

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年12月7日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年9月11日至 2020年9月10日)
【ファンド名】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に 対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるもの をいいます。
対象指数	その他の指数 (合成指数)	目論見書または信託約款において、委託会社が定 める合成指数に連動する運用成果を目指す旨の記 載があるものをいいます。

## 商品分類表

単位型・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
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本			
	年4回	北米			
	年6回(隔月)	欧州			
不動産投信	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
	日々	オセアニア			
	その他 ( )	中南米			
		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投信) 資産配分固定型))		中近東(中東)			その他 (合成指数)
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せん。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年10月 3日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、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、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

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

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2020年9月30日現在)

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

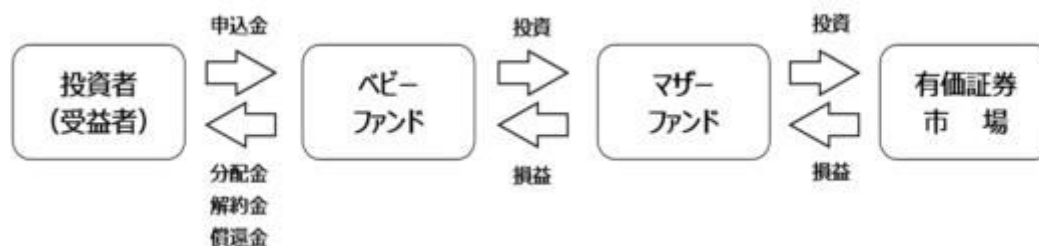
(2020年9月30日現在)

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

世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 以下の各指数の比率に基づいて委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

マザーファンドおよび対象指数	基本資産 配分比率
----------------	--------------

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

- (八) 実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

**1** マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

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

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式(除く日本) ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

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

[ 各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率 ]

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

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

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

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

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

## ファンドのしくみ

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





## 各マザーファンドの投資方針等

## ▶ 債券

## 国内債券

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

## 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり)…為替ヘッジあり

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

## 先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## ▶ 株式

## 国内株式

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

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きと連動する投資成果を目指します。</li> <li>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 新興国株式…為替ヘッジなし

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

## ▶リート

### 国内リート

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

### 外国リート…為替ヘッジなし

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

## (2)【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、国内債券パッシブ・マザーファンド、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンド、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)、外国株式インデックス・マザーファンド、エマージング株式インデックス・マザーファンド、Jリート・インデックス・マザーファンド、外国リート・インデックス・マザーファンドの受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

ます。)

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

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

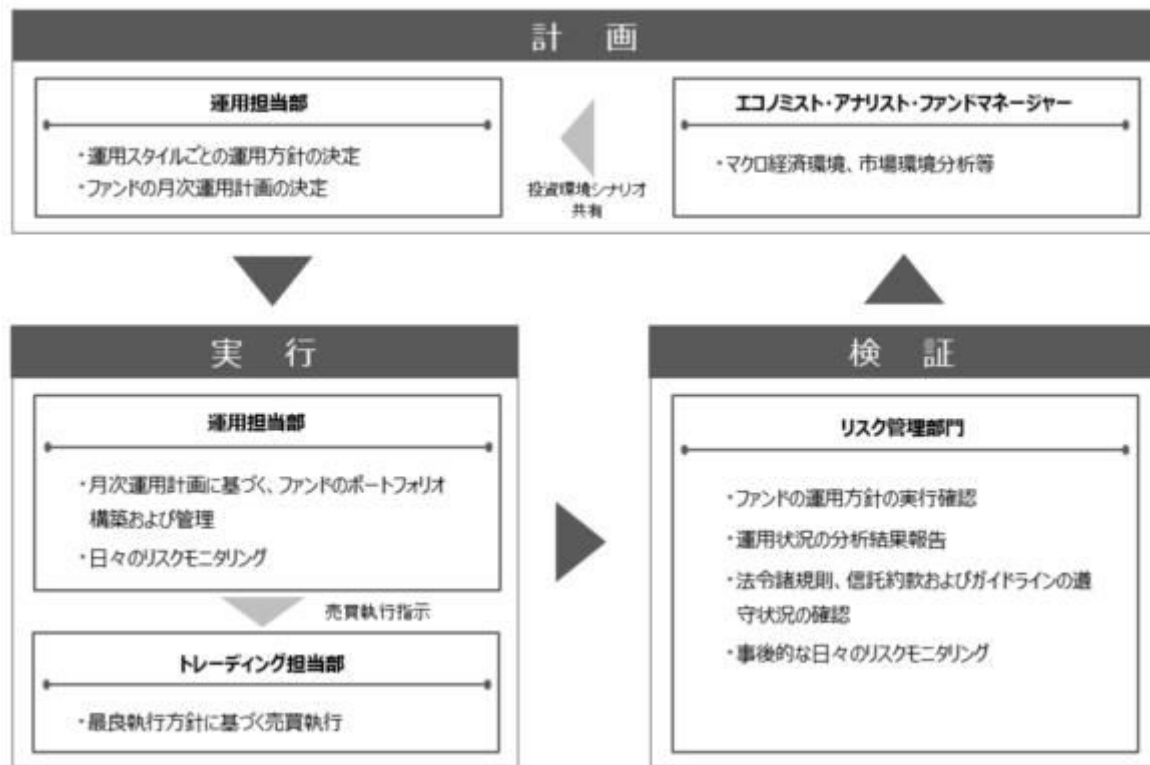
#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### (3) 【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

#### （４）【分配方針】

年１回（原則として毎年9月10日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

#### （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドに

おける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### ロ 投資する株式等の範囲

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

#### ハ 信用取引の指図

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

#### ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号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。

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

#### ホ スワップ取引の指図

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

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

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

#### ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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

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

(ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

- (ト)「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ)「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ)「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- 1.株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - 2.公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ)上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ)委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### チ 有価証券の空売りの指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡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ます。
- (ロ)上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

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



- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。
- ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限  
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- ル 外国為替予約取引の指図
- (イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ヲ 資金の借入れ
- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

(参考情報: マザーファンドの投資方針等)

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフアンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

### (ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチ

マークの動きと連動する投資成果を目指します。

- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

## 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフ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）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ニ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- （ホ）同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ヘ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ト）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- （チ）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- （リ）外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

### （外国債券パッシブ・マザーファンド）

#### （1）投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

- （イ）F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- （ロ）ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- （ハ）ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- （ニ）保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- （ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- （ヘ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

#### （2）投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

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

##### ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書
  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. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。))への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

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

## (国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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



## 八 投資対象とする金融商品

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

### （3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（ハ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一のもの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GING株式インデックス・マザーファンド）

#### （1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

（ハ）外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

#### （2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号

で定めるものをいいます。)

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

#### 八 投資対象とする金融商品

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

#### (3) 投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## ( Jリート・インデックス・マザーファンド )

## ( 1 ) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

## ( 2 ) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

- 1 . 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券( 新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。 )
- 2 . コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 3 . 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
- 4 . 投資信託の受益証券( 金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。 )
- 5 . 投資証券( 金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。 )
- 6 . 外国法人が発行する譲渡性預金証書

## ハ 投資対象とする金融商品

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

## ( 3 ) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は行いません。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ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、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## (外国リート・インデックス・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

(イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーフンドが投資対象とする資産の種類に同じです(デリバティブ取引を除きます。)

## ロ 投資対象とする有価証券

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

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの

4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

## ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

(ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ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) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

#### (イ) 株式市場リスク

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

#### (ロ) 債券市場リスク

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

#### (ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

#### (ニ) 信用リスク

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

#### (ホ) 為替変動リスク

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

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

#### (ヘ) カントリーリスク

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

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

#### (ト) 市場流動性リスク

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

(チ) 指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物等とインデックスの動きとの不一致等から、上記合成指数の動きに連動しないことがあります。

(リ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、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。

(ヌ) 換金制限等に関する留意点

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

(ル) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

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



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。  
※ファンドのベンチマークは合成指数です。

### 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



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

## 各資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.231%（税抜き0.21%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き）>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.09%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について



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

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

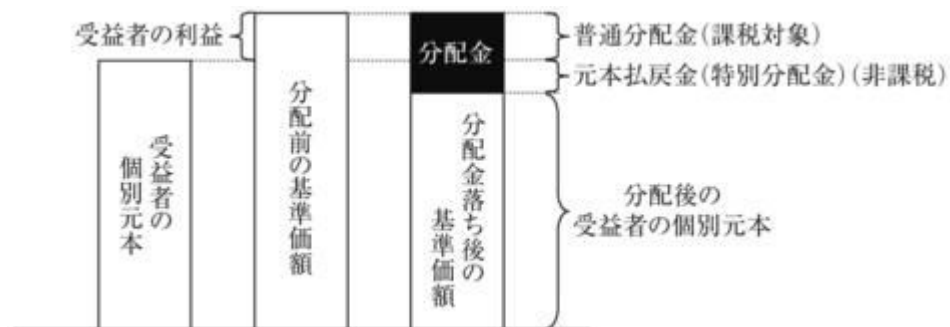
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税


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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資 非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	公募株式投資信託 (新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象と なる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)		0～19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の 1月1日現在)
非課税の期間	最長20年間 (投資期間は2037年まで)	最長5年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	40万円/年 (最大800万円)	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)
留意事項	 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9月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2020年9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	554,271,659	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,853,312	0.87
合計(純資産総額)		559,124,971	100.00

