	
BALL CORPORATION	16,125	66.06	1,065,217.50	
CELANESE CORPORATION	6,420	125.57	806,159.40	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	46.21	554,612.42	
CORTEVA INC	38,111	26.02	991,648.22	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	75.90	520,901.70	
DOW INC	37,971	53.37	2,026,512.27	
DUPONT DE NEMOURS INC	38,111	64.81	2,469,973.91	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	78.37	550,705.99	
ECOLAB INC	13,818	186.67	2,579,406.06	
FMC CORPORATION	6,676	97.96	653,980.96	
FREEPORT-MCMORAN INC	80,780	11.38	919,276.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	46.34	886,947.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	141.23	687,931.33	
LINDE PLC	27,913	206.21	5,755,939.73	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,240	92.54	1,317,769.60	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,381	268.40	907,460.40	
MOSAIC CO/THE	18,584	19.05	354,025.20	
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	41,561	38.40	1,595,942.40	
NUCOR CORP	15,455	56.36	871,043.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,339	111.90	597,434.10	
PPG INDUSTRIES INC	11,972	128.84	1,542,472.48	
RPM INTERNATIONAL INC	7,603	73.73	560,569.19	
SEALED AIR CORP	7,895	37.73	297,878.35	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,429	583.13	2,582,682.77	
STEEL DYNAMICS,INC.	10,191	33.73	343,742.43	
VULCAN MATERIALS CO	6,698	141.87	950,245.26	

WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	68.68	101,303.00	
WESTROCK CO	13,034	40.33	525,661.22	
3M COMPANY	30,005	169.77	5,093,948.85	
ACUITY BRANDS INC	1,884	130.78	246,389.52	
AERCAP HOLDINGS NV	7,090	61.81	438,232.90	
ALLEGION PLC	4,764	120.03	571,822.92	
AMETEK INC	12,190	99.01	1,206,931.90	
ARCONIC INC	19,024	30.96	588,983.04	
BOEING CO	27,992	366.18	10,250,110.56	
CATERPILLAR INC	29,539	144.73	4,275,179.47	
CUMMINS INC	7,944	182.86	1,452,639.84	
DEERE & CO	15,270	168.05	2,566,123.50	
DOVER CORP	7,949	111.48	886,154.52	
EATON CORP PLC	21,454	92.50	1,984,495.00	
EMERSON ELECTRIC CO	32,855	73.86	2,426,670.30	
FASTENAL COMPANY	29,021	35.52	1,030,825.92	
FLOWSERVE CORPORATION	6,650	48.70	323,855.00	
FORTIVE CORP	16,143	72.17	1,165,040.31	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	63.26	408,027.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,117	181.74	2,383,883.58	
GENERAL ELECTRIC CO	455,110	11.27	5,129,089.70	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	39.82	310,078.34	
HEICO CORP	1,888	129.89	245,232.32	
HEICO CORP-CLASS A	4,435	100.44	445,451.40	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,786	178.55	6,746,690.30	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	251.67	530,268.69	
IDEX CORP	3,839	162.74	624,758.86	
ILLINOIS TOOL WORKS	17,193	174.33	2,997,255.69	
INGERSOLL-RAND PLC	12,228	131.11	1,603,213.08	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	92.09	637,907.43	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	56.22	646,530.00	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	13,100	31.75	415,925.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,358	42.83	1,728,533.14	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,862	201.09	2,385,329.58	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,030	255.85	519,375.50	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,387	391.03	5,234,718.61	
MASCO CORP	14,885	46.55	692,896.75	
MIDDLEBY CORP	2,823	115.76	326,790.48	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,544	351.77	3,005,522.88	
OWENS CORNING	6,518	67.06	437,097.08	
PACCAR INC	17,567	81.37	1,429,426.79	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	6,505	198.79	1,293,128.95	

PENTAIR PLC-REGISTERED	9,953	44.35	441,415.55	
RAYTHEON COMPANY	14,783	217.42	3,214,119.86	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,002	195.84	1,175,431.68	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,265	360.37	1,897,348.05	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,506	51.49	489,463.94	
SMITH(A.O.) CORP	7,157	48.40	346,398.80	
SNAP-ON INC	3,221	160.46	516,841.66	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	86.99	446,867.63	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,684	157.74	1,212,074.16	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,070	341.99	707,919.30	
TEXTRON INC	11,803	46.24	545,770.72	
TRANSDIGM GROUP INC	2,427	567.10	1,376,351.70	
UNITED RENTALS INC	4,233	153.05	647,860.65	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,561	148.34	6,313,498.74	
WABCO HOLDINGS INC	2,598	134.75	350,080.50	
WABTEC CORP	9,231	78.57	725,279.67	
WW GRAINGER INC	2,390	316.95	757,510.50	
XYLEM INC	9,124	77.51	707,201.24	
CINTAS CORP	4,507	257.06	1,158,569.42	
COPART INC	10,456	89.00	930,584.00	
COSTAR GROUP INC	1,853	612.86	1,135,629.58	
EQUIFAX INC	6,127	139.64	855,574.28	
IHS MARKIT LTD	19,257	72.65	1,399,021.05	
MANPOWERGROUP	3,264	92.64	302,376.96	
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	19.55	352,408.30	
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	88.65	1,011,939.75	
ROBERT HALF INTL INC	7,058	58.20	410,775.60	
ROLLINS INC	6,451	35.85	231,268.35	
TRANSUNION	9,497	86.31	819,686.07	
VERISK ANALYTICS INC	7,884	147.48	1,162,732.32	
WASTE CONNECTIONS INC	13,371	90.55	1,210,744.05	
WASTE MANAGEMENT INC	22,639	112.91	2,556,169.49	
AMERCO	390	362.22	141,265.80	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	28.74	163,128.24	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	6,925	76.85	532,186.25	
CSX CORPORATION	38,979	71.54	2,788,557.66	
DELTA AIR LINES INC	8,299	57.31	475,615.69	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,513	74.76	711,191.88	
FEDEX CORP	12,944	160.05	2,071,687.20	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	115.62	509,999.82	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	152.42	777,342.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	8,325	36.99	307,941.75	

NORFOLK SOUTHERN CORP	13,486	193.50	2,609,541.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,284	191.59	629,181.56	
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	57.64	364,054.24	
UBER TECHNOLOGIES INC	9,385	29.60	277,796.00	
UNION PACIFIC CORP	36,763	175.99	6,469,920.37	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	92.80	267,264.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,377	119.73	4,355,418.21	
XPO LOGISTICS INC	4,716	82.69	389,966.04	
APTIV PLC	13,074	93.88	1,227,387.12	
AUTOLIV INC	4,001	81.72	326,961.72	
BORGWARNER INC	12,075	42.05	507,753.75	
FORD MOTOR COMPANY	198,706	9.06	1,800,276.36	
GENERAL MOTORS CO	66,284	36.00	2,386,224.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	36.38	267,283.86	
LEAR CORP	3,525	120.31	424,092.75	
TESLA INC	7,173	329.94	2,366,659.62	
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	37.14	231,345.06	
D.R.HORTON INC	19,074	55.35	1,055,745.90	
GARMIN LTD	6,739	97.69	658,332.91	
HANESBRANDS INC	22,204	15.07	334,614.28	
HASBRO INC	7,338	101.70	746,274.60	
LEGGETT & PLATT INC	6,656	52.32	348,241.92	
LENNAR CORP-CL A	15,664	59.65	934,357.60	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,615	225.69	1,267,249.35	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	139.37	399,016.31	
NEWELL BRANDS INC	18,477	19.22	355,127.94	
NIKE INC -CL B	65,251	93.49	6,100,315.99	
NVR INC	173	3,791.89	655,996.97	
POLARIS INC	2,467	97.70	241,025.90	
PULTE GROUP INC	13,065	39.65	518,027.25	
PVH CORP	3,303	96.96	320,258.88	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,315	107.34	355,832.10	
TAPESTRY INC	14,712	26.89	395,605.68	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	18.89	163,096.26	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	17.30	143,434.30	
VF CORP	17,117	88.54	1,515,539.18	
WHIRLPOOL CORP	3,212	143.10	459,637.20	
ARAMARK	13,242	43.64	577,880.88	
CARNIVAL CORP	21,372	45.08	963,449.76	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,405	813.92	1,143,557.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,722	118.44	796,153.68	
DOMINO'S PIZZA INC	2,219	294.30	653,051.70	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,021	105.00	1,472,205.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	62.75	1,106,533.50	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,352	140.36	2,014,446.72	
MCDONALD'S CORPORATION	39,552	194.48	7,692,072.96	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,525	21.28	245,252.00	
MGM MIRAGE	25,878	31.95	826,802.10	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,922	53.64	585,856.08	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	120.02	1,084,500.72	
STARBUCKS CORP	62,970	85.43	5,379,527.10	
VAIL RESORTS INC	2,038	242.67	494,561.46	
WYNN RESORTS LTD	4,913	120.85	593,736.05	
YUM! BRANDS INC	15,515	100.67	1,561,895.05	
ACTIVISION BLIZZARD INC	41,089	54.83	2,252,909.87	
ALPHABET INC-CL A	15,639	1,304.09	20,394,663.51	
ALPHABET INC-CL C	16,320	1,304.96	21,296,947.20	
ALTICE USA INC-A	6,300	25.58	161,154.00	
CBS CORP-CL B	18,289	40.38	738,509.82	
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,985	470.01	3,753,029.85	
COMCAST CORP-CLASS A	237,462	44.15	10,483,947.30	
DISCOVERY INC-A	7,075	32.94	233,050.50	
DISCOVERY INC-C	18,283	30.52	557,997.16	
DISH NETWORK CORP-RIGHTS	664	0.68	451.52	
DISH NETWORK CORP.	12,273	34.17	419,368.41	
ELECTRONIC ARTS INC	15,073	101.01	1,522,523.73	
FACEBOOK INC-A	125,223	201.64	25,249,965.72	
FOX CORPORATION-CLASS A	19,769	35.76	706,939.44	
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	34.98	306,879.54	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	222.70	885,009.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	22.40	439,622.40	
LIBERTY BROADBAND-C	5,418	119.49	647,396.82	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	22.55	190,141.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	21.50	453,198.50	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	45.09	463,885.92	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	48.51	371,004.48	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	48.70	201,666.70	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	69.81	524,412.72	
MATCH GROUP INC	3,732	70.48	263,031.36	
NETFLIX INC	22,692	314.66	7,140,264.72	
NEWS CORP-CLASS A	16,662	12.88	214,606.56	
OMNICOM GROUP	11,898	79.48	945,653.04	
PINTEREST INC- CLASS A	10,948	19.48	213,267.04	
ROKU INC	4,624	160.37	741,550.88	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	81,768	6.98	570,740.64	
SNAP INC-A	35,102	15.25	535,305.50	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	121.35	692,544.45	
THE WALT DISNEY CO.	94,182	151.58	14,276,107.56	
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	28.40	115,048.40	
TWITTER INC	37,026	30.91	1,144,473.66	
VIACOM INC-CLASS B	20,275	24.07	488,019.25	
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	39.15	208,278.00	
ADVANCE AUTO PARTS	4,057	157.08	637,273.56	
AMAZON.COM INC	21,921	1,800.80	39,475,336.80	
AUTOZONE INC	1,248	1,177.92	1,470,044.16	
BEST BUY COMPANY INC	13,082	80.64	1,054,932.48	
BOOKING HOLDINGS INC	2,256	1,904.03	4,295,491.68	
BURLINGTON STORES INC	3,749	225.00	843,525.00	
CARMAX INC	8,427	97.26	819,610.02	
DOLLAR GENERAL CORP	13,099	157.36	2,061,258.64	
DOLLAR TREE INC	12,047	91.46	1,101,818.62	
EBAY INC	41,983	35.52	1,491,236.16	
EXPEDIA GROUP INC	7,538	101.66	766,313.08	
GAP INC/THE	9,218	16.61	153,110.98	
GENUINE PARTS CO	7,406	104.37	772,964.22	
GRUBHUB INC	4,403	43.12	189,857.36	
HOME DEPOT INC	57,288	220.51	12,632,576.88	
KOHLS CORP	8,274	47.01	388,960.74	
LKQ CORPORATION	15,922	35.28	561,728.16	
LOWE'S COMPANIES INC	40,915	117.31	4,799,738.65	
MERCADOLIBRE INC	2,251	580.58	1,306,885.58	
NORDSTROM INC	4,756	38.17	181,536.52	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,969	442.28	1,755,409.32	
ROSS STORES INC	18,632	116.15	2,164,106.80	
TARGET CORP	27,081	125.01	3,385,395.81	
TIFFANY & CO	5,541	133.80	741,385.80	
TJX COMPANIES INC	62,529	61.13	3,822,397.77	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	94.44	577,689.48	
ULTA BEAUTY INC	3,061	233.86	715,845.46	
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	84.92	245,164.04	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,816	299.81	6,840,464.96	
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	5.85	78,975.00	
KROGER CO	40,905	27.34	1,118,342.70	
SYSCO CORP	26,157	80.55	2,106,946.35	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,407	59.60	2,348,657.20	
WALMART INC	74,217	119.09	8,838,502.53	

ALTRIA GROUP INC	97,572	49.70	4,849,328.40	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	42.93	1,219,383.72	
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	67.82	1,059,348.40	
BUNGE LIMITED	7,174	53.38	382,948.12	
CAMPBELL SOUP CO	7,879	46.57	366,925.03	
COCA-COLA CO/THE	212,612	53.40	11,353,480.80	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	12,575	50.46	634,534.50	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	28.87	711,327.93	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,046	186.06	1,683,098.76	
GENERAL MILLS INC	32,584	53.32	1,737,378.88	
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	44.53	665,233.67	
INGREDION INC	3,320	83.17	276,124.40	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	105.09	606,159.12	
KELLOGG CO	12,949	65.12	843,238.88	
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	30.50	1,037,274.50	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	83.98	622,879.66	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,209	169.25	1,050,873.25	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	9,629	50.48	486,071.92	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	75,167	52.54	3,949,274.18	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	20,672	59.82	1,236,599.04	
PEPSICO INC	72,524	135.83	9,850,934.92	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	80,763	82.93	6,697,675.59	
THE HERSHEY COMPANY	7,514	148.16	1,113,274.24	
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	89.89	1,343,765.61	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	70.24	876,946.40	
CLOROX COMPANY	6,458	148.23	957,269.34	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	43,353	67.82	2,940,200.46	
COTY INC-CL A	16,985	11.54	196,006.90	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,834	195.47	2,313,191.98	
KIMBERLY-CLARK CORP	18,379	136.34	2,505,792.86	
PROCTER & GAMBLE CO	130,780	122.06	15,963,006.80	
ABBOTT LABORATORIES	91,997	85.45	7,861,143.65	
ABIOMED INC	2,288	196.18	448,859.84	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	277.34	1,068,868.36	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	87.91	702,664.63	
ANTHEM INC	13,527	288.66	3,904,703.82	
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,576	81.97	2,014,494.72	
BECTON DICKINSON & CO	14,104	258.50	3,645,884.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,882	43.25	3,108,896.50	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	55.03	831,723.42	
CENTENE CORP	20,961	60.47	1,267,511.67	
CERNER CORP	16,501	71.59	1,181,306.59	

CIGNA CORPORATION	19,961	199.92	3,990,603.12	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,509	313.09	785,542.81	
CVS HEALTH CORPORATION	67,717	75.27	5,097,058.59	
DANAHER CORP	33,565	145.98	4,899,818.70	
DAVITA INC	5,115	71.77	367,103.55	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	56.54	670,790.56	
DEXCOM INC	4,617	227.31	1,049,490.27	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,573	244.94	2,589,750.62	
HCA HEALTHCARE INC	13,886	138.66	1,925,432.76	
HENRY SCHEIN INC	7,559	68.90	520,815.10	
HOLOGIC INC	13,592	51.32	697,541.44	
HUMANA INC.	7,214	341.23	2,461,633.22	
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	251.58	1,097,140.38	
INSULET CORP	3,486	185.70	647,350.20	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,108	592.90	3,621,433.20	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	172.29	860,588.55	
MCKESSON CORP	9,632	144.64	1,393,172.48	
MEDTRONIC PLC	70,394	111.39	7,841,187.66	
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	106.55	726,031.70	
RESMED INC	7,271	149.60	1,087,741.60	
STERIS PLC	4,287	151.14	647,937.18	
STRYKER CORP	17,576	204.86	3,600,619.36	
TELEFLEX INC	2,340	353.34	826,815.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,121	279.87	13,747,494.27	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	139.49	586,276.47	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,195	133.73	694,727.35	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,481	149.18	966,835.58	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,551	322.07	821,600.57	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,260	147.03	626,347.80	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,385	145.28	1,508,732.80	
ABBVIE INC	76,817	87.73	6,739,155.41	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,023	80.77	1,294,177.71	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,370	113.94	1,295,497.80	
ALLERGAN PLC	17,411	184.94	3,219,990.34	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	117.14	657,506.82	
AMGEN INC	31,456	234.72	7,383,352.32	
BEIGENE LTD-ADR	1,977	203.29	401,904.33	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,328	369.38	490,536.64	
BIOGEN INC	9,832	299.81	2,947,731.92	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	80.71	732,846.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	122,110	56.94	6,952,943.40	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,964	27.71	497,782.44	