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

#### イ 主要投資銘柄

2020年9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	外国債券バッシブ・マザーファンド	58,410,949	1.9147	111,842,564	1.9120	111,681,734	19.97
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	28,290,755	4.0075	113,376,883	3.9268	111,092,136	19.87
日本	親投資信託受益証券	国内債券バッシブ・マザーファンド	65,668,552	1.2789	83,987,074	1.2805	84,088,580	15.04
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	45,336,894	1.8789	85,187,317	1.8135	82,218,457	14.70
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	21,115,765	2.6353	55,646,631	2.6571	56,106,699	10.03
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	40,113,357	1.3754	55,173,662	1.3489	54,108,907	9.68
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	12,681,369	2.1495	27,259,158	2.1779	27,618,753	4.94
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券バッシブ・マザーファンド	17,672,089	1.5375	27,171,025	1.5480	27,356,393	4.89

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9月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.13
合計	99.13

## 【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期 (2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
2019年 9月末日	309,146,537		10,505	
10月末日	335,372,044		10,777	
11月末日	353,932,092		10,876	
12月末日	373,898,534		10,995	
2020年 1月末日	394,407,508		11,002	
2月末日	395,819,025		10,579	
3月末日	374,853,127		9,525	
4月末日	413,768,939		9,903	
5月末日	448,295,216		10,131	
6月末日	478,792,911		10,288	
7月末日	504,969,556		10,436	
8月末日	544,445,460		10,783	
9月末日	559,124,971		10,614	

## 【分配の推移】

## 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	0
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	0
第3期	2019年 9月11日～2020年 9月10日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率（％）
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## （参考）

## （１）投資状況

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年 9月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	日本	102,791,876,240	77.87
地方債証券	日本	8,900,358,690	6.74
特殊債券	日本	14,732,803,761	11.16

社債券	日本	4,759,885,000	3.61
	オーストラリア	200,120,000	0.15
	フランス	199,140,000	0.15
	小計	5,159,145,000	3.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		425,135,866	0.32
合計(純資産総額)		132,009,319,557	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	9,868,652,836	42.49
	フランス	2,406,021,462	10.36
	イタリア	2,133,482,022	9.19
	ドイツ	1,711,925,209	7.37
	イギリス	1,475,569,542	6.35
	スペイン	1,369,007,752	5.89
	ベルギー	563,716,614	2.43
	オーストラリア	545,277,923	2.35
	カナダ	428,909,118	1.85
	オランダ	404,055,377	1.74
	オーストリア	389,544,858	1.68
	シンガポール	218,039,356	0.94
	アイルランド	190,658,368	0.82
	メキシコ	165,727,636	0.71
	フィンランド	149,870,881	0.65
	ポーランド	145,612,596	0.63
	デンマーク	120,343,572	0.52
	イスラエル	87,694,207	0.38
	スウェーデン	70,489,125	0.30
ノルウェー	47,067,524	0.20	
	小計	22,491,665,978	96.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		731,752,221	3.15
合計(純資産総額)		23,223,418,199	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		22,405,113,600	96.47

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	71,884,689,975	43.44
	フランス	17,019,741,370	10.29
	イタリア	15,772,110,865	9.53
	ドイツ	12,309,433,949	7.44
	イギリス	10,784,056,939	6.52
	スペイン	10,097,283,315	6.10
	ベルギー	4,485,272,092	2.71
	オーストラリア	3,964,643,660	2.40
	オランダ	3,138,112,773	1.90
	カナダ	3,128,323,124	1.89
	オーストリア	2,693,019,696	1.63
	アイルランド	1,309,297,031	0.79
	メキシコ	1,243,705,290	0.75
	フィンランド	1,102,397,401	0.67
	ポーランド	1,036,847,373	0.63
	デンマーク	856,472,130	0.52
	シンガポール	784,158,950	0.47
	マレーシア	772,498,774	0.47
	イスラエル	645,372,922	0.39
	スウェーデン	472,504,967	0.29
ノルウェー	367,416,738	0.22	
	小計	163,867,359,334	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,612,598,826	0.97
合計(純資産総額)		165,479,958,160	100.00

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2020年 9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	169,269,263,075	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,306,096,492	1.92
合計(純資産総額)		172,575,359,567	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,535,780,000	1.46
合計	買建		2,535,780,000	1.46

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 9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	153,139,840,644	65.63
	イギリス	9,471,793,004	4.06
	スイス	8,416,781,977	3.61
	カナダ	7,776,200,765	3.33
	フランス	7,498,854,457	3.21
	ドイツ	7,183,073,541	3.08
	オーストラリア	4,359,310,189	1.87
	オランダ	4,357,351,604	1.87
	アイルランド	4,131,901,511	1.77
	スウェーデン	2,392,104,626	1.03
	デンマーク	1,921,718,239	0.82
	香港	1,783,880,051	0.76
	スペイン	1,691,734,331	0.72
	イタリア	1,365,661,816	0.59
	フィンランド	931,995,923	0.40
	ジャージー	720,170,753	0.31
	バミューダ	711,278,409	0.30
	ベルギー	676,603,806	0.29
	シンガポール	657,938,464	0.28
	イスラエル	440,132,343	0.19
ケイマン諸島	439,331,095	0.19	
ノルウェー	420,934,841	0.18	
ニュージーランド	231,433,157	0.10	
ルクセンブルグ	170,596,183	0.07	



	キュラソー	121,217,853	0.05
	ポルトガル	120,778,050	0.05
	オーストリア	116,474,435	0.05
	リベリア	61,566,967	0.03
	マン島	33,151,981	0.01
	パプアニューギニア	18,194,158	0.01
	小計	221,362,005,173	94.87
投資証券	アメリカ	4,327,359,959	1.85
	オーストラリア	600,816,081	0.26
	シンガポール	124,952,048	0.05
	イギリス	123,932,212	0.05
	香港	120,443,846	0.05
	フランス	96,380,297	0.04
	カナダ	34,883,383	0.01
	小計	5,428,767,826	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,552,017,533	2.80
合計(純資産総額)		233,342,790,532	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,220,040,808	2.23
	買建	ドイツ	1,129,514,888	0.48
	買建	イギリス	303,614,068	0.13
	買建	オーストラリア	246,418,232	0.10
合計	買建		6,899,587,996	2.94

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		1,607,259,400	0.68

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年 9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	1,795,346,181	17.78
	台湾	856,526,246	8.48
	韓国	835,800,174	8.28
	インド	574,044,185	5.68
	中国	438,585,544	4.34
	ブラジル	302,633,907	3.00
	南アフリカ	234,038,280	2.32
	香港	204,294,523	2.02
	タイ	124,278,730	1.23
	マレーシア	118,608,829	1.17
	メキシコ	107,030,949	1.06
	インドネシア	87,169,564	0.86
	フィリピン	50,504,008	0.50
	バミューダ	46,621,997	0.46
	ポーランド	44,441,384	0.44
	チリ	34,328,004	0.34
	アメリカ	26,256,247	0.26
	トルコ	21,401,548	0.21
	コロンビア	11,281,430	0.11
	ハンガリー	10,606,006	0.11
	ルクセンブルグ	10,278,730	0.10
	ギリシャ	8,736,994	0.09
	エジプト	7,606,601	0.08
	チェコ	6,436,058	0.06
	ペルー	2,847,541	0.03
	シンガポール	1,365,478	0.01
マン島	1,328,456	0.01	
アルゼンチン	1,140,345	0.01	
	小計	5,963,537,939	59.06
新株予約権証券	タイ	10,268	0.00
投資信託受益証券	香港	342,911,718	3.40
	アメリカ	305,573,991	3.03
	小計	648,485,709	6.42

投資証券	アメリカ	194,216,996	1.92	
	ブラジル	7,564,216	0.07	
	メキシコ	2,964,112	0.03	
	南アフリカ	1,936,397	0.02	
	小計	206,681,721	2.05	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,279,305,233	32.47	
合計(純資産総額)			10,098,020,870	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	3,309,013,496	32.76
合計	買建		3,309,013,496	32.76

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,129,365,777	21.08
	売建		65,782,054	0.65

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	6,727,134,960	98.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		111,041,503	1.62
合計(純資産総額)		6,838,176,463	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物取引	買建	日本	51,555,000	0.75

合計	買建		51,555,000	0.75
----	----	--	------------	------

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	5,623,699,496	73.20
	オーストラリア	561,975,301	7.31
	イギリス	404,416,674	5.26
	シンガポール	341,224,195	4.44
	カナダ	142,577,856	1.86
	フランス	139,060,251	1.81
	香港	134,478,503	1.75
	ベルギー	107,539,384	1.40
	ニュージーランド	35,552,008	0.46
	スペイン	34,945,463	0.45
	ドイツ	22,225,357	0.29
	オランダ	13,658,589	0.18
	ガーンジー	10,080,379	0.13
	アイルランド	9,713,731	0.13
	韓国	3,474,552	0.05
	イスラエル	3,058,716	0.04
	イタリア	1,244,124	0.02
マン島	980,115	0.01	
	小計	7,589,904,694	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		92,802,357	1.21
合計(純資産総額)		7,682,707,051	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		21,066,336	0.27

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	103.02	2,091,366,900	102.55	2,081,765,000	0.800	2023/6/20	1.58
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,890,000,000	101.00	1,908,971,000	101.01	1,909,259,100	0.100	2025/6/20	1.45
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	104.85	1,525,611,150	104.08	1,514,422,200	1.700	2022/12/20	1.15
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,325,000,000	101.05	1,338,912,500	101.06	1,339,058,250	0.100	2029/12/20	1.01
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	103.23	1,326,621,150	102.78	1,320,812,950	0.800	2023/9/20	1.00
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	102.28	1,293,879,950	101.85	1,288,478,400	0.800	2022/9/20	0.98
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	103.34	1,255,581,000	102.80	1,249,105,050	1.000	2023/3/20	0.95
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	108.65	1,108,301,400	107.76	1,099,182,600	2.100	2024/3/20	0.83
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	1,080,000,000	100.92	1,089,936,000	100.99	1,090,735,200	0.100	2030/3/20	0.83
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	106.89	1,095,663,500	106.05	1,087,033,000	1.900	2023/9/20	0.82
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	107.39	1,095,439,200	106.56	1,086,932,400	1.900	2023/12/20	0.82
日本	特殊債券	第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	101.36	1,013,620,000	100.91	1,009,190,000	1.200	2021/6/30	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	965,000,000	101.36	978,192,200	101.31	977,718,700	0.100	2029/3/20	0.74
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	130.27	966,670,180	129.44	960,452,220	2.400	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	938,000,000	101.52	952,295,120	101.31	950,334,700	0.100	2026/12/20	0.72
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	111.98	951,838,500	111.07	944,146,000	2.000	2025/12/20	0.72
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	890,000,000	101.43	902,727,000	101.23	901,009,300	0.100	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	890,000,000	101.37	902,255,300	101.18	900,519,800	0.100	2026/3/20	0.68
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	790,000,000	114.27	902,755,500	113.95	900,236,600	1.200	2035/9/20	0.68
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	760,000,000	114.21	868,054,300	113.74	864,477,200	1.200	2034/12/20	0.65
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	850,000,000	101.16	859,919,500	101.12	859,545,500	0.100	2029/9/20	0.65
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	110.43	861,416,400	109.45	853,717,800	2.400	2024/6/20	0.65
日本	国債証券	第56回利付国債(20年)	818,000,000	104.52	855,022,680	103.69	848,208,740	2.000	2022/6/20	0.64
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	114.86	852,283,460	113.89	845,130,580	2.300	2026/6/20	0.64
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	815,000,000	102.91	838,781,700	102.54	835,709,150	0.600	2024/3/20	0.63
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	734,000,000	114.73	842,176,920	113.80	835,314,020	2.100	2026/12/20	0.63
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	820,000,000	101.09	828,938,000	101.03	828,470,600	0.100	2025/3/20	0.63
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	805,000,000	102.61	826,074,900	102.38	824,159,000	0.400	2025/3/20	0.62

日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	811,000,000	101.49	823,095,500	101.29	821,478,120	0.100	2026/9/20	0.62
日本	国債証券	第72回利付国債(20年)	753,000,000	109.76	826,492,800	108.89	820,001,940	2.100	2024/9/20	0.62

## ロ 種類別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.87
地方債証券	6.74
特殊債券	11.16
社債券	3.91
合計	99.68

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	1,500,000	11,592.53	173,888,087	11,514.84	172,722,634	8.000	2021/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,300,000	10,923.02	141,999,305	10,913.10	141,870,361	1.625	2022/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,200,000	10,943.68	131,324,251	10,937.90	131,254,819	1.500	2023/3/31	0.57
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	850,000	15,299.60	130,046,656	15,299.10	130,042,434	3.500	2026/4/25	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,100,000	11,292.49	124,217,465	11,284.23	124,126,544	2.125	2024/2/29	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,000,000	11,866.13	118,661,313	11,856.21	118,562,125	2.875	2025/4/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,054.44	110,544,468	11,045.35	110,453,547	2.000	2023/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	11,004.85	110,048,531	10,999.06	109,990,672	1.625	2023/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	10,990.80	109,908,016	10,984.18	109,841,891	1.625	2023/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	10,985.84	109,858,422	10,976.75	109,767,500	1.750	2023/1/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	10,943.68	109,436,875	10,928.80	109,288,094	1.875	2022/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	10,884.17	108,841,751	10,867.64	108,676,438	1.875	2022/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,000,000	10,852.76	108,527,656	10,847.80	108,478,062	1.375	2022/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	10,818.87	108,188,767	10,802.34	108,023,454	2.000	2021/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	900,000	11,838.02	106,542,252	11,839.68	106,557,131	2.500	2026/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	950,000	10,942.03	103,949,326	10,939.55	103,925,770	1.375	2023/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	900,000	11,504.09	103,536,872	11,485.91	103,373,213	2.875	2023/11/30	0.45

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	900,000	11,473.51	103,261,626	11,464.42	103,179,796	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	900,000	11,453.67	103,083,089	11,433.01	102,897,113	2.750	2023/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	900,000	11,375.97	102,383,817	11,360.27	102,242,475	2.750	2023/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	640,000	15,731.96	100,684,570	15,570.78	99,653,020	3.375	2048/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	800,000	12,205.02	97,640,175	12,205.84	97,646,787	2.375	2029/5/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.5	650,000	14,686.08	95,459,536	14,781.32	96,078,586	1.500	2031/5/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	900,000	10,632.07	95,688,661	10,650.25	95,852,320	0.375	2025/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	750,000	12,775.35	95,815,125	12,776.17	95,821,324	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	900,000	10,565.12	95,086,096	10,575.04	95,175,365	0.125	2023/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	830,000	11,482.60	95,305,631	11,462.76	95,140,980	2.500	2024/5/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	400,000	23,175.08	92,700,355	23,459.18	93,836,759	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	800,000	11,466.07	91,728,600	11,461.11	91,688,925	2.250	2024/10/31	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 2.3	710,000	12,774.60	90,699,728	12,753.37	90,548,973	2.300	2021/10/15	0.39

## □ 種類別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.85
合計	96.85

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	11,800,000	10,588.26	1,249,415,344	11,197.44	1,321,298,184	1.750	2024/6/30	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	7,700,000	10,620.94	817,812,734	10,608.10	816,823,940	0.250	2023/6/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,500,000	10,587.61	794,070,791	10,579.17	793,438,012	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	12,104.57	653,647,212	14,583.04	787,484,281	3.000	2048/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,237.11	707,938,385	12,390.99	780,632,904	2.625	2029/2/15	0.47
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	4,900,000	14,622.21	716,488,714	15,510.32	760,005,829	3.500	2030/3/1	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	10,752.75	698,928,855	11,298.28	734,388,386	2.125	2024/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,828.79	682,214,107	11,464.42	722,258,578	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	11,426.40	628,452,000	12,521.59	688,687,745	2.875	2028/8/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,458.49	632,738,969	11,347.05	686,496,525	1.625	2026/5/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	22,364.13	648,559,901	23,459.18	680,316,503	4.500	2041/4/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,487.96	674,398,313	13,134.57	656,728,922	3.000	2022/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,921.37	622,518,111	11,462.76	653,377,819	2.500	2024/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.5	4,350,000	14,443.30	628,283,561	14,781.32	642,987,462	1.500	2031/5/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,875.90	609,050,925	11,469.38	642,285,350	2.375	2024/8/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.25	4,900,000	12,873.76	630,814,394	13,029.90	638,465,253	0.250	2026/11/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,200,000	11,020.12	573,046,656	12,205.84	634,704,121	2.375	2029/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,450,000	10,328.19	562,886,682	11,549.55	629,450,903	1.625	2029/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,000,000	11,700.91	585,045,898	12,476.96	623,848,050	2.875	2028/5/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000	13,107.92	589,856,546	13,179.40	593,073,171	0.500	2026/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	11,294.15	542,119,200	12,335.61	592,109,700	2.750	2028/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,012.29	561,626,903	11,501.61	586,582,478	2.750	2024/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	10,979.22	537,982,257	11,949.61	585,531,091	2.375	2027/5/15	0.35
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	2,700,000	21,654.94	584,683,625	21,632.40	584,074,819	4.750	2034/7/4	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	10,696.38	534,819,000	11,627.25	581,362,737	2.000	2026/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	4,500,000	12,492.46	562,161,049	12,812.35	576,556,078	0.000	2029/11/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	4,800,000	11,077.26	531,708,480	11,875.22	570,010,727	2.625	2025/12/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	10,875.08	543,754,143	11,296.62	564,831,487	2.500	2023/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	4,900,000	10,772.58	527,856,866	11,497.48	563,376,734	2.125	2025/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000	13,176.23	474,344,382	15,608.80	561,917,025	3.625	2044/2/15	0.34

## □ 種類別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.03
合計	99.03

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	829,200	7,594.31	6,297,201,852	6,932.00	5,748,014,400	3.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	578,700	4,251.00	2,460,053,700	6,469.00	3,743,610,300	2.17