ELI LILLY & CO	45,471	117.35	5,336,021.85	
EXACT SCIENCES CORP	8,404	81.01	680,808.04	
GILEAD SCIENCES INC	66,294	67.24	4,457,608.56	
ILLUMINA INC	7,454	320.76	2,390,945.04	
INCYTE CORP	9,243	94.16	870,320.88	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	63.96	432,369.60	
IQVIA HOLDINGS INC	8,501	145.98	1,240,975.98	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	151.12	393,516.48	
JOHNSON & JOHNSON	137,822	137.49	18,949,146.78	
MERCK & CO. INC.	132,835	87.18	11,580,555.30	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	719.41	905,017.78	
MYLAN NV	26,138	18.78	490,871.64	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,068	116.61	590,979.48	
PERKINELMER INC	5,624	92.90	522,469.60	
PERRIGO CO PLC	7,737	51.23	396,366.51	
PFIZER INC	287,130	38.52	11,060,247.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,097	369.00	1,511,793.00	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,481	112.49	504,067.69	
SEATTLE GENETICS INC	5,726	120.35	689,124.10	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	56,969	10.42	593,616.98	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,776	313.95	6,522,625.20	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,196	221.75	2,926,213.00	
WATERS CORP	3,523	222.07	782,352.61	
ZOETIS INC	25,373	120.52	3,057,953.96	
BANK OF AMERICA CORP	462,152	33.32	15,398,904.64	
BB & T CORPORATION	38,838	54.72	2,125,215.36	
CITIGROUP INC	118,413	75.12	8,895,184.56	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,242	38.46	893,887.32	
COMERICA INC	8,806	70.41	620,030.46	
EAST WEST BANCORP INC	8,825	45.82	404,361.50	
FIFTH THIRD BANCORP	37,239	30.19	1,124,245.41	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,184	109.90	1,009,321.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	14.89	790,093.18	
JPMORGAN CHASE & CO	166,908	131.76	21,991,798.08	
KEYCORP	51,128	19.39	991,371.92	
M & T BANK CORP	6,581	164.74	1,084,153.94	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	16.50	333,300.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,631	153.21	3,620,505.51	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	55,875	16.64	929,760.00	
SIGNATURE BANK	2,508	123.36	309,386.88	
SUNTRUST BANKS INC	22,505	70.84	1,594,254.20	
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	231.73	611,767.20	

US BANCORP	78,877	60.03	4,734,986.31	
WELLS FARGO & COMPANY	219,017	54.46	11,927,665.82	
ZIONS BANCORPORATION	8,874	49.78	441,747.72	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	31.84	641,225.76	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	37,005	120.12	4,445,040.60	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,790	163.87	1,112,677.30	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	24.74	564,566.80	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	43,698	48.97	2,139,891.06	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	68,836	220.30	15,164,570.80	
BLACKROCK INC	6,162	494.91	3,049,635.42	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	35,630	54.22	1,931,858.60	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,111	100.01	2,511,351.11	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	118.90	673,092.90	
CME GROUP INC.	18,686	202.73	3,788,212.78	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,415	84.87	1,393,141.05	
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	12,407	44.30	549,630.10	
EATON VANCE CORP	5,530	47.17	260,850.10	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	259.65	503,461.35	
FRANKLIN RESOURCES INC	17,818	27.49	489,816.82	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,970	221.35	3,756,309.50	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,592	94.17	2,692,508.64	
INVESCO LIMITED	18,328	17.56	321,839.68	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	20.90	269,296.50	
KKR & CO INC -A	24,824	29.49	732,059.76	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	403.82	772,103.84	
MOODY'S CORP	8,653	226.67	1,961,375.51	
MORGAN STANLEY	63,976	49.48	3,165,532.48	
MSCI INC-A	4,294	259.19	1,112,961.86	
NASDAQ INC	6,566	104.80	688,116.80	
NORTHERN TRUST CORP	10,486	107.24	1,124,518.64	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	89.82	577,183.32	
S&P GLOBAL INC	12,894	264.65	3,412,397.10	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,925	49.50	3,015,787.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,655	64.53	493,977.15	
STATE STREET CORP	18,922	75.10	1,421,042.20	
SYNCHRONY FINANCIAL	31,458	37.41	1,176,843.78	
T ROWE PRICE GROUP INC	11,991	123.56	1,481,607.96	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	51.83	727,071.24	
VOYA FINANCIAL INC	7,308	58.28	425,910.24	
AFLAC INC	37,801	54.84	2,073,006.84	
ALLEGHANY CORPORATION	805	780.04	627,932.20	
ALLSTATE CORP	16,891	111.35	1,880,812.85	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	109.71	388,263.69	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	46,438	52.66	2,445,425.08	
AON PLC	12,196	203.61	2,483,227.56	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	41.97	859,377.72	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	93.27	876,178.38	
ASSURANT INC	3,114	132.87	413,757.18	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	45.02	369,118.98	
BROWN & BROWN INC	14,075	37.74	531,190.50	
CHUBB LTD	23,926	151.48	3,624,310.48	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	107.05	841,198.90	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	169.30	218,058.40	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	271.26	560,151.90	
FNF GROUP	13,937	47.63	663,819.31	
GLOBE LIFE INC	5,900	102.76	606,284.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	61.86	1,133,955.66	
LINCOLN NATIONAL CORP	11,217	59.05	662,363.85	
LOEWS CORPORATION	13,914	50.90	708,222.60	
MARKEL CORP	702	1,135.55	797,156.10	
MARSH & MCLENNAN COS	25,929	108.07	2,802,147.03	
METLIFE INC	40,962	49.91	2,044,413.42	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	55.10	778,232.40	
PROGRESSIVE CORP	29,612	73.05	2,163,156.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,587	93.62	1,927,354.94	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	165.46	500,020.12	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	188.33	421,670.87	
TRAVELERS COS INC(THE)	13,281	136.72	1,815,778.32	
UNUM GROUP	9,769	30.74	300,299.06	
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	68.00	505,104.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,553	196.44	1,287,271.32	
CBRE GROUP INC-A	16,199	57.02	923,666.98	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,818	133.66	2,916,193.88	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.50	287,650.00	
JONES LANG LASALLE INC	2,618	166.33	435,451.94	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,743	236.47	1,358,047.21	
ACCENTURE PLC-CL A	33,117	201.16	6,661,815.72	
ADOBE INC	25,305	309.53	7,832,656.65	
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	87.12	724,925.52	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	106.91	237,554.02	
ANSYS INC	4,256	254.69	1,083,960.64	
AUTODESK INC	11,164	180.90	2,019,567.60	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,908	170.78	3,912,228.24	
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	8,792	63.01	553,983.92	

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,163	72.76	593,939.88	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	123.71	728,528.19	
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	70.25	1,001,062.50	
CDK GLOBAL INC	7,488	53.55	400,982.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,598	117.88	777,772.24	
CITRIX SYSTEMS INC	6,676	112.81	753,119.56	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,867	64.11	1,850,663.37	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,311	122.55	283,213.05	
DOCUSIGN INC	5,401	71.21	384,605.21	
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	18.49	195,346.85	
DXC TECHNOLOGY CO	15,824	37.33	590,709.92	
EPAM SYSTEMS INC	3,084	211.85	653,345.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,001	138.15	4,420,938.15	
FISERV INC	30,614	116.24	3,558,571.36	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	306.92	1,341,547.32	
FORTINET INC	7,360	105.11	773,609.60	
GARTNER INC	4,568	160.46	732,981.28	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,963	181.10	2,890,899.30	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	66.38	591,113.90	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,792	121.83	583,809.36	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,010	134.45	6,186,044.50	
INTUIT INC	13,775	258.89	3,566,209.75	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	151.94	594,845.10	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	90.84	631,065.48	
MASTERCARD INC-CL A	46,953	292.23	13,721,075.19	
MICROSOFT CORP	377,980	151.38	57,218,612.40	
MONGODB INC	1,890	148.70	281,043.00	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	24.90	780,540.30	
OKTA INC	5,270	129.78	683,940.60	
ORACLE CORPORATION	122,640	56.14	6,885,009.60	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,867	227.22	1,105,879.74	
PAYCHEX INC	16,401	86.12	1,412,454.12	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	276.81	698,114.82	
PAYPAL HOLDINGS INC	57,971	108.01	6,261,447.71	
PTC INC	5,462	76.60	418,389.20	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,101	172.47	707,299.47	
SABRE CORP	13,930	22.43	312,449.90	
SALESFORCE.COM,INC.	43,147	162.89	7,028,214.83	
SERVICENOW INC	9,978	283.04	2,824,173.12	
SPLUNK INC	7,614	149.22	1,136,161.08	
SQUARE INC-A	17,051	69.12	1,178,565.12	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	60.05	693,337.30	

SYNOPSYS INC	7,601	141.04	1,072,045.04	
TWILIO INC-A	5,649	103.28	583,428.72	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,223	290.17	645,047.91	
VERISIGN INC	5,439	190.74	1,037,434.86	
VISA INC	90,236	184.51	16,649,444.36	
VMWARE INC	4,194	155.62	652,670.28	
WESTERN UNION COMPANY	21,840	26.88	587,059.20	
WIX.COM LTD	2,419	120.89	292,432.91	
WORKDAY INC-CLASS A	8,894	179.12	1,593,093.28	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,148	104.00	1,575,392.00	
APPLE INC	235,469	267.25	62,929,090.25	
ARISTA NETWORKS INC	2,720	195.13	530,753.60	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	79.64	328,913.20	
CDW CORP/DE	7,404	135.05	999,910.20	
CISCO SYSTEMS INC	224,197	45.31	10,158,366.07	
COGNEX CORP	8,698	50.18	436,465.64	
CORNING INC	39,793	29.04	1,155,588.72	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,900	48.49	383,071.00	
F5 NETWORKS INC	3,504	145.71	510,567.84	
FLEX LTD	23,204	11.87	275,431.48	
FLIR SYSTEMS INC	6,867	53.56	367,796.52	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	67,905	15.83	1,074,936.15	
HP INC	76,380	20.08	1,533,710.40	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	142.09	252,351.84	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	25.06	437,547.60	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	107.03	1,021,280.26	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,356	167.30	1,397,958.80	
NETAPP INC	12,523	60.59	758,768.57	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	59.68	753,997.12	
TE CONNECTIVITY LTD	17,082	92.71	1,583,672.22	
TRIMBLE INC	12,759	40.53	517,122.27	
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	50.33	747,752.81	
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	38.93	377,504.21	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	250.94	686,822.78	
AT&T INC	381,980	37.38	14,278,412.40	
CENTURYLINK INC	49,758	14.49	720,993.42	
SPRINT CORP	36,740	5.92	217,500.80	
T-MOBILE US INC	17,328	78.55	1,361,114.40	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	216,321	60.24	13,031,177.04	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,946	34.24	409,031.04	
AES CORPORATION	33,656	18.91	636,434.96	
ALLIANT ENERGY CORP	13,283	53.00	703,999.00	

AMEREN CORPORATION	12,454	74.33	925,705.82	
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,377	91.35	2,409,538.95	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	121.03	1,107,908.62	
AQUA AMERICA INC	12,653	44.27	560,148.31	
ATMOS ENERGY CORP	6,436	106.96	688,394.56	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	24.56	625,395.84	
CMS ENERGY CORPORATION	15,038	61.30	921,829.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,005	86.89	1,564,454.45	
DOMINION ENERGY INC	43,524	83.11	3,617,279.64	
DTE ENERGY COMPANY	9,290	124.94	1,160,692.60	
DUKE ENERGY CORP	37,518	88.17	3,307,962.06	
EDISON INTERNATIONAL	17,941	69.10	1,239,723.10	
ENTERGY CORP	10,703	116.39	1,245,722.17	
EVERGY INC	12,378	63.27	783,156.06	
EVERSOURCE ENERGY	17,595	82.64	1,454,050.80	
EXELON CORP	49,234	44.40	2,185,989.60	
FIRSTENERGY CORP	26,948	47.69	1,285,150.12	
NEXTERA ENERGY INC	24,938	233.82	5,831,003.16	
NISOURCE INC	18,919	26.45	500,407.55	
NRG ENERGY INC	13,547	39.73	538,222.31	
OGE ENERGY CORP	11,680	42.06	491,260.80	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	87.39	523,990.44	
PPL CORPORATION	36,597	34.03	1,245,395.91	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25,629	59.31	1,520,055.99	
SEMPRA ENERGY	13,913	147.27	2,048,967.51	
SOUTHERN CO	54,470	61.99	3,376,595.30	
UGI CORPORATION	10,588	43.55	461,107.40	
VISTRA ENERGY CORP	18,354	26.53	486,931.62	
WEC ENERGY GROUP INC	15,995	88.65	1,417,956.75	
XCEL ENERGY INC	26,098	61.49	1,604,766.02	
ADVANCED MICRO DEVICES	55,256	39.15	2,163,272.40	
ANALOG DEVICES INC	18,750	112.95	2,117,812.50	
APPLIED MATERIALS INC	47,467	57.90	2,748,339.30	
BROADCOM INC	20,560	316.21	6,501,277.60	
INTEL CORP	231,361	58.05	13,430,506.05	
KLA CORPORATION	8,195	163.86	1,342,832.70	
LAM RESEARCH CORP	7,602	266.83	2,028,441.66	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,750	26.37	837,247.50	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	56.67	782,839.38	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,065	94.54	1,140,625.10	
MICRON TECHNOLOGY INC	58,801	47.51	2,793,635.51	
NVIDIA CORP	30,053	216.74	6,513,687.22	

	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,993	115.58	1,732,890.94	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	21.47	448,980.64	
	QORVO INC	6,042	104.21	629,636.82	
	QUALCOMM INC	63,277	83.55	5,286,793.35	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	98.30	860,813.10	
	TERADYNE INC	9,842	62.59	616,010.78	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,697	120.21	5,853,866.37	
	XILINX INC	12,876	92.78	1,194,635.28	
米ドル 小計		15,614,280		1,396,454,502.21 (153,163,129,802)	
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	12.10	198,246.40	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	62,867	37.11	2,332,994.37	
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	11.74	634,171.32	
	ENBRIDGE INC	104,247	50.30	5,243,624.10	
	ENCANA CORP	66,377	5.21	345,824.17	
	HUSKY ENERGY INC	14,553	9.67	140,727.51	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	33.26	432,346.74	
	INTER PIPELINE LTD	25,248	22.00	555,456.00	
	KEYERA CORP	11,374	32.41	368,631.34	
	PARKLAND FUEL CORP	7,666	47.22	361,988.52	
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	46.38	1,271,322.18	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	13.70	123,820.60	
	SUNCOR ENERGY INC	81,480	41.43	3,375,716.40	
	TC ENERGY CORP	48,116	67.20	3,233,395.20	
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	78.92	939,542.60	
	BARRICK GOLD CORP	93,270	22.18	2,068,728.60	
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	9,178	56.81	521,402.18	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	12.15	384,814.80	
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,493	130.67	1,240,450.31	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	5.74	364,495.74	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,329	55.79	632,044.91	
	LUNDIN MINING CORP	28,209	7.19	202,822.71	
	METHANEX CORPORATION	2,452	49.43	121,202.36	
	NUTRIEN LTD	30,042	62.70	1,883,633.40	
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	20.80	516,131.20	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	57.77	165,973.21	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,695	36.50	901,367.50	
	BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.97	149,428.44	
	CAE INC	12,891	35.69	460,079.79	
	WSP GLOBAL INC	6,393	85.73	548,071.89	
	THOMSON REUTERS CORP	11,002	92.88	1,021,865.76	
	AIR CANADA	5,737	50.05	287,136.85	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,223	120.61	4,489,466.03	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,090	314.57	2,230,301.30	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,621	73.18	1,216,324.78	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	39.00	353,574.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,035	87.27	1,137,564.45	
STARS GROUP INC/THE	14,575	31.83	463,922.25	
QUEBECOR INC -CL B	9,953	32.94	327,851.82	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,532	27.45	728,303.40	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,540	154.76	547,850.40	
DOLLARAMA INC	14,542	48.59	706,595.78	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	46,234	43.46	2,009,329.64	
EMPIRE CO LTD A	7,235	35.57	257,348.95	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	71.60	611,392.40	
METRO INC	14,249	58.18	829,006.82	
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	108.04	462,519.24	
SAPUTO INC	13,425	40.15	539,013.75	
AURORA CANNABIS INC	28,563	3.32	94,829.16	
BAUSCH HEALTH COS INC	19,049	37.52	714,718.48	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	24.51	275,762.01	
CRONOS GROUP INC	8,026	9.03	72,474.78	
BANK OF MONTREAL	33,657	102.22	3,440,418.54	
BANK OF NOVA SCOTIA	62,983	74.94	4,719,946.02	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,547	115.46	2,603,276.62	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	71.15	1,209,051.95	
ROYAL BANK OF CANADA	75,390	108.73	8,197,154.70	
TORONTO-DOMINION BANK	95,034	76.59	7,278,654.06	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	46,422	76.85	3,567,530.70	
CI FINANCIAL CORP	11,041	20.92	230,977.72	
IGM FINANCIAL INC	6,433	38.20	245,740.60	
ONEX CORPORATION	4,217	79.10	333,564.70	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	600.01	835,813.93	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	33.45	474,990.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	68.00	329,868.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	136.97	966,734.26	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,811	26.13	2,608,061.43	
POWER CORP OF CANADA	14,595	32.24	470,542.80	
POWER FINANCIAL CORP	16,201	32.48	526,208.48	
SUN LIFE FINANCIAL INC	30,089	60.61	1,823,694.29	
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.58	141,262.68	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	7.33	190,528.69	
CGI INC-CL A	12,438	110.07	1,369,050.66	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,106	1,420.01	1,570,531.06	

	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	57.83	790,246.95	
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,177	445.45	2,306,094.65	
	BCE INC	8,379	63.94	535,753.26	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,323	64.42	1,180,367.66	
	TELUS CORPORATION	7,611	50.15	381,691.65	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	30,273	18.63	563,985.99	
	ALTAGAS LTD	17,347	19.70	341,735.90	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	50.39	152,681.70	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	39.06	286,856.64	
	EMERA INC	13,403	54.62	732,071.86	
	FORTIS INC	21,905	52.04	1,139,936.20	
	HYDRO ONE LTD	15,052	25.02	376,601.04	
カナダドル 小計		2,080,622		101,017,231.93 (8,346,043,702)	
ユーロ	ENI SPA	130,479	13.71	1,789,389.00	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	14.77	356,890.12	
	NESTE OYJ	22,758	30.68	698,215.44	
	OMV AG	7,781	51.74	402,588.94	
	REPSOL SA	73,682	14.29	1,052,915.78	
	TENARIS S.A.	25,963	9.65	250,594.87	
	TOTAL SA	126,064	47.64	6,005,688.96	
	VOPAK	3,130	48.39	151,460.70	
	AIR LIQUIDE SA	24,407	123.05	3,003,281.35	
	AKZO NOBEL	12,200	86.92	1,060,424.00	
	ARCELORMITTAL	35,989	15.52	558,837.19	
	ARKEMA	3,250	94.06	305,695.00	
	BASF SE	48,160	68.22	3,285,475.20	
	COVESTRO AG	8,053	42.50	342,252.50	
	CRH PLC	40,685	34.73	1,412,990.05	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,836	26.34	311,760.24	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	39.20	132,104.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,350	67.10	560,285.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,200	116.30	1,069,960.00	
	LANXESS	4,409	60.50	266,744.50	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	32.20	368,400.20	
	SOLVAY SA	3,758	104.00	390,832.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	12.20	301,449.80	
	SYMRISE AG	6,524	88.04	574,372.96	
	THYSSENKRUPP AG	19,367	11.38	220,396.46	
	UMICORE	11,350	38.98	442,423.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	29,092	30.32	882,069.44	
	VOESTALPINE AG	5,079	24.05	122,149.95	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,575	35.33	514,934.75	
AIRBUS SE	30,025	133.40	4,005,335.00	
ALSTOM RGPT	9,668	39.58	382,659.44	
ANDRITZ AG	3,728	35.40	131,971.20	
BOUYGUES SA	11,049	37.08	409,696.92	
BRENNTAG AG	9,172	48.41	444,016.52	
CNH INDUSTRIAL NV	57,033	9.72	554,817.02	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	36.75	940,175.25	
DASSAULT AVIATION SA	172	1,235.00	212,420.00	
EIFFAGE SA	4,641	99.10	459,923.10	
FERROVIAL SA	23,114	26.95	622,922.30	
FERROVIAL SA-RIGHTS	23,114	0.42	9,714.81	
GEA GROUP AG	8,178	29.17	238,552.26	
HOCHTIEF AG	825	111.50	91,987.50	
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	48.92	373,357.44	
KION GROUP AG	3,179	60.22	191,439.38	
KNORR-BREMSE AG	2,138	88.28	188,742.64	
KONE OYJ-B	18,260	56.82	1,037,533.20	
LEGRAND SA	14,350	71.68	1,028,608.00	
LEONARDO SPA	18,310	10.61	194,360.65	
METSO OYJ	5,880	34.80	204,624.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,856	245.90	702,290.40	
PRYSMIAN SPA	11,926	20.69	246,748.94	
SAFRAN SA	17,196	148.45	2,552,746.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,565	87.60	2,502,294.00	
SIEMENS AG-REG	40,298	117.12	4,719,701.76	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	14.48	166,316.77	
THALES SA	5,403	88.92	480,434.76	
VINCI S.A.	26,415	98.98	2,614,556.70	
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	9.13	172,697.80	
BUREAU VERITAS SA	17,235	23.76	409,503.60	
EDENRED	12,139	45.05	546,861.95	
RANDSTAD NV	4,694	52.86	248,124.84	
TELEPERFORMANCE	2,970	215.00	638,550.00	
WOLTERS KLUWER-CVA	14,924	65.16	972,447.84	
AENA SME SA	3,741	166.70	623,624.70	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	177.50	238,915.00	
ATLANTIA SPA	26,501	20.12	533,200.12	
BOLLORE	39,433	3.88	153,000.04	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	17.22	159,457.20	
DEUTSCHE POST AG-REG	51,919	33.84	1,756,938.96	
FRAPORT AG	1,856	77.32	143,505.92	

GETLINK	22,311	15.31	341,581.41	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,789	73.30	1,230,633.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	56.00	140,448.00	
CONTINENTAL AG	5,578	118.60	661,550.80	
DAIMLER AG	48,407	51.20	2,478,438.40	
FAURECIA	3,127	48.14	150,533.78	
FERRARI NV	6,579	153.40	1,009,218.60	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,491	13.42	798,369.22	
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	108.90	952,439.40	
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	24.56	135,251.92	
PIRELLI & C SPA	17,484	5.15	90,042.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	67.18	521,652.70	
PSA PEUGEOT CITROEN	32,147	21.92	704,662.24	
RENAULT SA	8,830	43.45	383,707.65	
VALEO SA	14,048	35.76	502,356.48	
VOLKSWAGEN AG	1,984	173.15	343,529.60	
VOLKSWAGEN AG PFD	9,410	175.48	1,651,266.80	
ADIDAS AG	9,463	282.75	2,675,663.25	
ESSILORLUXOTTICA	14,780	141.00	2,083,980.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,690	680.00	1,149,200.00	
KERING	3,987	546.70	2,179,692.90	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,611	407.30	5,951,060.30	
MONCLER SPA	7,711	39.77	306,666.47	
PUMA SE	3,830	68.20	261,206.00	
SEB SA	1,032	141.00	145,512.00	
ACCOR SA	10,680	38.83	414,704.40	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,596	104.00	477,984.00	
SODEXO	3,900	105.80	412,620.00	
ALTICE NV -A W/I	37,625	5.40	203,250.25	
AXEL SPRINGER SE-TEND	2,343	62.50	146,437.50	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	14.89	129,930.14	
JC DECAUX SA	2,828	26.00	73,528.00	
PUBLICIS GROUPE	10,736	39.94	428,795.84	
SES	17,687	12.04	213,039.91	
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	40.96	89,333.76	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,215	55.10	287,346.50	
VIVENDI SA	47,533	24.92	1,184,522.36	
DELIVERY HERO SE	5,334	48.00	256,032.00	
INDITEX	55,694	28.26	1,573,912.44	
PROSUS NV	25,486	61.87	1,576,818.82	
ZALANDO SE	8,284	39.10	323,904.40	
CARREFOUR SA	35,128	14.98	526,217.44	

CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	39.94	73,210.02	
COLRUYT NV	2,472	47.00	116,184.00	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	14.49	179,404.61	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	60,023	23.38	1,403,637.85	
METRO AG	8,344	14.62	122,031.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,222	71.87	2,818,885.14	
DANONE	31,976	74.72	2,389,246.72	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	36,148	8.28	299,486.18	
HEINEKEN HOLDING NV	6,520	87.00	567,240.00	
HEINEKEN NV	13,143	94.04	1,235,967.72	
KERRY GROUP PLC-A	8,352	116.40	972,172.80	
PERNOD-RICARD SA	11,091	166.70	1,848,869.70	
REMY COINTREAU	1,273	116.90	148,813.70	
BEIERSDORF AG	5,600	105.85	592,760.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,742	87.80	504,147.60	
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	95.88	867,042.84	
L'OREAL	12,957	258.70	3,351,975.90	
UNILEVER NV	76,386	53.80	4,109,566.80	
BIOMERIEUX	1,779	82.05	145,966.95	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	111.00	251,859.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,928	66.56	727,367.68	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,162	49.64	1,050,481.68	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	46,965	42.14	1,979,339.92	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	191.30	345,105.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,711	44.02	383,458.22	
BAYER AG	48,080	68.70	3,303,096.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	701	476.60	334,096.60	
GALAPAGOS NV	2,318	178.85	414,574.30	
GRIFOLS S.A.	17,072	31.01	529,402.72	
IPSEN	1,498	102.50	153,545.00	
MERCK KGAA	6,553	106.00	694,618.00	
ORION OYJ	4,259	39.50	168,230.50	
QIAGEN N.V.	13,803	38.86	536,384.58	
RECORDATI SPA	4,578	38.07	174,284.46	
SANOFI	59,320	84.51	5,013,133.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	144.10	224,075.50	
UCB SA	7,209	73.56	530,294.04	
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	15.49	293,008.84	
AIB GROUP PLC	36,918	2.97	109,646.46	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	343,002	4.78	1,640,064.06	
BANCO DE SABADELL SA	328,020	1.00	330,316.14	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06	

BANCO SANTANDER SA	852,250	3.53	3,014,408.25	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,159	4.56	237,845.04	
BANKIA SA	82,022	1.75	144,235.68	
BANKINTER,S.A.	36,405	6.34	231,098.94	
BNP PARIBAS	57,737	50.97	2,942,854.89	
CAIXABANK	181,981	2.67	487,527.09	
COMMERZBANK AG	46,644	5.26	245,394.08	
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	12.41	721,808.10	
ERSTE GROUP BANK AG	16,973	32.50	551,622.50	
FINECOBANK SPA	32,034	11.26	360,702.84	
ING GROEP NV-CVA	203,129	10.44	2,121,479.27	
INTESA SANPAOLO	779,261	2.30	1,792,689.93	
KBC GROUPE SA	12,946	66.14	856,248.44	
MEDIOBANCA SPA	26,782	10.15	271,837.30	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	21.31	117,311.55	
SOCIETE GENERALE	41,025	28.56	1,171,674.00	
UNICREDIT SPA	106,885	12.56	1,342,689.37	
AMUNDI SA	3,955	68.70	271,708.50	
DEUTSCHE BANK AG -REG	99,560	6.54	651,520.64	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,634	139.25	1,341,534.50	
EURAZEO	1,792	61.85	110,835.20	
EXOR NV	6,370	69.44	442,332.80	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,728	92.10	435,448.80	
NATIXIS	45,362	3.79	172,058.06	
WENDEL	1,082	122.30	132,328.60	
AEGON NV	91,609	4.09	374,864.02	
AGEAS	8,765	54.48	477,517.20	
ALLIANZ SE-REG	22,062	217.35	4,795,175.70	
ASSICURAZIONI GENERALI	58,634	18.53	1,086,488.02	
AXA SA	102,803	24.69	2,538,720.08	
CNP ASSURANCES	8,978	17.92	160,885.76	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	168.50	515,273.00	
MAPFRE SA	46,367	2.55	118,653.15	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,693	260.60	2,004,795.80	
NN GROUP NV	15,922	34.84	554,722.48	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.59	281,291.58	
SAMPO OYJ-A SHS	23,650	36.70	867,955.00	
SCOR SE	9,581	38.99	373,563.19	
AROUNDTOWN SA	45,883	7.88	361,649.80	
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	35.45	643,204.80	
VONOVIA SE	27,565	47.29	1,303,548.85	
ADYEN NV	622	696.20	433,036.40	

	AMADEUS IT GROUP SA	22,251	72.30	1,608,747.30	
	ATOS SE	4,547	77.08	350,482.76	
	CAPGEMINI SA	8,059	107.35	865,133.65	
	DASSAULT SYSTEMES SA	6,666	143.00	953,238.00	
	SAP SE	50,988	123.48	6,295,998.24	
	WIRECARD AG	5,952	119.80	713,049.60	
	WORLDLINE SA	6,228	58.75	365,895.00	
	INGENICO S.A.	2,691	96.86	260,650.26	
	NOKIA OYJ	285,784	3.21	917,795.31	
	CELLNEX TELECOM SA	13,722	39.00	535,158.00	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	173,491	15.23	2,643,308.87	
	ELISA OYJ	8,333	48.51	404,233.83	
	ILIAD SA	1,016	115.55	117,398.80	
	KONINKLIJKE KPN NV	199,601	2.79	558,084.39	
	ORANGE S.A.	104,864	15.00	1,572,960.00	
	PROXIMUS SA	6,313	27.38	172,849.94	
	TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.56	279,544.17	
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.55	140,520.30	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.77	111,931.77	
	TELEFONICA S.A.	240,639	6.95	1,672,922.32	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,861	30.75	210,975.75	
	E.ON SE	115,877	9.49	1,100,599.74	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	136,343	3.67	500,378.81	
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	9.32	267,020.71	
	ENAGAS	10,471	22.61	236,749.31	
	ENDESA S.A.	18,336	24.68	452,532.48	
	ENEL SPA	420,215	6.85	2,880,994.04	
	ENGIE	96,233	14.36	1,381,905.88	
	FORTUM OYJ	24,444	21.39	522,857.16	
	IBERDROLA SA	319,860	8.92	2,855,710.08	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	23.60	364,360.40	
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	17.75	367,549.25	
	RWE AG	29,609	26.91	796,778.19	
	SNAM SPA	89,624	4.51	404,383.48	
	SUEZ	14,536	13.43	195,291.16	
	TERNA SPA	80,482	5.83	469,210.06	
	UNIPER SE	12,358	29.30	362,089.40	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,081	23.24	675,842.44	
	VERBUND AG	3,692	47.18	174,188.56	
	ASML HOLDING NV	21,891	247.00	5,407,077.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,563	19.38	1,271,135.44	
	STMICROELECTRONICS NV	37,627	22.30	839,082.10	