日本	株式	ソニー	電気機器	465,600	6,942.72	3,232,530,432	8,032.00	3,739,699,200	2.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	67,300	37,580.46	2,529,164,958	48,980.00	3,296,354,000	1.91
日本	株式	任天堂	その他製品	45,600	42,821.93	1,952,680,008	59,660.00	2,720,496,000	1.58
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	618,500	4,368.89	2,702,158,465	3,744.00	2,315,664,000	1.34
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	508,500	3,890.72	1,978,431,120	4,160.00	2,115,360,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	974,600	2,752.00	2,682,099,200	2,150.00	2,095,390,000	1.21
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,010,900	563.24	2,822,339,316	416.10	2,085,035,490	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	637,900	2,326.61	1,484,144,519	3,229.00	2,059,779,100	1.19
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	521,500	3,000.87	1,564,953,705	3,885.00	2,026,027,500	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	94,700	15,583.12	1,475,721,464	19,300.00	1,827,710,000	1.06
日本	株式	日本電産	電気機器	178,800	7,961.68	1,423,548,384	9,805.00	1,753,134,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	147,500	9,943.75	1,466,703,125	11,860.00	1,749,350,000	1.01
日本	株式	信越化学工業	化学	124,900	11,757.25	1,468,480,525	13,685.00	1,709,256,500	0.99
日本	株式	村田製作所	電気機器	218,300	6,407.05	1,398,659,015	6,773.00	1,478,545,900	0.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	506,700	3,875.89	1,963,913,463	2,917.50	1,478,297,250	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	585,000	3,032.67	1,774,111,950	2,473.50	1,446,997,500	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	531,400	3,132.08	1,664,387,312	2,656.00	1,411,398,400	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	69,900	20,628.11	1,441,904,889	20,120.00	1,406,388,000	0.81
日本	株式	花王	化学	177,800	8,612.02	1,531,217,156	7,887.00	1,402,308,600	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	511,600	2,410.40	1,233,160,640	2,685.00	1,373,646,000	0.80
日本	株式	S M C	機械	23,300	49,332.58	1,149,449,114	58,460.00	1,362,118,000	0.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	995,930	1,644.70	1,638,006,071	1,310.50	1,305,166,265	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	47,200	22,457.36	1,059,987,392	27,330.00	1,289,976,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	357,000	4,175.44	1,490,632,080	3,543.00	1,264,851,000	0.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	479,000	2,844.26	1,362,400,540	2,512.50	1,203,487,500	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	258,900	5,862.33	1,517,757,237	4,600.00	1,190,940,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	633,400	1,922.29	1,217,578,486	1,803.00	1,142,020,200	0.66
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	75,400	14,967.98	1,128,585,692	14,740.00	1,111,396,000	0.64

## □ 種類別・業種別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.15
		建設業	2.41
		食料品	3.69
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.16

	医薬品	6.38
	石油・石炭製品	0.39
	ゴム製品	0.53
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.55
	非鉄金属	0.64
	金属製品	0.56
	機械	5.38
	電気機器	15.21
	輸送用機器	6.92
	精密機器	2.69
	その他製品	2.75
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	3.66
	海運業	0.14
	空運業	0.32
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.95
	卸売業	4.62
	小売業	4.96
	銀行業	4.64
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	1.82
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.91
	サービス業	5.63
合計		98.08

## 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 9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	900,098	7,129.86	6,417,574,527	12,070.72	10,864,832,731	4.66
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	373,954	16,282.61	6,088,950,879	21,928.10	8,200,103,699	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	22,004	198,311.51	4,363,646,686	332,728.30	7,321,353,601	3.14
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	124,918	21,265.80	2,656,481,205	27,697.38	3,459,901,565	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,717	137,434.20	2,160,053,322	155,455.11	2,443,288,027	1.05

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,588	137,818.25	2,148,310,944	155,104.91	2,417,775,431	1.04
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	136,868	14,516.81	1,986,887,846	15,558.94	2,129,522,095	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	154,605	11,877.87	1,836,379,637	12,619.88	1,951,097,784	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	128,611	12,784.87	1,644,275,173	14,522.10	1,867,702,832	0.80
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	87,326	19,356.11	1,690,291,662	21,100.75	1,842,644,269	0.79
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	31,950	25,365.54	810,429,322	55,971.37	1,788,285,399	0.77
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	38,542	9,423.60	363,204,622	44,337.60	1,708,860,010	0.73
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	46,370	30,551.86	1,416,690,027	35,573.13	1,649,526,224	0.71
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	55,874	23,247.43	1,298,927,127	28,789.23	1,608,569,884	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,248	22,588.29	1,631,959,498	22,264.55	1,608,569,353	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	158,294	13,446.12	2,128,440,436	10,088.03	1,596,874,621	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,054	29,394.41	1,441,913,585	32,179.07	1,578,512,100	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	214,971	6,274.99	1,348,942,595	6,267.59	1,347,350,520	0.58
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,440	35,440.37	1,291,447,185	36,835.80	1,342,296,844	0.58
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	24,897	33,377.78	831,006,688	51,771.11	1,288,945,425	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	93,837	15,385.43	1,443,723,158	13,267.32	1,244,965,507	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM, INC.	ソフトウェア・サービス	46,725	18,051.59	843,460,823	26,180.20	1,223,270,312	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	22,848	34,839.93	796,022,949	52,210.18	1,192,898,284	0.51
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	57,948	11,730.04	679,732,706	20,578.10	1,192,459,739	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	219,959	6,096.19	1,340,913,176	5,415.90	1,191,276,388	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	236,620	4,572.67	1,081,986,595	4,887.95	1,156,589,095	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	131,128	9,052.24	1,187,003,176	8,665.02	1,136,226,743	0.49
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	370,148	3,858.52	1,428,225,682	2,994.14	1,108,274,933	0.47

アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	288,577	3,984.42	1,149,814,279	3,826.78	1,104,322,424	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	211,966	5,522.75	1,170,637,346	5,175.73	1,097,080,057	0.47

## ロ 種類別・業種別の投資比率

2020年 9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	2.59
		素材	4.33
		資本財	6.04
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	1.52
		耐久消費財・アパレル	1.87
		消費者サービス	1.51
		メディア・娯楽	6.53
		小売	6.12
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.32
		家庭用品・パーソナル用品	2.17
		ヘルスケア機器・サービス	5.19
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.29
		銀行	4.77
		各種金融	4.07
		保険	2.91
		不動産	0.50
		ソフトウェア・サービス	12.16
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.07		
電気通信サービス	1.97		
公益事業	3.29		
半導体・半導体製造装置	3.97		
投資証券			2.33
合計			97.19

## 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 9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	19,221	22,884.94	439,871,497	29,299.19	563,159,808	5.58
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	58,600	5,134.45	300,878,915	6,900.07	404,344,395	4.00
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	252,000	1,190.51	300,009,623	1,568.84	395,347,680	3.92
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		469,800	639.03	300,217,904	729.91	342,911,718	3.40
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	48,873	4,680.79	228,764,518	5,284.56	258,272,301	2.56
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		61,449	4,175.93	256,607,076	3,393.00	208,496,826	2.06
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		62,460	3,045.45	190,219,362	3,109.46	194,216,996	1.92
ケイマン諸島	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	36,500	2,087.88	76,207,916	3,202.29	116,883,585	1.16
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	29,286	2,350.93	68,849,513	3,255.32	95,335,375	0.94
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	4,471	14,579.09	65,183,156	18,502.93	82,726,634	0.82
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	8,747	4,798.76	41,974,808	7,951.92	69,555,514	0.69
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	983,000	83.84	82,417,081	68.38	67,223,930	0.67
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	61,000	1,180.10	71,986,376	1,084.49	66,154,043	0.66
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		30,028	1,845.02	55,402,464	1,867.36	56,073,386	0.56
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	34,841	1,074.82	37,447,809	1,463.04	50,974,125	0.50
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	5,633	7,369.19	41,510,650	7,627.20	42,964,018	0.43
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	63,000	797.55	50,246,178	668.16	42,094,553	0.42
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	16,825	3,168.28	53,306,414	2,483.99	41,793,216	0.41
ブラジル	株式	VALE SA	素材	37,800	978.25	36,978,209	1,095.22	41,399,675	0.41
ケイマン諸島	株式	NETEASE.COM INC -ADR	メディア・娯楽	842	38,681.03	32,569,434	47,690.40	40,155,323	0.40
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI UAE ETF		35,000	1,320.62	46,221,808	1,122.03	39,271,055	0.39
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	8,414	3,863.80	32,510,086	4,585.40	38,581,556	0.38
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,788	12,644.85	35,253,856	12,968.96	36,157,472	0.36
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	127,800	311.32	39,786,995	280.28	35,819,784	0.35
韓国	株式	NAVER CORPORATION	メディア・娯楽	1,271	18,119.06	23,029,326	26,922.19	34,218,116	0.34
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	621,000	73.52	45,661,857	54.46	33,821,834	0.33
台湾	株式	MEDIATEK INCORPORATION	半導体・半導体製造装置	15,000	1,587.50	23,812,542	2,220.40	33,306,000	0.33

インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	9,209	3,021.95	27,829,141	3,608.18	33,227,730	0.33
ケイマン諸島	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	消費者サービス	3,876	5,379.08	20,849,351	7,906.43	30,645,338	0.30
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	107,600	170.04	18,296,449	273.68	29,448,237	0.29

## □ 種類別・業種別の投資比率

2020年 9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	2.51
		素材	3.61
		資本財	1.44
		商業・専門サービス	0.20
		運輸	0.82
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	0.84
		消費者サービス	1.15
		メディア・娯楽	6.10
		小売	9.39
		食品・生活必需品小売り	0.77
		食品・飲料・タバコ	1.75
		家庭用品・パーソナル用品	0.77
		ヘルスケア機器・サービス	0.75
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.81
		銀行	6.00
		各種金融	1.06
		保険	1.92
		不動産	1.34
		ソフトウェア・サービス	1.41
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.29		
電気通信サービス	1.87		
公益事業	1.16		
半導体・半導体製造装置	5.37		
新株予約権証券			0.00
投資信託受益証券			6.42
投資証券			2.05
合計			67.53

Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 9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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	718	651,467.95	467,753,988	596,000	427,928,000	6.26
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	741	585,924.3	434,169,906	538,000	398,658,000	5.83
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,121	350,998.1	393,468,870	355,500	398,515,500	5.83
日本	投資証券	GLP投資法人	2,132	173,008.59	368,854,313	162,800	347,089,600	5.08
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	2,397	142,941.61	342,631,039	132,000	316,404,000	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,058	284,133.67	300,613,422	269,000	284,602,000	4.16
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,476	156,764.74	231,384,756	161,300	238,078,800	3.48
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	1,402	150,381.46	210,834,806	162,400	227,684,800	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	704	316,828.89	223,047,538	311,000	218,944,000	3.20
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,048	187,463.76	196,462,020	180,300	188,954,400	2.76
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,586	115,928.25	183,862,204	116,700	185,086,200	2.71
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,182	73,416.22	160,194,192	77,600	169,323,200	2.48
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	461	313,124.23	144,350,270	326,500	150,516,500	2.20
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	245	671,067.98	164,411,655	607,000	148,715,000	2.17
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	372	405,336.87	150,785,318	399,500	148,614,000	2.17
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	484	285,510.81	138,187,232	301,500	145,926,000	2.13
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	826	183,107.16	151,246,514	176,200	145,541,200	2.13
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	230	605,237.2	139,204,558	629,000	144,670,000	2.12
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,388	45,861.4	109,517,023	51,700	123,459,600	1.81
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	238	542,793.15	129,184,772	502,000	119,476,000	1.75
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	872	135,412.12	118,079,368	136,900	119,376,800	1.75
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	927	104,029.9	96,435,717	108,800	100,857,600	1.47
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	323	328,197.21	106,007,698	307,000	99,161,000	1.45
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,101	26,804.48	83,120,692	31,200	96,751,200	1.41
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	158	597,999.68	94,483,950	604,000	95,432,000	1.40
日本	投資証券	イオンリート投資法人	753	112,971.86	85,067,810	121,100	91,188,300	1.33
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	482	192,206.34	92,643,455	185,900	89,603,800	1.31
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	245	352,903.87	86,461,448	358,000	87,710,000	1.28
日本	投資証券	日本リート投資法人	240	361,348.03	86,723,527	356,500	85,560,000	1.25
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	687	122,084.11	83,871,783	122,900	84,432,300	1.23

## ロ 種類別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.38
合計	98.38

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年 9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 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	47,983	10,795.83	518,016,406	10,538.73	505,680,265	6.58
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5,754	81,714.91	470,187,604	80,774.06	464,773,987	6.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,441	16,153.07	281,725,842	15,607.61	272,212,431	3.54
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	9,984	21,932.92	218,978,321	23,372.27	233,348,824	3.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	26,886	6,083.00	163,547,711	5,766.10	155,027,365	2.02
オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	107,439	1,381.29	148,405,343	1,372.40	147,450,165	1.92
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	22,780	6,619.13	150,783,980	6,464.37	147,258,576	1.92
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,094	16,475.17	149,825,251	15,607.61	141,935,660	1.85
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,372	7,218.71	147,059,630	6,770.14	137,921,333	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	7,777	18,029.32	140,214,039	16,920.59	131,591,460	1.71
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	22,351	5,915.27	132,212,379	5,405.32	120,814,352	1.57
香港	投資証券	LINK REIT	137,300	858.74	117,905,226	849.71	116,665,526	1.52
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	24,911	4,493.89	111,947,518	4,504.96	112,223,158	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	36,362	3,080.47	112,012,256	2,962.40	107,718,789	1.40
イギリス	投資証券	SEGR0 PLC	79,831	1,309.69	104,554,418	1,267.27	101,167,437	1.32
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	35,186	2,961.28	104,195,737	2,861.89	100,698,462	1.31
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	24,787	4,046.41	100,298,595	3,910.36	96,926,292	1.26
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	6,417	15,616.44	100,210,702	14,842.68	95,245,490	1.24
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,193	11,248.01	92,154,986	11,345.99	92,957,712	1.21
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	7,499	12,264.62	91,972,426	12,202.97	91,510,087	1.19
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,227	22,761.81	96,214,179	21,117.67	89,264,433	1.16
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	35,155	2,436.19	85,644,303	2,474.66	86,996,743	1.13
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	9,501	9,217.76	87,578,005	8,493.62	80,697,922	1.05
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	11,091	7,574.22	84,005,697	6,890.75	76,425,353	0.99
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	10,893	7,003.95	76,294,136	6,522.56	71,050,355	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	19,575	3,655.41	71,554,742	3,419.45	66,935,851	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,653	9,388.48	62,461,573	9,460.63	62,941,611	0.82
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,664	1,989.04	66,959,043	1,861.02	62,649,445	0.82
オースト ラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	331,601	152.48	50,565,771	172.11	57,074,236	0.74
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	7,546	8,474.57	63,949,180	7,561.52	57,059,275	0.74

## ロ 種類別の投資比率

2020年 9月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.79
合計	98.79



## 投資不動産物件

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年 9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	売建	93,360,000.00	9,866,560,212	9,875,620,800	42.52
	カナダドル	売建	5,420,000.00	439,984,922	428,288,400	1.84
	メキシコペソ	売建	35,750,000.00	172,350,035	168,382,500	0.72
	ユーロ	売建	74,490,000.00	9,431,597,533	9,249,423,300	39.82
	英ポンド	売建	10,640,000.00	1,506,705,928	1,447,891,200	6.23
	スウェーデンクローナ	売建	5,980,000.00	73,333,936	70,564,000	0.30

ノルウェークロネ	売建	4,200,000.00	51,047,808	47,124,000	0.20
デンマーククロネ	売建	7,250,000.00	123,330,982	120,930,000	0.52
ポーランドズロチ	売建	5,380,000.00	154,996,078	147,358,200	0.63
オーストラリアドル	売建	7,190,000.00	562,178,910	542,701,200	2.33
シンガポールドル	売建	2,810,000.00	218,720,003	217,156,800	0.93
イスラエルシケル	売建	2,920,000.00	92,125,401	89,673,200	0.38

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年 9月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	156	日本円	2,567,149,900	2,535,780,000	1.46

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2020年 9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 2012	買建	296	米ドル	49,350,200.5	5,221,251,213	49,338,760	5,220,040,808	2.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 2012	買建	284	ユーロ	9,325,578	1,157,957,020	9,096,520	1,129,514,888	0.48
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2012	買建	22	オーストラリアドル	3,231,224	243,925,099	3,264,250	246,418,232	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 2012	買建	38	英ポンド	2,267,361	308,565,158	2,230,980	303,614,068	0.13

(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 9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	11,450,000.00	1,207,799,737	1,211,295,500	0.51
	カナダドル	買建	740,000.00	58,372,613	58,474,800	0.02

ユーロ	買建	1,270,000.00	156,303,980	157,695,900	0.06
英ポンド	買建	490,000.00	66,483,098	66,679,200	0.02
スイスフラン	買建	510,000.00	58,289,252	58,670,400	0.02
スウェーデンクローナ	買建	1,510,000.00	17,671,259	17,818,000	0.00
ノルウェークローネ	買建	270,000.00	3,014,683	3,029,400	0.00
デンマーククローネ	買建	850,000.00	14,082,991	14,178,000	0.00
オーストラリアドル	買建	60,000.00	4,531,632	4,528,800	0.00
ニュージーランドドル	買建	20,000.00	1,396,298	1,395,600	0.00
香港ドル	買建	390,000.00	5,323,328	5,319,600	0.00
シンガポールドル	買建	70,000.00	5,388,744	5,410,300	0.00
イスラエルシェケル	買建	90,000.00	2,737,890	2,763,900	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 9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 2012	買建	584	米ドル	31,907,274	3,375,789,589	31,276,120	3,309,013,496	32.76

(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 9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	20,151,090.93	2,132,600,000	2,129,365,777	21.08
	米ドル	売建	622,523.46	66,000,000	65,782,054	0.65

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

### Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年 9月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	30	日本円	51,117,600	51,555,000	0.75

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年 9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	170,621.54	18,000,000	18,050,051	0.23
	ユーロ	買建	4,062.60	500,000	504,453	0.00
	英ポンド	買建	3,686.66	500,000	501,680	0.00
	オーストラリアドル	買建	13,385.32	1,000,000	1,010,323	0.01
	シンガポールドル	買建	12,936.08	1,000,000	999,829	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 参考情報