ユーロ 小計		10,309,593		214,578,421.35 (25,933,948,004)	
英ポンド	BP PLC	1,055,848	4.80	5,070,182.09	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	223,729	22.11	4,946,648.19	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	194,456	21.89	4,257,614.12	
	ANGLO AMERICAN PLC	55,953	20.26	1,133,887.54	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	8.68	168,730.52	
	BHP GROUP PLC	107,097	17.10	1,831,358.70	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,482	49.80	372,603.60	
	EVRAZ PLC	28,275	3.70	104,730.60	
	GLENCORE PLC	556,703	2.43	1,357,798.61	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	28.74	289,526.76	
	MONDI PLC	25,128	16.75	421,019.64	
	RIO TINTO PLC	58,681	42.01	2,465,482.21	
	ASHTEAD GROUP PLC	23,686	23.50	556,621.00	
	BAE SYSTEMS PLC	170,608	5.73	978,266.27	
	BUNZL PLC	17,064	21.23	362,268.72	
	DCC PLC	4,734	66.08	312,822.72	
	FERGUSON PLC	12,237	67.22	822,571.14	
	MEGGITT PLC	36,960	6.43	237,652.80	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	2.29	565,617.30	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	86,917	7.11	618,501.37	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	3,998,182	0.00	3,998.18	
	SMITHS GROUP PLC	23,530	16.61	390,833.30	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	89.25	328,886.25	
	WEIR GROUP PLC/THE	16,710	13.95	233,188.05	
	EXPERIAN PLC	47,988	25.63	1,229,932.44	
	G4S PLC	74,291	2.09	155,342.48	
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	55.16	451,429.44	
	RELX PLC	102,984	18.73	1,928,890.32	
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	4.44	402,865.84	
	EASYJET PLC	7,630	13.38	102,089.40	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	58,735	6.66	391,644.98	
	BURBERRY GROUP PLC	23,066	21.04	485,308.64	
	PERSIMMON PLC	16,916	25.58	432,711.28	
	TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.74	257,363.76	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	45.86	244,708.96	
	CARNIVAL PLC	8,091	32.53	263,200.23	
	COMPASS GROUP PLC	82,693	18.94	1,566,618.88	
	GVC HOLDINGS PLC	23,842	8.51	203,038.47	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,704	50.07	485,879.28	
	TUI AG-DI	17,636	10.63	187,558.86	

WHITBREAD PLC	6,801	46.01	312,914.01	
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.62	236,337.86	
INFORMA PLC	69,099	7.91	546,849.48	
ITV PLC	215,062	1.45	312,054.96	
PEARSON PLC	39,623	6.46	256,202.31	
WPP PLC	63,987	10.00	640,189.93	
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	7.60	219,509.16	
KINGFISHER PLC	109,678	2.09	230,214.12	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	124,749	1.94	242,449.68	
NEXT PLC	7,669	67.58	518,271.02	
OCADO GROUP PLC	22,177	13.25	293,845.25	
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.14	241,760.40	
TESCO PLC	516,090	2.29	1,183,910.46	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.98	289,984.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	25.69	430,846.99	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	117,896	30.60	3,607,617.60	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.79	224,476.16	
DIAGEO PLC	121,902	31.65	3,858,198.30	
IMPERIAL BRANDS PLC	49,659	17.03	845,792.08	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,620	60.66	2,221,369.20	
UNILEVER PLC	58,827	45.78	2,693,100.06	
NMC HEALTH PLC	6,833	25.09	171,439.97	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	17.31	767,785.05	
ASTRAZENECA PLC	68,127	74.58	5,080,911.66	
GLAXOSMITHKLINE PLC	258,953	17.54	4,542,035.62	
BARCLAYS PLC	926,091	1.71	1,588,616.50	
HSBC HOLDINGS PLC	1,048,514	5.76	6,042,586.18	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,684,159	0.61	2,252,863.22	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	245,244	2.26	554,741.92	
STANDARD CHARTERED PLC	141,577	6.97	987,357.99	
3I GROUP PLC	49,338	10.71	528,409.98	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,431	18.55	267,695.05	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,953	68.72	1,096,290.16	
M&G PLC	133,064	2.36	314,031.04	
SCHRODERS PLC	6,213	32.99	204,966.87	
ST JAMES'S PLACE PLC	31,966	10.88	347,949.91	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	3.16	390,620.44	
ADMIRAL GROUP PLC	12,109	21.40	259,132.60	
AVIVA PLC	198,601	4.03	801,950.83	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.05	193,284.60	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	2.80	849,056.76	
PRUDENTIAL PLC	133,064	13.76	1,831,625.96	

	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	5.51	288,354.63	
	AVEVA GROUP PLC	3,527	45.58	160,760.66	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	11.32	171,177.40	
	SAGE GROUP PLC/THE	62,038	7.53	467,642.44	
	HALMA PLC	21,166	21.06	445,755.96	
	BT GROUP PLC	454,248	1.91	870,157.46	
	VODAFONE GROUP PLC	1,367,398	1.53	2,097,041.57	
	CENTRICA PLC	254,915	0.80	204,492.81	
	NATIONAL GRID PLC	178,374	8.89	1,586,993.47	
	SEVERN TRENT PLC	14,466	22.43	324,472.38	
	SSE PLC	54,852	13.00	713,076.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.53	283,388.53	
英ポンド 小計		19,643,153		92,711,951.59 (13,127,085,225)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	20.66	208,686.66	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	525	620.50	325,762.50	
	GIVAUDAN-REG	472	2,939.00	1,387,208.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,793	51.56	1,329,887.08	
	SIKA AG	6,470	174.05	1,126,103.50	
	ABB LTD	96,431	21.87	2,108,945.97	
	GEBERIT AG-REG	1,999	536.80	1,073,063.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,299	239.20	310,720.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,322	249.30	578,874.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	61.82	433,914.58	
	SGS SA	256	2,602.00	666,112.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	162.60	384,061.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,260	76.16	2,076,121.60	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	280.00	372,400.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	53.30	134,102.80	
	DUFRY AG-REG	2,262	97.58	220,725.96	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	188	2,010.00	377,880.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	49	7,625.00	373,625.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	85,300.00	426,500.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	155,168	103.92	16,125,058.56	
	ALCON INC	21,063	55.21	1,162,888.23	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	228.30	603,396.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	599	962.00	576,238.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,776	339.60	1,282,329.60	
	NOVARTIS AG-REG SHS	112,401	92.06	10,347,636.06	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,331	308.20	11,197,214.20	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	178.30	470,355.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	129,608	13.10	1,698,512.84	

	JULIUS BAER GROUP LTD	12,666	47.08	596,315.28	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	78.90	147,306.30	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	843.20	820,433.60	
	UBS GROUP AG	203,742	12.12	2,469,353.04	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	173.80	430,155.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	495.80	860,213.00	
	SWISS RE AG	15,453	108.30	1,673,559.90	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,768	392.30	3,047,386.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	105.60	412,473.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,650	151.70	553,705.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,431	517.60	740,685.60	
スイスフラン 小計		908,552		69,129,911.96 (7,575,947,051)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,380	295.20	3,359,376.00	
	BOLIDEN AB	16,246	247.00	4,012,762.00	
	ALFA LAVAL AB	13,939	235.60	3,284,028.40	
	ASSA ABLOY AB-B	53,447	227.40	12,153,847.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,909	350.90	12,600,468.10	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	309.60	6,126,055.20	
	EPIROC AB-A	30,249	111.80	3,381,838.20	
	EPIROC AB-B	16,107	107.65	1,733,918.55	
	SANDVIK AB	60,999	174.15	10,622,975.85	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	211.60	3,324,447.60	
	SKF AB-B SHARES	20,607	182.90	3,769,020.30	
	VOLVO AB-B SHS	79,515	148.05	11,772,195.75	
	SECURITAS AB-B SHS	19,919	158.80	3,163,137.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,165	246.10	2,255,506.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	74.78	1,390,384.54	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	43,722	184.84	8,081,574.48	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	418.00	1,483,900.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,149	458.70	4,655,346.30	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,725	301.00	9,850,225.00	
	NORDEA BANK ABP	170,474	67.83	11,563,251.42	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,798	82.12	7,292,091.76	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	94.00	7,300,792.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	124.70	5,726,348.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	222.10	1,391,678.60	
	INVESTOR AB-B SHS	24,294	506.20	12,297,622.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	219.30	2,468,660.10	
	KINNEVIK AB-REDEMPTION SHARE	11,257	58.20	655,157.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	379.60	1,189,666.40	
	ERICSSON LM-B SHS	159,401	86.30	13,756,306.30	

	HEXAGON AB-B SHS	13,203	541.40	7,148,104.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	428.40	1,154,109.60	
	TELE2 AB-B SHS	29,159	141.30	4,120,166.70	
	TELIA CO AB	126,963	41.45	5,262,616.35	
スウェーデンクローナ 小計		1,282,208		188,347,580.10 (2,158,463,267)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,392	264.30	1,425,105.60	
	EQUINOR ASA	50,788	169.80	8,623,802.40	
	NORSK HYDRO ASA	79,046	32.60	2,576,899.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	347.50	3,129,237.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,930	237.60	933,768.00	
	MOWI ASA	22,242	228.60	5,084,521.20	
	ORKLA ASA	33,915	89.26	3,027,252.90	
	DNB ASA	51,078	154.80	7,906,874.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	173.45	1,919,397.70	
	TELENOR ASA	39,602	168.20	6,661,056.40	
ノルウェークローネ 小計		306,064		41,287,915.70 (491,326,196)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,029	515.00	3,104,935.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	324.00	3,307,068.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,581	645.40	6,183,577.40	
	ISS A/S	8,523	155.65	1,326,604.95	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,805.00	1,479,240.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	370	9,478.00	3,506,860.00	
	DSV PANALPINA A S	11,675	738.40	8,620,820.00	
	PANDORA A/S	4,763	273.00	1,300,299.00	
	CARLSBERG AS-B	5,817	975.60	5,675,065.20	
	COLOPLAST-B	6,052	801.20	4,848,862.40	
	DEMANT A/S	4,455	207.50	924,412.50	
	GENMAB A/S	3,294	1,580.00	5,204,520.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	259.80	752,380.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	92,835	381.20	35,388,702.00	
	DANSKE BANK A/S	32,789	91.56	3,002,160.84	
	TRYG A/S	8,215	195.00	1,601,925.00	
	ORSTED A/S	9,592	625.00	5,995,000.00	
デンマーククローネ 小計		217,261		92,222,433.09 (1,491,236,743)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	34.56	462,620.16	
	OIL SEARCH LTD	70,573	7.44	525,063.12	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	8.70	776,962.20	
	SANTOS LTD	91,657	8.15	747,004.55	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,659	22.32	170,948.88	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,121	34.51	1,729,675.71	
WORLEY LIMITED	13,384	15.00	200,760.00	
ALUMINA LTD	106,977	2.31	247,116.87	
BHP GROUP LTD	151,689	38.23	5,799,070.47	
BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	14.55	335,944.95	
BORAL LIMITED	75,397	5.14	387,540.58	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	9.73	682,082.73	
INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.23	198,176.65	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,865	28.96	749,050.40	
NEWCREST MINING LIMITED	41,293	30.76	1,270,172.68	
ORICA LIMITED	17,981	23.78	427,588.18	
RIO TINTO LIMITED	19,754	96.90	1,914,162.60	
SOUTH32 LTD	294,667	2.70	795,600.90	
CIMIC GROUP LTD	4,062	33.64	136,645.68	
BRAMBLES LIMITED	88,389	12.55	1,109,281.95	
SEEK LIMITED	18,186	23.19	421,733.34	
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	5.78	502,189.52	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	7.30	334,566.30	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,141	33.92	988,462.72	
CROWN RESORTS LTD	21,863	12.91	282,251.33	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	44.03	116,679.50	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	4.79	498,351.60	
REA GROUP LTD	2,871	104.36	299,617.56	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.30	88,334.90	
WESFARMERS LIMITED	58,571	42.37	2,481,653.27	
COLES GROUP LIMITED	57,494	16.26	934,852.44	
WOOLWORTHS GROUP LTD	67,760	39.76	2,694,137.60	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	11.38	266,769.96	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	18.70	681,876.80	
COCHLEAR LIMITED	2,927	233.99	684,888.73	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,513	72.98	694,258.74	
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	30.12	634,959.72	
CSL LIMITED	23,460	283.48	6,650,440.80	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	146,659	24.84	3,643,009.56	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.03	199,005.23	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	92,044	80.82	7,438,996.08	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	153,212	25.89	3,966,658.68	
WESTPAC BANKING CORPORATION	185,374	24.52	4,545,370.48	
AMP LIMITED	223,504	1.95	436,950.32	
ASX LTD	9,287	81.71	758,840.77	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	8.14	187,399.08	
MACQUARIE GROUP LTD	16,904	138.05	2,333,597.20	

	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,094	52.49	424,854.06	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	7.89	924,605.43	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.26	419,640.24	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	67,004	12.68	849,610.72	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	13.38	855,423.54	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,039	17.73	532,591.47	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	27.28	215,757.52	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.86	837,399.98	
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.99	124,128.42	
	AGL ENERGY LIMITED	34,137	20.41	696,736.17	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.74	148,282.80	
オーストラリアドル 小計		3,596,221		67,460,351.84 (5,008,931,124)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,669	5.23	212,698.87	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	55,278	9.03	499,160.34	
	A2 MILK CO LTD	34,910	15.52	541,803.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,600	22.15	677,790.00	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	21,106	15.10	318,700.60	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.54	399,052.38	
	MERCURY NZ LTD	30,223	4.80	145,070.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	81,829	4.71	385,414.59	
ニュージーランドドル 小計		382,512		3,179,690.38 (224,581,531)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	143,424	71.10	10,197,446.40	
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	10.50	729,750.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	78,000	58.85	4,590,300.00	
	MTR CORPORATION	67,000	43.90	2,941,300.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	23.15	625,050.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	51.20	6,041,600.00	
	SANDS CHINA LTD	135,600	37.00	5,017,200.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.98	638,400.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	17.22	1,219,176.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	65,000	27.90	1,813,500.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	30.10	1,264,200.00	
	WH GROUP LIMITED	517,000	8.04	4,156,680.00	
	BANK OF EAST ASIA	87,220	17.66	1,540,305.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	26.60	4,987,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	159.60	6,192,480.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	60,600	247.20	14,980,320.00	
	AIA GROUP LTD	632,600	78.40	49,595,840.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,424	52.05	7,257,019.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.04	1,571,920.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,384	37.65	2,386,407.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	25.25	694,375.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	356,333	10.22	3,641,723.26	
	SINO LAND CO	124,200	11.74	1,458,108.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	85,000	113.90	9,681,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	70.45	1,902,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	24.35	1,290,550.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	43.45	3,128,400.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	52,000	48.65	2,529,800.00	
	PCCW LIMITED	269,000	4.72	1,269,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	53.00	1,590,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	80.70	6,867,570.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.67	851,370.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	545,014	14.92	8,131,608.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	54.45	3,893,175.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	102.20	1,257,060.00	
香港ドル 小計		4,641,799		175,933,464.54 (2,464,827,838)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	6.72	469,728.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.19	95,746.80	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	4.13	409,283.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.03	92,700.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.35	274,245.00	
	SATS LTD	26,800	4.98	133,464.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.19	230,356.54	
	GENTING SINGAPORE LTD	370,200	0.92	342,435.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	2.20	151,910.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	30.64	144,008.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	117,000	4.09	478,530.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	25.25	2,378,550.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	176,200	10.78	1,899,436.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,900	25.82	1,649,898.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	8.85	315,060.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	3.68	502,688.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	10.34	266,772.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.76	168,392.00	
	VENTURE CORP LTD	11,900	15.87	188,853.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,115	3.38	1,484,208.70	
シンガポールドル 小計		2,037,251		11,676,264.04 (936,553,138)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	15.96	458,227.56	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	565.10	784,923.90	

	BANK HAPOALIM BM	65,020	27.65	1,797,803.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	83,960	24.91	2,091,443.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	15.90	869,316.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	91.00	495,222.00	
	AZRIELI GROUP	2,140	272.70	583,578.00	
	NICE LTD	2,768	520.00	1,439,360.00	
イスラエルシュケル 小計		244,104		8,519,874.66 (268,887,244)	
合　計		61,263,620		221,190,960,865 (221,190,960,865)	

（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　614銘柄	65.9%	69.2%
カナダドル	株式　86銘柄	3.6%	3.8%
ユーロ	株式　238銘柄	11.2%	11.7%
英ポンド	株式　94銘柄	5.6%	5.9%
スイスフラン	株式　39銘柄	3.3%	3.4%
スウェーデンクローナ	株式　33銘柄	0.9%	1.0%
ノルウェークローネ	株式　10銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式　58銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランドドル	株式　8銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式　35銘柄	1.1%	1.1%
シンガポールドル	株式　20銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシュケル	株式　8銘柄	0.1%	0.1%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	440,482.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	5,727	930,752.04	
		AMERICAN TOWER CORP	23,336	4,994,604.08	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	80,296	749,161.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,069	1,515,664.29	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	1,085,460.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	546,818.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,561	1,277,352.95	
		DUKE REALTY CORP	20,240	712,043.20	
		EQUINIX INC	4,426	2,508,878.10	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	641,829.12	
	EQUITY RESIDENTIAL	18,789	1,598,943.90	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	1,040,183.76	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	685,401.15	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,227	558,259.89	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,237	845,386.56	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	657,081.81	
	INVITATION HOMES INC	30,069	918,006.57	
	IRON MOUNTAIN INC	16,395	526,607.40	
	KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	455,965.80	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,193	566,472.66	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,675	616,053.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	786,715.80	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	459,799.26	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	12,872	541,010.16	
	PROLOGIS INC	33,100	3,030,305.00	
	PUBLIC STORAGE	7,965	1,678,066.20	
	REALTY INCOME CORPORATION	16,047	1,229,681.61	
	REGENCY CENTERS CORP	9,451	614,693.04	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,451	2,487,555.71	
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	336,626.85	
	SUN COMMUNITIES INC	4,598	757,336.58	
	UDR INC	14,289	686,586.45	
	VENTAS INC	20,469	1,193,547.39	
	VEREIT INC	54,273	529,704.48	
	VICI PROPERTIES INC	26,533	656,161.09	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	562,146.42	
	WELLTOWER INC	20,533	1,736,475.81	
	WEYERHAEUSER CO	37,766	1,114,474.66	
	WP CAREY INC	8,640	720,748.80	
米ドル 小計		709,194	42,993,044.51 (4,715,477,121)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	4,697	260,401.68	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,391	224,237.78	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	201,948.74	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	114,827.55	
カナダドル 小計		26,114	801,415.75 (66,212,969)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	239,755.20	
	GECINA SA	2,689	421,635.20	