基準日:2020年9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
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.87
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	外国債券パッシブ・マザーファンド	19.97
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	19.87
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.04
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	14.70
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	10.03
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.68
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	4.94
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4.89

※比率は、当ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	77.87
特殊債券	日本	11.16
地方債証券	日本	6.74
社債券	日本	3.61
	オーストラリア	0.15
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.32
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.58
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	0.100	2025/06/20	1.45
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.15
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	0.100	2029/12/20	1.01
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	1.00
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	0.98
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.95
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.83
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	0.100	2030/03/20	0.83
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1.900	2023/09/20	0.82

## ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	42.49
	フランス	10.36
	イタリア	9.19
	ドイツ	7.37
	イギリス	6.35
	スペイン	5.89
	ベルギー	2.43
	その他	12.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.15
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	8.000	2021/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1,625	1.625	2022/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2023/03/31	0.57
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	3.500	2026/04/25	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/02/29	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2025/04/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2023/02/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1,625	1.625	2023/05/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1,625	1.625	2023/04/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2023/01/31	0.47

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	43.44
	フランス	10.29
	イタリア	9.53
	ドイツ	7.44
	イギリス	6.52
	スペイン	6.10
	ベルギー	2.71
	その他	13.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.97
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2024/06/30	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	0.250	2023/06/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/05/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.47
イタリア	国債証券	BTFS 3.5	3.500	2030/03/01	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1,625	1.625	2026/05/15	0.41

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.92
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.46%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.17
日本	株式	ソニー	電気機器	2.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.91
日本	株式	任天堂	その他製品	1.58
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.34
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.21
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	1.19

## ■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	65.63
	イギリス	4.06
	スイス	3.61
	カナダ	3.33
	フランス	3.21
	ドイツ	3.08
	その他	11.95
	投資証券	アメリカ・その他
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.80
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.94%

## 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	4.66
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP.	ソフトウェア・サービス	3.51
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC.	小売	3.14
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.04
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	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO.	家庭用品・パーソナル用品	0.80
アメリカ	株式	VISA INC.	ソフトウェア・サービス	0.79

## ■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	17.78
	台湾	8.48
	韓国	8.28
	インド	5.68
	その他	18.83
投資信託受益証券	香港・その他	6.42
投資証券	アメリカ・その他	2.05
新株予約権証券	タイ	0.0001
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		32.47
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 32.76%

## 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	5.58
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	4.00
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	3.92
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	3.40
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	2.56
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.06
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	1.92
ケイマン諸島	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	1.16
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	0.94
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	0.82

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.62
合計(純資産総額)		100.00

※リート指数先物取引の買建て 0.75%

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.26
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.83
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5.83
日本	投資証券	GLP投資法人	5.08
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.16
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.48
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.20
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2.76

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	73.20
	オーストラリア	7.31
	イギリス	5.26
	シンガポール	4.44
	カナダ	1.86
	フランス	1.81
	香港	1.75
	その他	3.16
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.58
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	6.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.54
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.02
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.92
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	1.92
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.85
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	1.71

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 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異なります。

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

※2020年の収益率は、年初から2020年9月30日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマーク(合成指数)の情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### イ 申込方法

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

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



の販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

- (二) 申込不可日

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

- ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

- ハ 申込手数料

ありません。

- ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

- ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

- ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

- ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

照会先の名称	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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

2017年10月3日から下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

##### (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

##### (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

##### (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

信託を終了させます。

#### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### (イ) 収益分配金

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

##### (ロ) 償還金

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

#### 八 信託約款の変更等

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

#### 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に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、)に支払われま

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

#### 八 一部解約実行請求権

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

#### 二 書面決議における議決権

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

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期(2019年9月11日から2020年9月10日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2019年 9月10日現在)	第3期 (2020年 9月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,622,120	6,259,369
親投資信託受益証券	292,899,986	540,003,284
流動資産合計	296,522,106	546,262,653
資産合計	296,522,106	546,262,653
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	654,548	938,247
未払受託者報酬	26,309	50,349
未払委託者報酬	249,938	478,288
未払利息	7	18
その他未払費用	7,960	15,133
流動負債合計	938,762	1,482,035
負債合計	938,762	1,482,035
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	283,071,447	508,204,609
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,511,897	36,576,009
元本等合計	295,583,344	544,780,618
純資産合計	295,583,344	544,780,618
負債純資産合計	296,522,106	546,262,653



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2018年 9月11日 至 2019年 9月10日	自	2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,288,215		15,823,298
営業収益合計		10,288,215		15,823,298
営業費用				
支払利息		1,079		2,606
受託者報酬		42,190		89,556
委託者報酬		400,746		850,689
その他費用		13,443		28,213
営業費用合計		457,458		971,064
営業利益又は営業損失( )		9,830,757		14,852,234
経常利益又は経常損失( )		9,830,757		14,852,234
当期純利益又は当期純損失( )		9,830,757		14,852,234
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( )		499,085		92,594
期首剰余金又は期首欠損金( )		582,044		12,511,897
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,787,388		11,878,243
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		2,787,388		11,878,243
剰余金減少額又は欠損金増加額		189,207		2,758,959
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		189,207		2,758,959
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( )		12,511,897		36,576,009

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第3期
	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	283,071,447口	508,204,609口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0442円 (10,000口当たりの純資産額 10,442円)	1口当たり純資産額 1.0720円 (10,000口当たりの純資産額 10,720円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2018年 9月11日 至 2019年 9月10日	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,428,726円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,858,097円）、収益調整金（3,261,815円）、および分配準備積立金（963,259円）より、分配対象収益は12,511,897円（1万口当たり441.98円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,343,778円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（6,601,050円）、収益調整金（13,722,287円）、および分配準備積立金（7,908,894円）より、分配対象収益は36,576,009円（1万口当たり719.67円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2020年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(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2期(自 2018年 9月11日 至 2019年 9月10日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	10,052,712円
合計	10,052,712円

第3期(自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	15,708,305円
合計	15,708,305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）

<p>第3期 自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

（その他の注記）

項 目	第2期 (2019年 9月10日現在)	第3期 (2020年 9月10日現在)
期首元本額	114,481,559円	283,071,447円
期中追加設定元本額	198,345,231円	284,669,114円
期中一部解約元本額	29,755,343円	59,535,952円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	20,691,114	54,506,601	
	外国株式インデックス・マザーファンド	26,928,571	108,015,883	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	16,988,243	26,116,025	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	56,728,071	108,611,564	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	63,782,215	81,571,074	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	12,315,173	26,475,158	

外国リート・インデックス・マザーファンド	43,237,449	81,325,317	
エマージング株式インデックス・マザーファンド	38,808,915	53,381,662	
合計	279,479,751	540,003,284	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

### 国内債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	(単位：円)	
	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	742,374,174	440,038,057
国債証券	110,221,460,350	104,245,403,390
地方債証券	10,749,458,710	8,890,158,495
特殊債券	17,482,863,747	12,898,258,951
社債券	7,088,825,000	5,555,408,000
未収入金	-	401,905,000
未収利息	504,204,067	442,435,604
前払費用	5,064,361	7,582,536
流動資産合計	146,794,250,409	132,881,190,033
資産合計	146,794,250,409	132,881,190,033
負債の部		
流動負債		
未払金	-	401,840,000
未払解約金	360,477,000	91,523,000
未払利息	1,539	1,286
その他未払費用	82,466	7,962
流動負債合計	360,561,005	493,372,248
負債合計	360,561,005	493,372,248
純資産の部		
元本等		
元本	112,020,381,328	103,519,056,378
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	34,413,308,076	28,868,761,407
元本等合計	146,433,689,404	132,387,817,785
純資産合計	146,433,689,404	132,387,817,785
負債純資産合計	146,794,250,409	132,881,190,033

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	112,020,381,328口	103,519,056,378口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3072円 (10,000口当たりの純資産額 13,072円)	1口当たり純資産額 1.2789円 (10,000口当たりの純資産額 12,789円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

<p>項目</p>	<p>(2020年 9月10日現在)</p>
-----------	------------------------



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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2019年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	157,109,944,339円
同期中における追加設定元本額	19,557,082,854円
同期中における一部解約元本額	64,646,645,865円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,649,473,249円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,877,944,639円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,667,101,957円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	780,433,028円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	48,591,736円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	171,675,395円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	321,004,856円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	306,156,890円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	114,965,076円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	218,997,356円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	93,099,364円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,765,199,173円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,126,946,850円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	490,788,817円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,336,368円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	660,773,383円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	223,815,398円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	274,188,567円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	54,395,665円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,513,818円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,042,147円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	416,763円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	262,454円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	111,938円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,793,124,662円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	17,075,396,229円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,997,916,606円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,919,573,011円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	341,530,368円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	560,808,357円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,642,998円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	239,612,092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>	110,370,858円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,962,263,301円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,072,118,528円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,597,943,001円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,007,950,700円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,218,246円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,457,499,955円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,612,040,213円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	479,193,262円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,046,388,134円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	839,200,063円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	182,003,732円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,021,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,885,326,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,383,965,299円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	1,195,530,440円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	996,705,535円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	234,605,464円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,000,249円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	338,835,567円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,974,636,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	287,982,728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>	149,530,083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>	708,265,865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>	990,387,454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>	2,618,559,014円
合計	112,020,381,328円

(2020年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	112,020,381,328円
同期中における追加設定元本額	29,465,214,127円
同期中における一部解約元本額	37,966,539,077円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,404,106,258円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	9,352,829,017円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,998,420,713円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	693,533,147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)	46,082,897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)	181,308,582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)	374,855,441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)	438,754,213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)	177,137,533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)	308,707,190円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	129,902,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,341,808,057円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	382,833,387円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	16,075,994円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	21,159,651円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	824,764,564円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	250,675,696円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	361,732,503円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	76,188,990円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,708,587円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,782,215円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	28,011,160円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	58,057,747円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	12,850,189円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,598,454円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,903,494,951円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	15,454,233,129円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,719,111,006円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,611,697,542円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	316,664,963円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	567,607,238円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,942,066円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	243,859,822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>	117,573,504円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,922,462,329円

S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,101,626,336円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,542,605,879円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,356,692,074円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,655,317円
三井住友 ・ 国内債券インデックスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,358,855,987円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	465,430,954円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	622,224,587円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	179,522,478円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	43,582,648円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	1,689,664,549円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,273,857,452円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	868,223,966円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	211,492,420円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	19,262,253円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	302,431,646円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,618,673,320円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	81,344,659円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	297,899,914円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	926,069,950円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	1,204,188,532円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,927,220,580円
合計	103,519,056,378円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 4 0 4 回利付国債 ( 2 年 )	20,000,000	20,046,600	
	第 4 0 5 回利付国債 ( 2 年 )	10,000,000	10,026,400	
	第 4 0 7 回利付国債 ( 2 年 )	20,000,000	20,061,200	

第409回利付国債(2年)	30,000,000	30,104,400	
第410回利付国債(2年)	110,000,000	110,412,500	
第411回利付国債(2年)	210,000,000	210,915,600	
第413回利付国債(2年)	100,000,000	100,448,000	
第414回利付国債(2年)	300,000,000	301,326,000	
第416回利付国債(2年)	400,000,000	401,856,000	
第131回利付国債(5年)	140,000,000	140,511,000	
第132回利付国債(5年)	95,000,000	95,396,150	
第133回利付国債(5年)	148,000,000	148,689,680	
第134回利付国債(5年)	110,000,000	110,576,400	
第135回利付国債(5年)	190,000,000	191,103,900	
第136回利付国債(5年)	400,000,000	402,560,000	
第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,698,000	
第138回利付国債(5年)	600,000,000	604,434,000	
第139回利付国債(5年)	260,000,000	262,067,000	
第140回利付国債(5年)	600,000,000	605,112,000	
第141回利付国債(5年)	15,000,000	15,133,350	
第142回利付国債(5年)	680,000,000	686,276,400	
第143回利付国債(5年)	940,000,000	948,751,400	
第144回利付国債(5年)	1,140,000,000	1,150,647,600	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	58,812,400	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	345,984,980	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	265,900,500	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	357,241,040	
第5回利付国債(40年)	245,000,000	343,661,500	
第6回利付国債(40年)	250,000,000	345,965,000	
第7回利付国債(40年)	275,000,000	366,580,500	
第8回利付国債(40年)	320,000,000	399,491,200	
第9回利付国債(40年)	453,000,000	423,369,270	
第10回利付国債(40年)	460,000,000	504,357,800	
第11回利付国債(40年)	390,000,000	415,158,900	
第12回利付国債(40年)	410,000,000	394,698,800	
第13回利付国債(40年)	160,000,000	153,904,000	
第322回利付国債(10年)	365,000,000	370,781,600	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	315,728,800	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	396,513,000	

第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,288,870,550	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,448,370	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,527,250	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	132,382,900	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,082,231,900	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,321,082,800	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	811,762,380	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	835,741,750	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	323,593,200	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,253,500	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	348,979,400	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,138,400	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	823,458,650	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	803,628,050	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	789,442,500	
第341回利付国債(10年)	557,000,000	568,658,010	
第342回利付国債(10年)	890,000,000	899,629,800	
第343回利付国債(10年)	890,000,000	899,807,800	
第344回利付国債(10年)	981,000,000	992,281,500	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	948,937,080	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	647,763,200	
第347回利付国債(10年)	630,000,000	637,938,000	
第348回利付国債(10年)	485,000,000	491,338,950	
第349回利付国債(10年)	720,000,000	729,475,200	
第350回利付国債(10年)	990,000,000	1,003,097,700	
第351回利付国債(10年)	930,000,000	941,978,400	
第352回利付国債(10年)	790,000,000	799,867,100	
第353回利付国債(10年)	590,000,000	597,103,600	
第354回利付国債(10年)	965,000,000	975,711,500	
第355回利付国債(10年)	690,000,000	697,272,600	
第356回利付国債(10年)	850,000,000	858,058,000	
第357回利付国債(10年)	1,425,000,000	1,437,540,000	
第358回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,129,587,200	
第359回利付国債(10年)	650,000,000	654,751,500	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	624,999,900	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	386,892,000	

第5回利付国債(30年)	290,000,000	355,714,000	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	593,438,520	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	115,134,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	619,035,900	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	512,564,300	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	735,098,700	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	958,790,140	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	610,484,550	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	581,701,500	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	634,912,600	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	449,048,550	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	420,578,550	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	440,323,730	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	416,181,200	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	394,014,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	483,748,320	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	596,789,600	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	526,040,800	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	239,332,320	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	633,183,280	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	418,943,700	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	528,473,400	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	492,866,640	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	616,502,140	
第35回利付国債(30年)	390,000,000	512,506,800	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	79,100,400	
第37回利付国債(30年)	445,000,000	579,523,500	
第38回利付国債(30年)	340,000,000	436,985,000	
第39回利付国債(30年)	210,000,000	274,883,700	
第40回利付国債(30年)	280,000,000	361,121,600	
第41回利付国債(30年)	310,000,000	393,709,300	
第42回利付国債(30年)	260,000,000	330,530,200	
第43回利付国債(30年)	255,000,000	324,495,150	
第44回利付国債(30年)	340,000,000	433,081,800	
第45回利付国債(30年)	355,000,000	436,568,350	
第46回利付国債(30年)	285,000,000	350,698,200	

第47回利付国債(30年)	270,000,000	338,825,700	
第48回利付国債(30年)	345,000,000	417,308,550	
第49回利付国債(30年)	355,000,000	429,581,950	
第50回利付国債(30年)	325,000,000	346,674,250	
第51回利付国債(30年)	405,000,000	383,008,500	
第52回利付国債(30年)	333,000,000	330,712,290	
第53回利付国債(30年)	247,000,000	250,986,580	
第54回利付国債(30年)	65,000,000	69,241,250	
第55回利付国債(30年)	325,000,000	345,978,750	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	457,442,600	
第57回利付国債(30年)	425,000,000	451,804,750	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	371,801,500	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	414,452,000	
第60回利付国債(30年)	370,000,000	402,419,400	
第61回利付国債(30年)	395,000,000	408,497,150	
第62回利付国債(30年)	55,000,000	53,989,100	
第63回利付国債(30年)	380,000,000	362,238,800	
第64回利付国債(30年)	335,000,000	318,829,550	
第65回利付国債(30年)	295,000,000	280,306,050	
第66回利付国債(30年)	310,000,000	294,081,500	
第67回利付国債(30年)	230,000,000	230,289,800	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	849,026,740	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,515,542,550	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,249,554,600	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,088,017,000	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,087,717,800	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,100,049,600	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	854,490,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	820,438,680	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	727,013,600	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	539,073,500	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	646,274,200	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	688,708,400	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	944,137,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	723,367,500	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	844,655,700	



第89回利付国債(20年)	20,000,000	22,651,000	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	660,254,600	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	834,895,640	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	718,160,560	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	354,428,300	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	786,037,620	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	803,235,510	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	242,523,270	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	421,292,700	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	544,789,700	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	457,555,800	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	437,073,600	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	445,151,700	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	452,805,600	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	396,052,400	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	461,304,740	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	508,151,350	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	433,490,970	
第116回利付国債(20年)	200,000,000	241,660,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	238,506,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	346,046,800	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	230,708,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	302,506,500	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	388,182,300	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	96,763,200	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	227,868,900	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	250,862,600	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	216,505,800	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	172,892,200	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	257,066,900	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	225,144,300	
第130回利付国債(20年)	155,000,000	184,033,050	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	447,028,200	
第132回利付国債(20年)	300,000,000	353,706,000	
第133回利付国債(20年)	190,000,000	226,134,200	
第134回利付国債(20年)	200,000,000	238,452,000	