		ICADE	1,265	114,925.25	
		KLEPIERRE	9,305	303,063.85	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,311	1,037,430.90	
	ユーロ 小計		22,958	2,116,810.40 (255,837,704)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	258,801.27	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	313,425.55	
		SEGRO PLC	61,311	548,120.34	
	英ポンド 小計		138,976	1,120,347.16 (158,629,954)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	67,160	738,760.00	
		DEXUS	62,385	762,968.55	
		GOODMAN GROUP	86,301	1,278,980.82	
		GPT GROUP	97,296	598,370.40	
		LENDLEASE GROUP	25,262	487,809.22	
		MIRVAC GROUP	226,368	762,860.16	
		SCENTRE GROUP	290,995	1,146,520.30	
		STOCKLAND	103,417	522,255.85	
		SYDNEY AIRPORT	49,760	456,796.80	
		TRANSURBAN GROUP	141,455	2,171,334.25	
		VICINITY CENTRES	146,656	393,038.08	
	オーストラリアドル 小計		1,297,055	9,319,694.43 (691,987,311)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	170,000	1,951,600.00	
		LINK REIT	112,500	9,000,000.00	
	香港ドル 小計		282,500	10,951,600.00 (153,431,916)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	150,400	448,192.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	262,104.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	160,800	405,216.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	247,564.00	
		SUNTEC REIT	64,600	118,864.00	
	シンガポールドル 小計		611,100	1,481,940.00 (118,866,407)	
合計				6,160,443,382 (6,160,443,382)	

（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　　40銘柄	2.0%	76.5%

カナダドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.1%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.1%	4.2%
英ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.6%
オーストラリアドル	投資証券	11銘柄	0.3%	11.2%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券	5銘柄	0.1%	1.9%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	34,968,566	172,629,146
金銭信託	1,436,155,835	-
コール・ローン	262,373,529	3,030,072,508
株式	1,903,467,962	4,037,483,203
投資信託受益証券	126,617,599	439,169,849
投資証券	10,784,021	131,691,487
派生商品評価勘定	61,126,870	76,304,388
未収入金	22,176	48,519
未収配当金	886,346	1,485,796
前払金	31,746,070	2,947,650
差入委託証拠金	583,185,160	553,617,123
流動資産合計	4,451,334,134	8,445,449,669
資産合計	4,451,334,134	8,445,449,669
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,598,630	32,271,389
未払金	-	1,423,487
未払解約金	-	30,000,000
未払利息	769	5,811
その他未払費用	136,729	73,664
流動負債合計	49,736,128	63,774,351
負債合計	49,736,128	63,774,351
純資産の部		
元本等		
元本	3,379,960,257	6,294,909,292
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,021,637,749	2,086,766,026
元本等合計	4,401,598,006	8,381,675,318
純資産合計	4,401,598,006	8,381,675,318
負債純資産合計	4,451,334,134	8,445,449,669

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	（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。 （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	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
1．当計算期間の末日における受益権の総数	3,379,960,257口	6,294,909,292口
2．1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3023円 (10,000口当たりの純資産額 13,023円)	1口当たり純資産額 1.3315円 (10,000口当たりの純資産額 13,315円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。

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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（令和 1年12月 2日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年11月30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	2,391,428,475	-	2,359,682,405	△31,746,070
	MSCIE 1812	2,391,428,475	-	2,359,682,405	△31,746,070
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,981,769,593	-	2,028,501,768	46,732,175
	米ドル	1,981,769,593	-	2,028,501,768	46,732,175
	売建	284,069,593	-	287,527,458	△3,457,865
	米ドル	284,000,000	-	287,457,865	△3,457,865
	メキシコペソ	69,593	-	69,593	-
合計		4,657,267,661	-	4,675,711,631	11,528,240

（令和 1年12月 2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	3,782,695,938	-	3,779,748,288	△2,947,650
	MSCIE 1912	3,782,695,938	-	3,779,748,288	△2,947,650
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,071,916,966	-	4,134,570,305	62,653,339
	米ドル	4,071,916,966	-	4,134,570,305	62,653,339
	売建	1,057,216,966	-	1,072,889,656	△15,672,690
	米ドル	1,057,000,000	-	1,072,673,417	△15,673,417
	メキシコペソ	204,366	-	203,639	727
	香港ドル	12,600	-	12,600	-
合計		8,911,829,870	-	8,987,208,249	44,032,999

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成30年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,987,969,778円
同期中における追加設定元本額	3,839,802,002円
同期中における一部解約元本額	3,447,811,523円
平成30年11月30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	915,400,939円
三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド	1,262,181,268円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	83,167,154円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	506,367,397円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	454,934,555円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	7,332,370円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	6,412,938円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	4,696,784円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	22,538,530円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	21,788,377円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	69,866,830円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	11,249,367円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	14,023,748円
合計	3,379,960,257円

（令和 1年12月 2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	3,379,960,257円
同期中における追加設定元本額	5,059,642,476円
同期中における一部解約元本額	2,144,693,441円
令和 1年12月 2日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	1,847,179,535円
三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド	1,655,715,631円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	824,428,406円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	828,691,099円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	648,447,633円
イオン・バランス戦略ファンド	151,186,383円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	9,957,591円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	24,723,670円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	19,042,255円

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	76,580,510円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	56,263,926円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	102,301,455円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	26,205,801円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	24,185,397円
合計	6,294,909,292円

附属明細表

①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	0.72	4,902.80	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,176	9.61	11,301.36	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	1,564	15.37	24,038.68	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	673	38.03	25,594.19	
	51JOB INC-ADR	189	78.62	14,859.18	
	BEST INC-ADR	1,816	6.01	10,914.16	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,399	21.28	51,050.72	
	NIO INC-ADR	4,302	2.27	9,765.54	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	960	34.21	32,841.60	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,032	121.08	124,954.56	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	2,794	44.26	123,662.44	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,596	44.52	115,573.92	
	58.COM INC-ADR	685	61.52	42,141.20	
	AUTOHOME INC-ADR	429	68.05	29,193.45	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,023	118.53	239,786.19	
	HUYA INC-ADR	492	21.10	10,381.20	
	IQIYI INC-ADR	796	19.15	15,243.40	
	MOMO INC-SPON ADR	1,091	37.43	40,836.13	
	NETEASE.COM INC -ADR	522	315.32	164,597.04	
	SINA CORP	401	34.89	13,990.89	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	840	12.43	10,441.20	
	WEIBO CORP-SPON ADR	349	42.81	14,940.69	
	YY INC-ADR	421	63.79	26,855.59	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	12,270	200.00	2,454,000.00	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	263	37.97	9,986.11	
	JD.COM INC-ADR	5,349	32.65	174,644.85	
	PINDUODUO INC-ADR	1,400	35.95	50,330.00	
	TRIP.COM GROUP-ADR	3,413	33.24	113,448.12	

	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	3,182	12.78	40,665.96	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	475	24.11	11,452.25	
	BANCO MACRO SA-ADR	320	25.85	8,272.00	
	CREDICORP LTD	481	211.19	101,582.39	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	709	13.36	9,472.24	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	231	29.14	6,731.34	
	QUDIAN INC-SPON ADR	627	4.96	3,109.92	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	0.91	6,478.20	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	427	46.82	19,992.14	
	GLOBANT SA	258	107.00	27,606.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	544	10.38	5,646.72	
米ドル 小計		71,379		4,201,284.37 (460,796,869)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	115,600	7.15	826,540.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	26,200	51.08	1,338,296.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,195	207.30	247,723.50	
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	8,600	42.68	367,048.00	
	ALFA S.A.B.-A	22,000	15.36	337,920.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	65.36	235,296.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,485	333.67	495,499.95	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	2,500	198.79	496,975.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,750	186.94	327,145.00	
	ALSEA SAB DE CV	3,800	52.98	201,324.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	17,400	42.55	740,370.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	1,584	69.24	109,676.16	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	1,600	96.43	154,288.00	
	WAL-MART DE MIXICO SAB DE CV	38,700	54.48	2,108,376.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,900	103.51	300,179.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	3,400	112.15	381,310.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	14,300	177.48	2,537,964.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,505	197.00	296,485.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	10,700	33.80	361,660.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	37.45	374,500.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	18,400	102.94	1,894,096.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	15,000	23.21	348,150.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	244,700	15.00	3,670,500.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	4,300	80.19	344,817.00	
メキシコペソ 小計		571,219		18,496,138.61 (103,763,337)	
ブラジルレアル	COSAN SA	1,300	62.10	80,730.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	21,900	31.20	683,280.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	30,800	29.15	897,820.00	

ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	4,700	21.81	102,507.00	
BRASKEM SA-PREF A	900	27.99	25,191.00	
COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	5,300	12.56	66,568.00	
GERDAU S.A.-PREF	7,100	17.00	120,700.00	
SUZANO SA	3,615	38.56	139,394.40	
VALE SA	23,200	49.98	1,159,536.00	
EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	5,000	18.00	90,000.00	
WEG SA	5,830	30.42	177,348.60	
COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	8,400	17.19	144,396.00	
LOCALIZA RENT A CAR SA	4,000	45.04	180,160.00	
RUMO SA	7,500	24.43	183,225.00	
COGNA EDUCACAO	10,400	10.25	106,600.00	
B2W CIA DIGITAL	1,561	56.34	87,946.74	
LOJAS AMERICANAS SA	5,300	22.28	118,084.00	
LOJAS RENNER S.A.	5,980	51.80	309,764.00	
MAGAZINE LUIZA SA	5,400	45.03	243,162.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	4,800	28.44	136,512.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	2,100	18.81	39,501.00	
COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	1,000	80.16	80,160.00	
RAIA DROGASIL SA	1,800	112.99	203,382.00	
AMBEV SA	34,700	18.05	626,335.00	
BRF-BRASIL FOODS SA	3,700	36.60	135,420.00	
JBS SA	8,300	28.48	236,384.00	
NATURA COSMETICOS SA	2,600	33.12	86,112.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,800	55.70	100,260.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	2,400	56.69	136,056.00	
HYPERMARCAS SA	2,700	33.30	89,910.00	
BANCO BRADESCO S.A.-PREF	29,484	33.37	983,881.08	
BANCO BRADESCO SA	9,008	31.25	281,500.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	6,400	47.81	305,984.00	
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	35,400	34.80	1,231,920.00	
ITAUSA-INVESTMENTOS ITAU-PR	32,680	13.27	433,663.60	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,700	70.25	119,425.00	
BM&F BOVESPA SA	15,100	47.72	720,572.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	5,100	34.45	175,695.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,100	37.13	189,363.00	
PORTO SEGURO SA	600	60.00	36,000.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,300	15.57	98,091.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	2,400	28.92	69,408.00	
CIELO SA	9,300	7.80	72,540.00	
TELEFONICA BRASIL SA	3,400	56.25	191,250.00	
TIM PARTICIPACOES SA	5,600	13.54	75,824.00	

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-RTS	327	0.07	22.89	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	2,200	34.83	76,626.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	1,600	35.93	57,488.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASLIER-RTS	245	0.13	31.85	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	6,000	13.05	78,300.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	2,600	57.40	149,240.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,100	45.98	50,578.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,350	46.77	63,139.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,300	20.64	26,832.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD(NEW)	5,200	20.64	107,328.00	
ブラジルレアル 小計		413,580		12,381,147.66 (320,424,101)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,630	6,400.00	16,832,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	8,980	1,745.00	15,670,100.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	921	19,100.00	17,591,100.00	
	LATAM AIRLINES GROUP	2,393	8,449.00	20,218,457.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	5,234	3,229.90	16,905,296.60	
	CENCOSUD SA	8,340	1,025.00	8,548,500.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	883	7,410.00	6,543,030.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,886	2,050.00	3,866,300.00	
	BANCO DE CHILE	319,123	81.70	26,072,349.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	353	35,980.00	12,700,940.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	432,287	42.97	18,575,372.39	
	ITAU CORPBANCA	1,230,978	4.00	4,923,912.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,200	4,881.00	5,857,200.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	20,335	329.00	6,690,215.00	
	COLBUN SA	61,705	114.60	7,071,393.00	
	ENEL AMERICAS SA	286,610	154.44	44,264,048.40	
	ENEL CHILE SA	227,542	60.39	13,741,261.38	
チリペソ 小計		2,611,400		246,071,474.87 (33,342,684)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	34,192	3,290.00	112,491,680.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,250	17,560.00	39,510,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,718	41,680.00	71,606,240.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,101	43,340.00	134,397,340.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	28,377	1,415.00	40,153,455.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,916	32,400.00	62,078,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,245	18,980.00	61,590,100.00	
コロンビアペソ 小計		74,799		521,827,215.00 (16,281,009)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	344	21.24	7,306.56	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	334	18.44	6,158.96	

	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	
	OPAP SA	1,325	11.16	14,787.00	
	JUMBO S.A.	802	18.20	14,596.40	
	ALPHA BANK AE	9,474	1.91	18,095.34	
	EUROBANK ERGASIAS SA	19,175	0.95	18,331.30	
	NATIONAL BANK OF GREECE	4,254	3.07	13,076.79	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,878	13.64	25,615.92	
ユーロ 小計		37,709		118,558.67 (14,329,000)	
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,004	123.90	124,395.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,241	8.02	66,092.82	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,111	18.67	39,412.37	
	KOC HOLDING AS	6,107	20.02	122,262.14	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,755	26.90	47,209.50	
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	13.66	61,101.18	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	63.80	16,396.60	
	ARCELIK AS	866	20.12	17,423.92	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,989	46.00	137,494.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	21.68	16,455.12	
	AKBANK T.A.S.	20,175	7.77	156,759.75	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,240	10.10	164,024.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	6.15	59,538.15	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,157	9.10	65,128.70	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	8,901	13.56	120,697.56	
トルコリラ 小計		90,716		1,214,391.41 (23,182,732)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	547	794.00	434,318.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,975	77.00	306,075.00	
	CEZ AS	1,135	513.50	582,822.50	
チェココルナ 小計		5,657		1,323,215.50 (6,258,809)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	2,859	2,934.00	8,388,306.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,084	5,815.00	6,303,460.00	
	OTP BANK PLC	1,618	14,290.00	23,121,220.00	
ハンガリーフォリント 小計		5,561		37,812,986.00 (13,646,706)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	546	91.68	50,057.28	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,258	92.90	209,768.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	14,344	4.62	66,269.28	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,106	89.90	99,429.40	
	CCC SA	282	112.40	31,696.80	
	LPP SA	9	8,700.00	78,300.00	

	AMREST HOLDINGS SE	739	47.00	34,733.00	
	CD PROJEKT SA	469	262.50	123,112.50	
	CYFROWY POLSAT SA	1,573	27.92	43,918.16	
	DINO POLSKA SA	366	135.20	49,483.20	
	BANK MILLENNIUM SA	4,887	5.52	26,976.24	
	BANK PEKAO SA	1,187	104.80	124,397.60	
	MBANK SA	79	372.20	29,403.80	
	PKO BANK POLSKI SA	6,449	36.14	233,066.86	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	253	275.00	69,575.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,138	38.70	160,140.60	
	ORANGE POLSKA SA	4,301	6.39	27,483.39	
	PGE SA	7,070	8.72	61,664.54	
ポーランドズロチ 小計		50,056		1,519,475.85 (42,575,713)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	11,000	3.10	34,100.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	10,000	10.54	105,400.00	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	188,000	4.39	825,320.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	25,500	15.16	386,580.00	
	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	3.23	25,840.00	
	CNOOC LTD	131,000	11.36	1,488,160.00	
	PETROCHINA CO LTD	158,000	3.61	570,380.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	10,000	6.92	69,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	20,000	2.40	48,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	9,500	50.05	475,475.00	
	BBMG CORPORATION - H	9,000	2.16	19,440.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	4.11	47,265.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	21,000	2.68	56,280.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	28,000	7.56	211,680.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	18,000	9.37	168,660.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	8,800	3.13	27,544.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	7,000	9.03	63,210.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	5.30	31,800.00	
	MAANSHAN IRON&STEEL-H	6,000	2.97	17,820.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	14,000	7.97	111,580.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	2.17	39,060.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	5,500	8.10	44,550.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	42,000	2.93	123,060.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	13,000	3.57	46,410.00	
	BOC AVIATION LTD	1,300	73.95	96,135.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	31,000	6.09	188,790.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	5.27	105,400.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	12,500	30.45	380,625.00	

CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	10,000	8.20	82,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	28,000	4.58	128,240.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	14,500	8.08	117,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	12,000	6.17	74,040.00	
CITIC LIMITED	44,000	9.80	431,200.00	
CRRC CORP LTD-H	31,000	5.15	159,650.00	
FOSUN INTERNATIONAL	18,000	10.54	189,720.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	17.50	70,000.00	
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	1.63	17,930.00	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	26,000	2.41	62,660.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	5,000	14.10	70,500.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	7,500	4.59	34,425.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	3,500	13.22	46,270.00	
WEICHAI POWER CO	14,000	13.38	187,320.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	8.71	57,642.78	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,000	26.75	107,000.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	5.54	72,020.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3,500	25.25	88,375.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	26,000	5.92	153,920.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	8,000	25.30	202,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP	10,000	8.57	85,700.00	
AIR CHINA/HONG KONG	16,000	7.12	113,920.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	10,000	7.40	74,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	22,000	2.89	63,580.00	
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	18,000	3.97	71,460.00	
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	10,140	12.18	123,505.20	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	4.89	39,120.00	
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	10,000	6.37	63,700.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	10.44	104,400.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	6,000	10.44	62,640.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	8,000	16.54	132,320.00	
SINOTRANS LIMITED	8,000	2.44	19,520.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	6.85	82,200.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	15,500	4.39	68,045.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	22,000	8.08	177,760.00	
BYD CO LTD-H	4,500	37.15	167,175.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	18,000	0.41	7,380.00	
DONGFENG MOTOR CORPORATION	20,000	7.52	150,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,800	23.10	64,680.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	37,000	14.64	541,680.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	25,000	6.05	151,250.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	21,200	8.36	177,232.00	

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	5,000	6.56	32,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	8,000	73.60	588,800.00	
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	26,000	3.74	97,240.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	9,000	21.75	195,750.00	
LI NING COMPANY LIMITED	13,500	25.10	338,850.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	5,600	103.20	577,920.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	4,000	14.48	57,920.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	3,000	10.60	31,800.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	32.90	98,700.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	1.30	143,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	1,400	30.05	42,070.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	41,600	331.80	13,802,880.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.69	26,910.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	7,500	103.20	774,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	4,500	27.75	124,875.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	17,500	8.86	155,050.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	11,000	4.11	45,210.00	
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	21,000	29.95	628,950.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	10,000	41.00	410,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	11,000	5.32	58,520.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	12.74	178,360.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	48.40	193,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	8,000	7.95	63,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	33,000	6.74	222,420.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	49.80	149,400.00	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	5,500	51.70	284,350.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	24,000	8.86	212,640.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	2,600	52.10	135,460.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,000	9.45	151,200.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	4,600	14.04	64,584.00	
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	8,400	25.85	217,140.00	
3SBIO INC	10,500	11.30	118,650.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	10,000	11.14	111,400.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	34,000	17.82	605,880.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	6.84	82,080.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	12,000	3.49	41,880.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	18.90	113,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	23.10	92,400.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	6,000	27.40	164,400.00	
LUYE PHARMA GROUP	9,500	5.75	54,625.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	3,000	22.00	66,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	52,000	10.10	525,200.00	

SSY GROUP LIMITED	10,000	6.16	61,600.00	
WUXI APPTEC CO LTD	1,340	90.85	121,739.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,000	88.45	353,800.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	217,000	3.17	687,890.00	
BANK OF CHINA LTD	581,000	3.14	1,824,340.00	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	67,000	5.14	344,380.00	
CHINA CITIC BANK	68,000	4.28	291,040.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	700,000	6.23	4,361,000.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	21,000	3.38	70,980.00	
CHINA MERCHANTS BANK- H	28,500	37.00	1,054,500.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	51,100	5.45	278,495.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	13,000	3.89	50,570.00	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	475,000	5.58	2,650,500.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	59,000	5.08	299,720.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	64,000	1.63	104,320.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	8,000	23.08	184,640.00	
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	12.60	100,800.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO	25,500	3.98	101,490.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	53,000	1.14	60,420.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	8,000	13.48	107,840.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	13,500	14.54	196,290.00	
FAR EAST HORIZON LTD	18,000	7.11	127,980.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	7,600	8.38	63,688.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	5,000	11.90	59,500.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	18,800	7.82	147,016.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	10,800	11.74	126,792.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO.	55,000	19.78	1,087,900.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	19,600	27.70	542,920.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	1.24	37,200.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	10,600	18.10	191,860.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	5,400	30.15	162,810.00	
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	54,000	3.14	169,560.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	52,000	9.06	471,120.00	
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	40,500	88.70	3,592,350.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	2,800	27.05	75,740.00	
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	8,000	10.96	87,680.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	11.20	100,800.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	13,000	18.68	242,840.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	36,000	5.20	187,200.00	
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	28,000	26.25	735,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	20,000	33.85	677,000.00	
CHINA VANKE CO LTD -H	10,300	29.30	301,790.00	

CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	22,000	5.70	125,400.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	56,000	10.90	610,400.00	
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	6,000	13.16	78,960.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	3.08	64,680.00	
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	8,000	8.60	68,800.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	10,000	11.46	114,600.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	13,500	32.05	432,675.00	
SEAZEN GROUP LTD	10,000	8.34	83,400.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	16,000	3.08	49,280.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	8,000	28.35	226,800.00	
SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.64	22,140.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	2.90	55,100.00	
SOHO CHINA LTD	7,500	2.70	20,250.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	18,000	38.15	686,700.00	
WHARF HOLDINGS LTD	9,000	18.94	170,460.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	44,000	1.67	73,480.00	
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	17,000	3.60	61,200.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	5.05	70,700.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	17,000	7.76	131,920.00	
KINGSOFT CORPORATION LTD.	6,000	17.32	103,920.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	8,000	19.06	152,480.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	5,000	54.90	274,500.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,500	14.00	77,000.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	4.20	42,000.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,500	21.55	96,975.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	8.83	61,810.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	2,000	16.10	32,200.00	
LENOVO GROUP LTD	50,000	5.17	258,500.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	5,300	128.30	679,990.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	56,400	8.95	504,780.00	
ZTE CORPORATION	6,200	20.85	129,270.00	
CHINA MOBILE LTD	45,000	59.00	2,655,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	106,000	2.96	313,760.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	314,000	1.60	502,400.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	46,000	6.70	308,200.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	3,500	34.60	121,100.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	36,000	3.84	138,240.00	
CGN POWER CO LTD-H	70,000	1.96	137,200.00	
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	13,800	29.10	401,580.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	27,000	4.24	114,480.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.62	59,940.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	6,000	43.60	261,600.00	

	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	12,000	10.18	122,160.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	1.45	17,400.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,900	85.00	501,500.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	22,000	16.18	355,960.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	12,000	2.85	34,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	22,000	3.88	85,360.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	30,000	2.99	89,700.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	24,000	6.63	159,120.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	5.53	22,120.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	2,000	13.88	27,760.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONA	20,000	9.98	199,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	24,000	4.81	115,440.00	
香港ドル 小計		6,400,998		67,581,107.98 (946,811,322)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	29,200	3.35	97,820.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,900	22.90	43,510.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	16,800	7.06	118,608.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	8,700	4.70	40,890.00	
	GAMUDA BHD	13,300	3.76	50,008.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	3,900	9.90	38,610.00	
	IJM CORP BHD	18,500	2.09	38,665.00	
	SIME DARBY BERHAD	23,500	2.25	52,875.00	
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	1.69	9,295.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	8,300	8.30	68,890.00	
	MISC BHD	8,300	8.15	67,645.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	4.17	15,429.00	
	GENTING BHD	15,200	5.83	88,616.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	17,500	3.14	54,950.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	16.30	8,150.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	34.74	41,688.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	10.32	9,288.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	14,000	4.35	60,900.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	3,500	23.34	81,690.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	143.30	85,980.00	
	PPB GROUP BERHAD	4,140	18.20	75,348.00	
	QL RESOURCES BHD	5,300	7.25	38,425.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	15,000	4.98	74,700.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	12,600	5.25	66,150.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	15,600	5.37	83,772.00	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	8,700	4.50	39,150.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	10,100	3.99	40,299.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	33,300	5.18	172,494.00	

	HONG LEONG BANK BERHAD	4,700	16.90	79,430.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.30	30,970.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	29,600	8.53	252,488.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	22,600	19.62	443,412.00	
	RHB BANK BHD	11,800	5.66	66,788.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	21,900	4.13	90,447.00	
	DIGI.COM BHD	21,800	4.48	97,664.00	
	MAXIS BERHAD	18,700	5.18	96,866.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,200	3.76	30,832.00	
	PETRONAS GAS BHD	4,300	15.50	66,650.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	23,300	13.16	306,628.00	
	YTL CORP BHD	16,000	0.83	13,360.00	
マレーシアリンギット 小計		484,540		3,239,380.00 (85,001,331)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	37,400	11.60	433,840.00	
	IRPC PCL-NVDR	53,200	3.50	186,200.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	10,600	120.00	1,272,000.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	84,300	43.25	3,645,975.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	9,100	69.00	627,900.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	14,200	34.75	493,450.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	14,800	53.75	795,500.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	5,800	381.00	2,209,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	31,900	75.50	2,408,450.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	54,700	10.80	590,760.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	46,800	13.70	641,160.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	19,400	38.50	746,900.00	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	41,800	16.50	689,700.00	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	4,100	65.75	269,575.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	7,300	45.50	332,150.00	
	CP ALL PCL-NVDR	43,200	76.00	3,283,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	25,400	27.50	698,500.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	7,000	41.00	287,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	21,900	13.80	302,220.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	70,900	24.60	1,744,140.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	3,200	135.50	433,600.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	3,100	176.50	547,150.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	8,900	155.00	1,379,500.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	5,500	155.00	852,500.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	16.40	478,880.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	5,600	121.00	677,600.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	135,700	1.60	217,120.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,200	60.25	253,050.00	

	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	6,300	62.75	395,325.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	17,300	62.25	1,076,925.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	54,800	9.80	537,040.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	8,900	212.00	1,886,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,700	58.75	863,625.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	53.50	246,100.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	76,500	4.44	339,660.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	53.00	360,400.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	1,900	345.00	655,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	11,000	42.75	470,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	5,800	81.50	472,700.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	3,500	167.00	584,500.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	4,800	70.75	339,600.00	
タイバーツ 小計		1,016,100		34,726,245.00 (126,056,269)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	16,450	48.95	805,227.50	
	AYALA CORPORATION	1,940	806.00	1,563,640.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	600	894.50	536,700.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	20,070	76.90	1,543,383.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,665	1,060.00	1,764,900.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	123.60	898,572.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	2,550	192.00	489,600.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,110	150.10	1,067,211.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	7,737	85.95	664,995.15	
	BDO UNIBANK INC	13,500	151.80	2,049,300.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,040	66.25	863,900.00	
	SECURITY BANK CORP	2,020	205.00	414,100.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	4.30	476,870.00	
	ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW	146	5.19	757.74	
	AYALA LAND INC	55,900	45.50	2,543,450.00	
	MEGAWORLD CORP	92,000	4.43	407,560.00	
	ROBINSONS LAND CO	17,200	26.20	450,640.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	76,100	39.00	2,967,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	220	1,940.00	426,800.00	
	PLDT INC	530	1,075.00	569,750.00	
	ABOITIZ POWER CORP	12,000	34.45	413,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,350	319.00	430,650.00	
フィリピンペソ 小計		460,298		21,349,306.39 (46,114,501)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	1,230.00	142,557,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	10,400	2,420.00	25,168,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	12,200	20,925.00	255,285,000.00	

	BARITO PACIFIC TBK PT	208,200	1,360.00	283,152,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	16,100	6,800.00	109,480,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	19,400.00	256,080,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	12,900	9,200.00	118,680,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	21,300	11,450.00	243,885,000.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	4,940.00	39,520,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	151,300	6,500.00	983,450,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	66,900	1,580.00	105,702,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	53,600	6,725.00	360,460,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	14,300	11,325.00	161,947,500.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	50,375.00	201,500,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	54,700	1,935.00	105,844,500.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	35,600	7,950.00	283,020,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	10,500	41,800.00	438,900,000.00	
	KALBE FARMA PT	153,100	1,525.00	233,477,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	52,100	7,500.00	390,750,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	2,130.00	33,015,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	72,100	31,400.00	2,263,940,000.00	
	PT BANK MANDIRI	139,600	6,975.00	973,710,000.00	
	PT BANK RAKYAT	409,600	4,090.00	1,675,264,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,250.00	35,250,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	565.00	44,861,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	366,600	3,930.00	1,440,738,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	35,400	3,340.00	118,236,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	65,600	1,920.00	125,952,000.00	
インドネシアルピア 小計		2,226,300		11,449,824,500.00 (89,308,631)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	421	47,850.00	20,144,850.00	
	S-OIL CORPORATION	310	89,200.00	27,652,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	377	146,500.00	55,230,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	630	17,550.00	11,056,500.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	658	31,750.00	20,891,500.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	68	406,000.00	27,608,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	113	73,100.00	8,260,300.00	
	LG CHEM LTD	341	306,500.00	104,516,500.00	
	LG CHEM LTD	63	167,000.00	10,521,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	122	220,000.00	26,840,000.00	
	OCI COMPANY LTD	110	61,900.00	6,809,000.00	
	POSCO	580	230,500.00	133,690,000.00	
	POSCO CHEMUCAL CO LTD	201	48,100.00	9,668,100.00	
	CJ CORP	90	92,100.00	8,289,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	165	89,900.00	14,833,500.00	

DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	4,460.00	2,716,140.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	137	26,350.00	3,609,950.00	
DOOSAN BOBCAT INC	289	31,300.00	9,045,700.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	512	30,000.00	15,360,000.00	
HANWHA CORPORATION	165	24,550.00	4,050,750.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	128	27,650.00	3,539,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	562	40,950.00	23,013,900.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	70	346,000.00	24,220,000.00	
KCC CORP	36	217,000.00	7,812,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	596	37,300.00	22,230,800.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	274	120,000.00	32,880,000.00	
LG CORP	652	71,000.00	46,292,000.00	
LOTTE CORPORATION	108	35,650.00	3,850,200.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	441	18,250.00	8,048,250.00	
SAMSUNG C&T CORPORATION	643	98,900.00	63,592,700.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,267	18,800.00	23,819,600.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	3,170	6,960.00	22,063,200.00	
SK HOLDINGS CO LTD	241	257,500.00	62,057,500.00	
S1 CORPORATION	106	93,600.00	9,921,600.00	
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	157,500.00	11,655,000.00	
GLOVIS CO LTD	153	150,500.00	23,026,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	295	24,750.00	7,301,250.00	
PAN OCEAN CO LTD	2,212	4,200.00	9,290,400.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	611	33,250.00	20,315,750.00	
HANON SYSTEMS	1,587	10,800.00	17,139,600.00	
HYUNDAI MOBIS	493	245,000.00	120,785,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,103	121,000.00	133,463,000.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	265	81,300.00	21,544,500.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	180	72,100.00	12,978,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	1,966	43,250.00	85,029,500.00	
FILA KOREA LTD	358	51,600.00	18,472,800.00	
HLB INC	261	115,100.00	30,041,100.00	
LG ELECTRONICS INC	732	69,900.00	51,166,800.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	364	89,600.00	32,614,400.00	
KANGWON LAND INC	845	29,350.00	24,800,750.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	23,650.00	12,605,450.00	
KAKAO CORP	343	155,500.00	53,336,500.00	
NAVER CORPORATION	1,030	172,000.00	177,160,000.00	
NCSOFT CORP	124	493,000.00	61,132,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	149	88,000.00	13,112,000.00	
PEARLABYSS CORP	54	185,300.00	10,006,200.00	
CJ ENM CO LTD	57	152,600.00	8,698,200.00	

HOTEL SHILLA CO LTD	258	84,700.00	21,852,600.00	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	132	83,200.00	10,982,400.00	
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	132,500.00	7,950,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	63	281,500.00	17,734,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	61	168,000.00	10,248,000.00	
E-MART INC	171	131,000.00	22,401,000.00	
GS RETAIL CO LTD	99	38,100.00	3,771,900.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	70	248,000.00	17,360,000.00	
KT&G CORPORATION	872	97,800.00	85,281,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	179	103,000.00	18,437,000.00	
OTTOGI CORPORATION	4	557,000.00	2,228,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	228	189,000.00	43,092,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	87,800.00	2,897,400.00	
AMOREPACIFIC GROUP	240	81,200.00	19,488,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP-RIGHTS	10	2,912.00	29,120.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	70	1,265,000.00	88,550,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	744,000.00	12,648,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	415	49,250.00	20,438,750.00	
CELLTRION INC	665	174,000.00	115,710,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	54	319,500.00	17,253,000.00	
HELIXMITH CO LTD	137	90,900.00	12,453,300.00	
MEDY-TOC INC	23	302,300.00	6,952,900.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	116	393,500.00	45,646,000.00	
YUHAN CORPORATION	76	216,000.00	16,416,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	2,009	6,960.00	13,982,640.00	
HANA FINANCIAL GROUP INC.	2,246	35,750.00	80,294,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,867	11,750.00	21,937,250.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	2,934	46,050.00	135,110,700.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	3,322	43,550.00	144,673,100.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,300	11,700.00	38,610,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	303	71,700.00	21,725,100.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	4,250.00	6,715,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,873	7,230.00	20,771,790.00	
SAMSUNG CARD CO LTD	106	37,100.00	3,932,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	453	36,100.00	16,353,300.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	12,400.00	9,275,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	359	55,700.00	19,996,300.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	2,290.00	2,184,660.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	333	28,000.00	9,324,000.00	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	120	28,550.00	3,426,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	223	232,500.00	51,847,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	490	71,600.00	35,084,000.00	

	SAMSUNG SDS CO LTD	239	195,500.00	46,724,500.00	
	KMW CO LTD	241	46,400.00	11,182,400.00	
	LG DISPLAY CO LTD	1,686	14,700.00	24,784,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	115	122,000.00	14,030,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	391	111,000.00	43,401,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	34,674	50,300.00	1,744,102,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,025	40,850.00	246,121,250.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	409	231,000.00	94,479,000.00	
	LG UPLUS CORP	649	13,400.00	8,696,600.00	
	SK TELECOM CO LTD	141	246,000.00	34,686,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	1,765	27,900.00	49,243,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	265	37,400.00	9,911,000.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	3,989	80,900.00	322,710,100.00	
韓国ウォン 小計		106,906		5,734,945,800.00 (534,496,948)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	8,000	96.00	768,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	16,000	45.45	727,200.00	
	CHINA STEEL CORP	88,000	23.40	2,059,200.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	26,000	87.30	2,269,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	33,000	97.20	3,207,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	38,000	71.50	2,717,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	34,073	41.40	1,410,622.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	441.00	441,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	25,000	29.75	743,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,060	260.50	536,630.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	9.01	90,100.00	
	EVA AIRWAYS CORP	18,897	14.00	264,558.00	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	22,350	12.40	277,140.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	12,000	35.95	431,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	14,000	41.60	582,400.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	2,000	396.00	792,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,200	191.00	420,200.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	10,000	34.00	340,000.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	2,000	221.00	442,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	280.00	280,000.00	
	POU CHEN	19,000	39.75	755,250.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	1,200	75.70	90,840.00	
	TATUNG CO LTD	10,000	22.05	220,500.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	597.00	1,194,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	305.50	1,222,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	66.30	132,600.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	36,000	72.50	2,610,000.00	

CHANG HWA COMMERCIAL BANK	36,253	22.95	832,006.35	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	137,000	21.85	2,993,450.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	77,785	27.05	2,104,084.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	74,863	22.95	1,718,105.85	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	60,359	21.70	1,309,790.30	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	81,000	30.30	2,454,300.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	69,760	12.85	896,416.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	62,643	14.25	892,662.75	
TAIWAN BUSINESS BANK	44,288	12.50	553,600.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	69,276	20.75	1,437,477.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	25,299	49.90	1,262,420.10	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	8,262	136.50	1,127,763.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	72,000	19.75	1,422,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	57,000	41.70	2,376,900.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	83,000	9.71	805,930.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	21,540	25.35	546,039.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	50,000	44.80	2,240,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	68,432	10.05	687,741.60	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	46.55	279,300.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	45.60	82,080.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	5,000	159.00	795,000.00	
ACER INC	18,000	17.95	323,100.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	299.50	898,500.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	230.50	1,152,500.00	
AU OPTRONICS CORP	78,000	8.78	684,840.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	5,000	249.50	1,247,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	4,010	88.50	354,885.00	
COMPAL ELECTRONICS	37,000	18.80	695,600.00	
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	140.00	2,100,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	5,000	66.60	333,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	91,800	88.50	8,124,300.00	
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	48,000	7.90	379,200.00	
INVENTEC CORPORATION	24,000	22.85	548,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	380	4,435.00	1,685,300.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	15,000	48.40	726,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	4,000	83.90	335,600.00	
PEGATRON CORP	14,000	68.00	952,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	18,000	60.30	1,085,400.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	36.85	368,500.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	2,000	170.00	340,000.00	
WISTRON CORPORATION	25,293	27.70	700,616.10	
WIWYNN CORP	1,000	553.00	553,000.00	

	WPG HOLDINGS CO LTD	9,520	37.95	361,284.00	
	YAGEO CORPORATION	2,198	330.00	725,340.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	4,000	134.50	538,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	28,000	113.00	3,164,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	11,000	73.10	804,100.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	11,000	114.50	1,259,500.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	27,000	75.60	2,041,200.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	331.00	662,000.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	11,000	421.50	4,636,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	71.20	569,600.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	4,000	223.50	894,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	284.50	284,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	94.10	564,600.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	230.50	691,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	179,000	305.00	54,595,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	80,000	14.95	1,196,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	5,000	71.60	358,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	302.50	907,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	20,000	17.45	349,000.00	
新台湾ドル 小計		2,389,541		150,032,721.50 (538,617,470)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,014	511.55	2,564,911.70	
	COAL INDIA LTD	8,717	205.25	1,789,164.25	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,473	282.60	1,264,069.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	13,301	131.40	1,747,751.40	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	17,465	131.75	2,301,013.75	
	PETRONET LNG LTD	4,423	271.50	1,200,844.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	20,779	1,551.15	32,231,345.85	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	204.65	920,720.35	
	ASIAN PAINTS LTD	1,962	1,706.15	3,347,466.30	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,004	496.55	995,086.20	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	2,103	787.05	1,655,166.15	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	9,223	200.15	1,845,983.45	
	JSW STEEL LTD	6,718	261.55	1,757,092.90	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	886	1,303.00	1,154,458.00	
	SHREE CEMENT LTD	61	20,996.55	1,280,789.55	
	TATA STEEL LTD	2,053	427.50	877,657.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	660	4,259.10	2,811,006.00	
	UPL LTD	3,725	573.25	2,135,356.25	
	VEDANTA LTD	13,075	144.60	1,890,645.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	10,356	79.15	819,677.40	
	HAVELLS INDIA LTD	1,471	667.45	981,818.95	

LARSEN & TOUBRO LTD	3,569	1,330.55	4,748,732.95	
SIEMENS LTD	617	1,470.20	907,113.40	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,400	382.05	1,681,020.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	1,604	579.00	928,716.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	676	1,444.20	976,279.20	
BAJAJ AUTO LTD	657	3,176.00	2,086,632.00	
BHARAT FORGE LTD	778	464.40	361,303.20	
BOSCH LIMITED	55	16,142.60	887,843.00	
EICHER MOTORS LTD	103	22,881.40	2,356,784.20	
HERO MOTOCORP LTD	688	2,433.55	1,674,282.40	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,110	530.55	2,711,110.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	788	7,245.85	5,709,729.80	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,442	129.55	964,111.10	
TATA MOTORS LTD	12,440	161.50	2,009,060.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	46	22,049.10	1,014,258.60	
TITAN CO LTD	2,146	1,159.70	2,488,716.20	
INFO EDGE INDIA LTD	500	2,633.75	1,316,875.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	5,651	293.05	1,656,025.55	
AVENUE SUPERMARTS LTD	731	1,822.50	1,332,247.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	426	3,057.70	1,302,580.20	
ITC LIMITED	25,552	246.40	6,296,012.80	
NESTLE INDIA LTD	178	14,453.95	2,572,803.10	
UNITED SPIRITS LTD	2,109	606.25	1,278,581.25	
COLGATE PALMOLIVE INDIA	573	1,474.20	844,716.60	
DABUR INDIA LIMITED	4,168	459.10	1,913,528.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,808	725.00	2,035,800.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	4,783	2,035.30	9,734,839.90	
MARICO LTD	3,281	359.90	1,180,831.90	
AUROBINDO PHARMA LIMITED	1,539	449.90	692,396.10	
CIPLA LTD	2,022	466.70	943,667.40	
DIVI'S LABORATORIES LTD	596	1,786.20	1,064,575.20	
DR.REDDY'S LABORATORIES	798	2,913.85	2,325,252.30	
LUPIN LTD	1,307	800.65	1,046,449.55	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	481	1,810.45	870,826.45	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	5,791	449.85	2,605,081.35	
AXIS BANK LIMITED	15,330	739.05	11,329,636.50	
BANDHAN BANK LTD	2,530	581.20	1,470,436.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	11,886	2,297.25	27,305,113.50	
ICICI BANK LIMITED	34,946	512.60	17,913,319.60	
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,397	464.10	648,347.70	
STATE BANK OF INDIA	12,129	341.85	4,146,298.65	
BAJAJ FINANCE LIMITED	1,298	4,074.20	5,288,311.60	

	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	350	3,536.95	1,237,932.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,348	351.85	826,143.80	
	REC LTD	5,374	137.90	741,074.60	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	1,349	1,127.20	1,520,592.80	
	BAJAJ FINSERV LTD	294	9,110.25	2,678,413.50	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,535	571.50	2,020,252.50	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	1,428	1,362.90	1,946,221.20	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,564	502.45	1,288,281.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,697	960.05	2,589,254.85	
	DLF LIMITED	4,986	219.70	1,095,424.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	3,666	1,127.65	4,133,964.90	
	INFOSYS LIMITED	24,916	696.35	17,350,256.60	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	6,602	2,053.25	13,555,556.50	
	TECH MAHINDRA LTD	3,203	761.45	2,438,924.35	
	WIPRO LTD	8,396	237.70	1,995,729.20	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	15,227	442.45	6,737,186.15	
	BHARTI INFRATEL LTD	1,237	276.30	341,783.10	
	GAIL INDIA LIMITED	8,986	126.05	1,132,685.30	
	NTPC LTD	18,498	116.35	2,152,242.30	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	12,595	193.30	2,434,613.50	
	TATA POWER CO LTD	4,120	57.35	236,282.00	
インドルピー 小計		449,268		274,645,087.95 (422,953,435)	
エジプトポンド	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	11.86	64,696.30	
	EASTERN TOBACCO	5,913	15.01	88,754.13	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	10,178	78.81	802,128.18	
エジプトポンド 小計		21,546		955,578.61 (6,497,934)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	1,848	133.33	246,393.84	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	416	1,212.48	504,391.68	
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	3,120	274.07	855,098.40	
	GOLD FIELDS LIMITED	5,712	76.95	439,538.40	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	6,071	112.60	683,594.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	490	375.88	184,181.20	
	NORTHAM PLATINUM LTD	2,882	107.00	308,374.00	
	SASOL LTD.	4,187	264.00	1,105,368.00	
	SIBANYE GOLD LTD	17,578	28.88	507,652.64	
	BIDVEST GROUP LTD	1,887	202.97	383,004.39	
	MULTICHOICE GROUP LTD	3,068	121.22	371,902.96	
	MR PRICE GROUP LTD	2,037	175.00	356,475.00	
	NASPERS LIMITED-N SHS	3,194	2,094.88	6,691,046.72	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	7,054	17.68	124,714.72	

	THE FOSCHINI GROUP	1,308	155.18	202,975.44	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	7,756	52.18	404,708.08	
	BID CORP LTD	2,285	322.63	737,209.55	
	CLICKS GROUP LTD	2,022	250.45	506,409.90	
	PICK N PAY STORES LTD	3,137	67.88	212,939.56	
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	3,329	128.16	426,644.64	
	SPAR GROUP LIMITED	1,121	205.92	230,836.32	
	TIGER BRANDS LTD	929	204.30	189,794.70	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	10,359	24.72	256,074.48	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	3,076	117.40	361,122.40	
	ABSA GROUP LTD	4,896	147.26	720,984.96	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	327	1,417.27	463,447.29	
	NEDBANK GROUP LTD	2,834	219.00	620,646.00	
	STANDARD BANK GROUP LIMITED	9,570	165.74	1,586,131.80	
	FIRSTRAND LIMITED	24,877	62.62	1,557,797.74	
	INVESTEC LTD	2,223	84.21	187,198.83	
	PSG GROUP LTD	877	233.23	204,542.71	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,066	285.22	304,044.52	
	REMGRO LTD	3,624	192.20	696,532.80	
	RMB HOLDINGS LTD	5,468	80.65	440,994.20	
	DISCOVERY LTD	3,105	118.06	366,576.30	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	472	111.48	52,618.56	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	3,464	20.35	70,492.40	
	OLD MUTUAL LTD	33,107	18.54	613,803.78	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	5,957	30.19	179,841.83	
	SANLAM LTD	13,975	76.41	1,067,829.75	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	3,006	124.02	372,804.12	
	MTN GROUP LIMITED	12,626	92.37	1,166,263.62	
	TELKOM SA SOC LTD	2,170	46.89	101,751.30	
	VODACOM GROUP LIMITED	4,446	121.12	538,499.52	
南アフリカランド 小計		232,956		27,603,253.65 (207,024,402)	
合　計		17,720,529		4,037,483,203 (4,037,483,203)	

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式　39銘柄	5.5%	11.4%
メキシコペソ	株式　24銘柄	1.2%	2.6%
ブラジルレアル	株式　55銘柄	3.8%	7.9%
チリペソ	株式　17銘柄	0.4%	0.8%
コロンビアペソ	株式　7銘柄	0.2%	0.4%

ユーロ	株式	9銘柄	0.2%	0.4%
トルコリラ	株式	15銘柄	0.3%	0.6%
チェココルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ポーランドズロチ	株式	18銘柄	0.5%	1.1%
香港ドル	株式	208銘柄	11.3%	23.5%
マレーシアリンギット	株式	40銘柄	1.0%	2.1%
タイバーツ	株式	41銘柄	1.5%	3.1%
フィリピンペソ	株式	22銘柄	0.6%	1.1%
インドネシアルピア	株式	28銘柄	1.1%	2.2%
韓国ウォン	株式	112銘柄	6.4%	13.2%
新台湾ドル	株式	88銘柄	6.4%	13.3%
インドルピー	株式	84銘柄	5.0%	10.5%
エジプトポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
南アフリカランド	株式	44銘柄	2.5%	5.1%

(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
投資信託受益証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,568	11,995.20	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	22,394	393,209.52	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	39,708	1,651,058.64	
		ISHARES MSCI UAE ETF	19,639	269,447.08	
	米ドル 小計		83,309	2,325,710.44 (255,083,921)	
	中国元（オフショア）	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	301,800	11,800,380.00	
	中国元（オフショア） 小計		301,800	11,800,380.00 (184,085,928)	
投資信託受益証券合計				439,169,849 (439,169,849)	
投資証券	米ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	34,756	1,020,088.60	
	米ドル 小計		34,756	1,020,088.60 (111,883,317)	
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	23,200	692,984.00	
	メキシコペソ 小計		23,200	692,984.00 (3,887,640)	
	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	2,700	119,070.00	
		KLABIN SA-UNIT	4,600	81,512.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	2,300	122,337.00	
	ブラジルレアル 小計		9,600	322,919.00 (8,357,143)	

	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	9,022	178,184.50	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	20,610	470,114.10	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	43,761	360,153.03	
	南アフリカランド 小計		73,393	1,008,451.63 (7,563,387)	
投資証券合計				131,691,487 (131,691,487)	
合計				570,861,336 (570,861,336)	

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

通貨	銘柄数		組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資信託受益証券	4銘柄	3.0%	－	44.7%
	投資証券	1銘柄	－	1.3%	19.6%
メキシコペソ	投資証券	1銘柄	－	0.0%	0.7%
ブラジルレアル	投資証券	3銘柄	－	0.1%	1.5%
南アフリカランド	投資証券	3銘柄	－	0.1%	1.3%
中国元（オフショア）	投資信託受益証券	1銘柄	2.2%	－	32.2%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

１．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間（2019年12月3日から2020年 6月 2日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 （2020年 6月 2日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	102,131,826
コール・ローン	80,002,017
親投資信託受益証券	25,678,334,967
流動資産合計	25,860,468,810
資産合計	25,860,468,810
負債の部	
流動負債	
未払解約金	22,404,070
未払受託者報酬	4,927,944
未払委託者報酬	25,871,635
未払利息	217
その他未払費用	872,896
流動負債合計	54,076,762
負債合計	54,076,762
純資産の部	
元本等	
元本	11,441,417,318
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	14,364,974,730
元本等合計	25,806,392,048
純資産合計	25,806,392,048
負債純資産合計	25,860,468,810

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自　2019年12月 3日 至　2020年 6月 2日
営業収益	
有価証券売買等損益	△1,463,334,941
営業収益合計	△1,463,334,941
営業費用	
支払利息	47,196
受託者報酬	4,927,944
委託者報酬	25,871,635
その他費用	911,057
営業費用合計	31,757,832
営業利益又は営業損失（△）	△1,495,092,773
経常利益又は経常損失（△）	△1,495,092,773
中間純利益又は中間純損失（△）	△1,495,092,773
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△95,684,713
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,147,998,357
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,427,723,532
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,427,723,532
剰余金減少額又は欠損金増加額	811,339,099
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	811,339,099
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	14,364,974,730

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第10期中間計算期間 自　2019年12月 3日 至　2020年 6月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2019年12月 3日から2020年 6月 2日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項　目	第10期中間計算期間 （2020年 6月 2日現在）	
1.　当中間計算期間の末日における受益権の総数		11,441,417,318口
2.　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.2555円
	(10,000口当たりの純資産額	22,555円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	第10期中間計算期間 （2020年 6月 2日現在）
１.中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項　目	第10期中間計算期間 （2020年 6月 2日現在）
期首元本額	8,544,015,925円
期中追加設定元本額	3,469,175,407円
期中一部解約元本額	571,774,014円

（参考）

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドは、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「エマージング株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

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 6月 2日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	5,228,850,556
金銭信託	264,831,813
コール・ローン	207,448,356
株式	206,619,381,675

	（2020年 6月 2日現在）
投資証券	5,083,324,869
派生商品評価勘定	38,198,226
未収入金	1,322,918,716
未収配当金	324,971,963
差入委託証拠金	1,219,878,164
流動資産合計	220,309,804,338
資産合計	220,309,804,338
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	370,800
前受金	38,196,626
未払金	5,594,011,060
未払解約金	323,232,332
未払利息	563
その他未払費用	36,231
流動負債合計	5,955,847,612
負債合計	5,955,847,612
純資産の部	
元本等	
元本	58,960,159,670
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	155,393,797,056
元本等合計	214,353,956,726
純資産合計	214,353,956,726
負債純資産合計	220,309,804,338

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。

項　目	自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
	(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 6月 2日現在）	
1．　当計算期間の末日における受益権の総数		58,960,159,670口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.6356円
	(10,000口当たりの純資産額	36,356円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2020年 6月 2日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 6月 2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	2,302,358,835	-	2,340,555,461	38,196,626
	SPMINI 2006	1,698,887,223	-	1,724,883,930	25,996,707
	DJ EUR 2006	372,279,833	-	382,087,419	9,807,586
	FTSE 2006	115,076,477	-	116,314,553	1,238,076
	SPI200 2006	116,115,302	-	117,269,559	1,154,257
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	226,538,450	-	226,907,650	△369,200
	米ドル	143,028,200	-	143,068,100	△39,900
	カナダドル	7,142,400	-	7,144,200	△1,800
	ユーロ	21,551,400	-	21,560,400	△9,000
	英ポンド	10,772,800	-	10,776,800	△4,000
	ノルウェークローネ	18,666,900	-	18,799,200	△132,300
	オーストラリアドル	4,388,400	-	4,389,600	△1,200
	ニュージーランドドル	18,459,650	-	18,642,250	△182,600
	香港ドル	2,220,800	-	2,219,200	1,600
	イスラエルシュケル	307,900	-	307,900	-
合計		2,528,897,285	-	2,567,463,111	37,827,426

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2020年 6月 2日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,882,488,969円
同期中における追加設定元本額	10,331,898,947円
同期中における一部解約元本額	11,254,228,246円
2020年 6月 2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	26,537,714,155円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	338,699,914円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,357,870,559円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	897,763,017円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	65,947,500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）	1,957,999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）	8,051,354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）	23,277,645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）	53,791,143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）	45,455,484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）	97,011,797円
外国株式指数ファンド	573,100,926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	6,191,281,347円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	152,690,622円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	181,221,612円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	140,699,396円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	9,755,663円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	64,069,891円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	50,974,629円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	160,362,368円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	79,147,293円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	99,325,068円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	24,967,454円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	35,049,134円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	817,153円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	4,515,121円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	2,757,160円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,731,112円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,241,516,331円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,218,462円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	71,673,896円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,428,159,305円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,439,390,245円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	5,985,791,628円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	19,027,519円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	100,846,152円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	287,788円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	713,495,112円

（2020年 6月 2日現在）	
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	60,893,919円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	170,832,318円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	746,092,551円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	622,774,635円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,473,388,772円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	573,581円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	286,626,093円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	127,763,394円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	17,994,714円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	12,795,416円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	6,812,692円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	43,227,998円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	107,098,490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＞	584,294,110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＞	128,273,888円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,434,560,413円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	234,987,038円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	518,225,861円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	7,310,083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＞	14,283,164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＞	18,724,751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II＜適格機関投資家限定＞	135,212,835円
合計	58,960,159,670円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 6月 2日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	905,629,989
金銭信託	524,680,461
コール・ローン	410,993,293
株式	4,413,821,907
投資信託受益証券	490,009,333
投資証券	154,360,708
派生商品評価勘定	244,847,049
未収入金	22,121,387
未収配当金	7,321,794
差入委託証拠金	726,990,281
流動資産合計	7,900,776,202
資産合計	7,900,776,202
負債の部	
流動負債	

	（2020年 6月 2日現在）
派生商品評価勘定	7,998,945
前受金	156,930,711
未払金	545,359,508
未払解約金	2,138,059
未払利息	1,115
その他未払費用	71,339
流動負債合計	712,499,677
負債合計	712,499,677
純資産の部	
元本等	
元本	5,954,343,091
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,233,933,434
元本等合計	7,188,276,525
純資産合計	7,188,276,525
負債純資産合計	7,900,776,202

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。
	外貨建資産等の会計処理

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2020年 6月 2日現在）	
１．　当計算期間の末日における受益権の総数		5,954,343,091口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2072円
	(10,000口当たりの純資産額	12,072円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2020年 6月 2日現在）
１.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 6月 2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	1,983,829,528	-	2,140,760,239	156,930,711
	MSCIE 2006	1,983,829,528	-	2,140,760,239	156,930,711
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,559,272,343	-	2,635,081,931	75,809,588
	米ドル	2,537,721,506	-	2,613,590,475	75,868,969

	ハンガリーフォリント	944,792	-	943,208	△1,584
	香港ドル	1,328,614	-	1,325,801	△2,813
	フィリピンペソ	4,631,520	-	4,609,348	△22,172
	南アフリカランド	14,645,911	-	14,613,099	△32,812
	売建	1,625,572,343	-	1,621,464,538	4,107,805
	米ドル	1,621,550,837	-	1,617,431,765	4,119,072
	ブラジルレアル	74,361	-	73,845	516
	香港ドル	817,320	-	815,556	1,764
	フィリピンペソ	347,866	-	347,866	-
	南アフリカランド	2,781,959	-	2,795,506	△13,547
合計		6,168,674,214	-	6,397,306,708	236,848,104

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2020年 6月 2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	6,294,909,292円
同期中における追加設定元本額	1,647,123,729円
同期中における一部解約元本額	1,987,689,930円

2020年 6月 2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	2,625,341,702円
三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド	1,855,164,983円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	187,344,894円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	438,201,555円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	324,401,732円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	14,732,977円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	42,023,964円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	28,954,485円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	132,976,956円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	90,007,818円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	159,879,989円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	37,433,877円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,548,148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＞	15,330,011円
合計	5,954,343,091円

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド

2020年 6月30日現在

Ⅰ　資産総額	27,298,889,373円
Ⅱ　負債総額	16,084,252円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,282,805,121円
Ⅳ　発行済口数	11,921,177,092口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2886円
（1万口当たり純資産額）	（22,886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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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

ホ　受益権の再分割

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

ヘ　償還金

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

ト　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

イ　資本金の額および株式数

	2020年6月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　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。

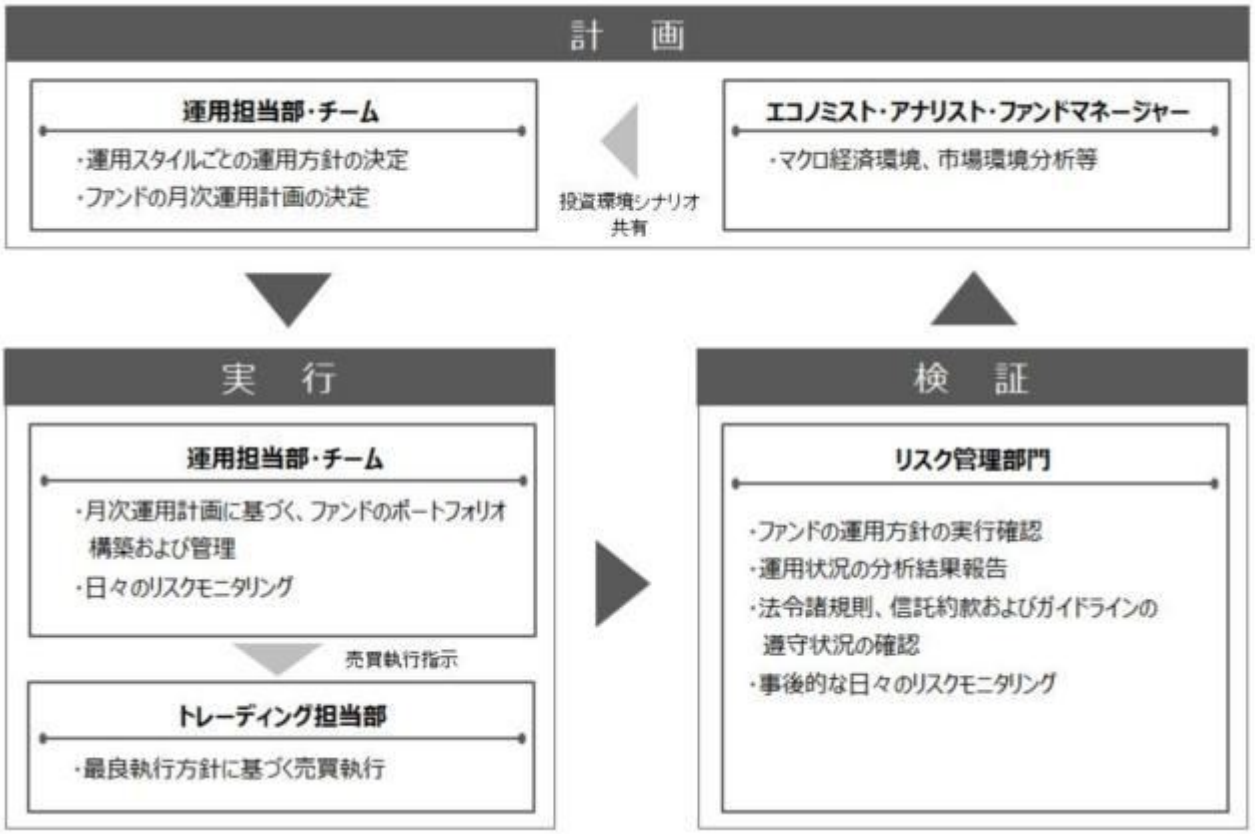
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

ニ　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6月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本　数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	744	7,367,544
単位型株式投資信託	124	592,384
追加型公社債投資信託	1	28,659
単位型公社債投資信託	182	451,225
合　計	1,051	8,439,814

3【委託会社等の経理状況】

1　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2　当社は、当事業年度（2019年４月１日から2020年３月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

（単位：千円）

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		

資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					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			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	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。

①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。

②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

①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。

②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			
①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			
①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)①その他有価証券」には含めておりません。

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

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（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な原因別の内訳

（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

①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。

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

①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。

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	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% ―	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	2,499,836	未払手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	5,789,062	未払手数料	1,154,875

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

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

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	㈱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㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	6,265,593	未払手数料	890,935

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

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

(１株当たり情報)

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

（注）1. 潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 当社は、2018年11月１日付で普通株式１株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。
１株当たり情報については、当該株式分割を2019年３月期の期首（2018年4月１日）に行ったものと仮定して、１株当たり純資産額及び１株当たり当期純利益を算定しております。
3. １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自 2018年４月１日 至 2019年３月31日）	当事業年度 （自 2019年４月１日 至 2020年３月31日）
１株当たり当期純利益金額		
当期純利益（千円）	4,183,413	578,811
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	4,183,413	578,811
期中平均株式数（株）	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018年９月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年４月１日付で合併いたしました。

１．企業結合の概要

(1)被取得企業の名称及び事業の内容

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

(2)企業結合を行った主な理由

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

(3)企業結合日

2019年４月１日

(4)企業結合の法的形式

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

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号　2019年１月16日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号　2019年１月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

２．財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年４月１日から2020年３月31日

３．被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

４．合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1)合併比率

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

(2)合併比率の算定方法

当社はＥＹトランザクション・アドバイザリー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はＰｗＣアドバイザリー合同会社を、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)発生したのれんの金額

37,043,811千円

(2)発生原因

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

(3)償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

７．企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

（参考）大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

※当該（参考）において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

１．委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号。）により作成しております。

２．財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

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

独立監査人の監査報告書

令和１年６月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	飯田浩司	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐藤栄裕	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（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			
ソフトウエア		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		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						△3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	△870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

総平均法による原価法を採用しております。

(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。

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。

(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エアについては、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。

(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。

(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。

(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。

(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。

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ＳＭＡＭ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

①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。

②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。

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

（3）退職給付費用

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

3.確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：千円）

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

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

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

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

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

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

（１）当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

（２）当該資産除去債務の金額の算定方法

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

（３）当該資産除去債務の総額の増減

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

（単位：千円）

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

1.報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期（自　平成29年4月1日　至　平成30年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2.地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自　平成30年4月1日　至　平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2.地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

第46期（自 平成29年4月1日　至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	―	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払※1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	―	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払※1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

※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	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	―	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払※1	1,465,685	未払手数料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

※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、ＳＭＡＭとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、ＳＭＡＭ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　　株式会社日本カストディ銀行＊
・　資本金の額　　51,000百万円（2020年7月27日現在）
・　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。

＊株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、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が合併して発足しました。

ロ　販売会社

（イ）名称	（ロ）資本金の額※	（ハ）事業の内容
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
いちよし証券株式会社	14,577百万円	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
岡地証券株式会社	1,500百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
極東証券株式会社	5,251百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	10,007百万円	
フィリップ証券株式会社	950百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき、損害保険業を営んでいます。

※資本金の額は、2020年3月末現在。
※住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ　受託会社
信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ　販売会社
委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、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。
販売会社である三井住友海上火災保険株式会社は、委託会社株式を15.0%保有しています。

第３【その他】

１　目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
（１）「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
（２）委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
（３）委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
（４）請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
（５）目論見書の使用開始日を記載することがあります。
（６）投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
（７）請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
（８）「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
（９）当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
（10）ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
（11）写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
２　目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
３　当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
４　目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
５　評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
６　有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年６月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　羽　太　典　明　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　菅　野　雅　子　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　佐　藤　栄　裕　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年３月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

令和2年1月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小 澤 陽 一　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅 野 雅 子　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドの平成30年12月1日から令和1年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドの令和1年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

―――

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

独立監査人の中間監査報告書

2020年7月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドの2019年12月3日から2020年6月2日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンドの2020年6月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年12月3日から2020年6月2日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

―――

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