第135回利付国債(20年)	155,000,000	183,036,400	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	140,340,000	
第137回利付国債(20年)	25,000,000	29,585,250	
第138回利付国債(20年)	125,000,000	145,023,750	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	210,924,000	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	628,516,400	
第141回利付国債(20年)	270,000,000	320,822,100	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	132,033,000	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	200,169,900	
第144回利付国債(20年)	60,000,000	69,911,400	
第145回利付国債(20年)	200,000,000	238,402,000	
第146回利付国債(20年)	155,000,000	185,099,450	
第147回利付国債(20年)	510,000,000	603,493,200	
第148回利付国債(20年)	89,000,000	104,299,990	
第149回利付国債(20年)	695,000,000	815,547,750	
第150回利付国債(20年)	291,000,000	337,944,120	
第151回利付国債(20年)	760,000,000	862,478,400	
第152回利付国債(20年)	205,000,000	232,775,450	
第153回利付国債(20年)	277,000,000	318,660,800	
第154回利付国債(20年)	790,000,000	898,024,600	
第155回利付国債(20年)	340,000,000	376,407,200	
第156回利付国債(20年)	380,000,000	386,205,400	
第157回利付国債(20年)	375,000,000	369,071,250	
第158回利付国債(20年)	320,000,000	329,532,800	
第159回利付国債(20年)	298,000,000	311,144,780	
第160回利付国債(20年)	335,000,000	354,972,700	
第161回利付国債(20年)	610,000,000	636,175,100	
第162回利付国債(20年)	80,000,000	83,347,200	
第163回利付国債(20年)	720,000,000	749,930,400	
第164回利付国債(20年)	215,000,000	220,140,650	
第165回利付国債(20年)	610,000,000	623,743,300	
第166回利付国債(20年)	105,000,000	110,854,800	
第167回利付国債(20年)	520,000,000	530,660,000	
第168回利付国債(20年)	190,000,000	190,326,800	
第169回利付国債(20年)	630,000,000	619,535,700	
第170回利付国債(20年)	325,000,000	319,254,000	

	第171回利付国債(20年)	525,000,000	515,140,500	
	第172回利付国債(20年)	320,000,000	319,708,800	
	第173回利付国債(20年)	510,000,000	509,066,700	
国債証券合計		94,670,000,000	104,245,403,390	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,216,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,194,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,938,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	522,592,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	637,720,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	193,536,765	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,578,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	101,402,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	101,561,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,899,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,798,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,886,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,544,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,971,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,031,000	
	第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	200,120,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,216,000	
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,454,000	
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,206,000	
	平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	110,380,600	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,541,000	
	平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,150,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	328,389,000	
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	129,479,000	
	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	110,842,000	
	平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,235,000	
	平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,966,000	
	平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,332,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,927,000		
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	102,082,000		
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,724,000		

	第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,106,000	
	第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,299,500	
	第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,466,000	
	第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,625,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,310,000	
	第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,947,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,310,000	
	第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,700,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	212,902,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	109,589,000	
	第5回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	113,442,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	135,121,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,446,000	
	平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,050,000	
	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,136,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,074,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,175,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,908,000	
	第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,047,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,961,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,667,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,569,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	149,247,630	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,150,000	
地方債証券合計		8,300,500,000	8,890,158,495	
特殊債券	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	213,710,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,610,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,061,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,192,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,089,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,626,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,044,000	
	第9回道路債券	100,000,000	130,296,000	

第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,215,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	443,619,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,824,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,306,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,859,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	354,948,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,842,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,127,000	
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,009,910,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,174,000	
第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,422,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,370,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,201,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	118,482,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,552,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,323,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,726,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,488,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,814,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	232,778,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,880,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,912,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,730,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,804,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,542,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	409,460,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,181,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,962,000	

第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,003,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	104,211,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,214,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,198,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,955,000	11,112,532	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,136,000	13,612,836	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,418,000	11,604,341	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,629,000	15,278,088	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,898,000	25,688,760	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,763,000	15,502,626	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,553,000	39,793,635	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,571,000	15,237,477	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,661,000	16,533,630	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,050,000	10,118,239	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,963,000	11,046,757	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,036,000	27,491,826	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,101,000	20,329,767	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,366,000	42,135,398	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,949,000	63,847,483	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,959,000	23,420,371	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,672,000	25,311,286	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,171,000	12,456,288	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,538,000	28,516,673	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,206,000	28,166,994	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,336,000	13,722,477	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,910,000	55,356,304	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,217,000	14,742,744	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,207,000	28,970,285	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,860,000	28,468,914	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,781,000	13,162,001	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,989,000	14,603,256	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,120,000	27,221,219	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,543,000	38,861,287	

第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,569,000	32,614,983	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,170,000	60,889,480	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,462,000	30,195,620	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,686,000	13,121,637	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,318,000	67,093,019	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,819,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,380,000	13,889,376	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,652,000	88,539,786	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,733,000	42,016,852	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,498,000	44,933,560	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,806,000	86,602,285	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,434,000	134,389,347	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,990,000	43,073,931	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,990,000	49,086,223	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,266,000	100,457,997	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,952,000	87,125,315	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,833,000	49,421,459	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,601,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,198,000	71,700,891	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,139,000	88,132,384	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,867,000	87,616,662	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,120,000	87,868,360	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,351,000	88,969,457	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,941,000	88,684,101	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,116,000	90,098,949	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	235,342,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,047,000	93,181,939	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,908,000	25,742,916	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,656,000	28,794,597	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,530,000	14,044,681	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,128,000	13,562,274	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,306,000	29,469,376	
い第810号農林債	300,000,000	300,495,000	
第12回国際協力機構債券	100,000,000	101,581,000	
第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,092,000	
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,770,000	

	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,143,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,080,000	
特殊債券合計		12,147,604,000	12,898,258,951	
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債	200,000,000	199,028,000	
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポ レーション円貨社債	200,000,000	200,120,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,325,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,378,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,489,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,550,000	
	第24回株式会社三菱ケミカルホールディング ス無担保社債	100,000,000	100,088,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,959,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,571,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,165,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,578,000	
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,959,000	
	第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保 社債	100,000,000	114,300,000	
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社 債	300,000,000	300,621,000	
	株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保 社債	100,000,000	101,243,000	
	第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,006,000	
	第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,731,000	
	第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ 無担保社債	100,000,000	101,309,000	
	第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,075,000	
	第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,508,000	
	第62回株式会社ホンダファイナンス無担保社 債	100,000,000	99,931,000	
	第63回株式会社ホンダファイナンス無担保社 債	300,000,000	299,829,000	
	第93回トヨタファイナンス株式会社無担保社 債	400,000,000	399,808,000	
	野村ホールディングス株式会社第1回無担保社 債	100,000,000	99,719,000	
	第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	126,208,000	



第 3 8 回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,476,000	
第 1 1 0 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,720,000	
第 4 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,336,000	
第 4 2 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,898,000	
第 5 6 回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,642,000	
第 2 7 回 K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	99,490,000	
第 5 0 7 回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,287,000	
第 4 7 1 回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,451,000	
第 4 7 2 回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,869,000	
第 5 0 8 回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,694,000	
第 5 2 2 回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,952,000	
第 2 5 3 回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,555,000	
第 3 7 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,082,000	
第 3 8 回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,368,000	
第 4 回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	102,186,000	
第 7 回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,904,000	
社債券合計	5,400,000,000	5,555,408,000	
合計		131,589,228,836	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	( 単位 : 円 )	
	( 2019年 9月10日現在 )	( 2020年 9月10日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	488,309,026	28,244,153
コール・ローン	384,984,892	166,884,994
国債証券	26,593,716,170	22,544,039,146
派生商品評価勘定	-	146,340,301
未収入金	440,682	995,732

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
未収利息	152,160,666	133,939,108
前払費用	14,339,472	9,879,119
流動資産合計	27,633,950,908	23,030,322,553
資産合計	27,633,950,908	23,030,322,553
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	445,236,880	48,792,353
未払金	348,574,752	512,912
未払解約金	142,910,000	22,000,000
未払利息	798	487
その他未払費用	21,261	4,364
流動負債合計	936,743,691	71,310,116
負債合計	936,743,691	71,310,116
純資産の部		
元本等		
元本	17,979,833,935	14,934,455,373
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	8,717,373,282	8,024,557,064
元本等合計	26,697,207,217	22,959,012,437
純資産合計	26,697,207,217	22,959,012,437
負債純資産合計	27,633,950,908	23,030,322,553

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,979,833,935口	14,934,455,373口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4848円 (10,000口当たりの純資産額 14,848円)	1口当たり純資産額 1.5373円 (10,000口当たりの純資産額 15,373円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(2020年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	22,692,931,748	-	22,595,383,800	97,547,948
	米ドル	9,866,560,212	-	9,911,097,600	44,537,388
	カナダドル	439,984,922	-	437,231,400	2,753,522
	メキシコペソ	172,350,035	-	176,605,000	4,254,965
	ユーロ	9,431,597,533	-	9,342,535,800	89,061,733
	英ポンド	1,506,705,928	-	1,467,468,800	39,237,128
	スウェーデンク ローナ	73,333,936	-	72,597,200	736,736

ノルウェークローネ	51,047,808	-	49,476,000	1,571,808
デンマーククローネ	123,330,982	-	122,235,000	1,095,982
ポーランドズロチ	154,996,078	-	151,823,600	3,172,478
オーストラリアドル	562,178,910	-	554,780,400	7,398,510
シンガポールドル	218,720,003	-	218,224,600	495,403
イスラエルシケル	92,125,401	-	91,308,400	817,001
合計	22,692,931,748	-	22,595,383,800	97,547,948

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日

至 2020年 9月10日

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

## (その他の注記)

(2019年 9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	33,423,877,582円
同期中における追加設定元本額	8,321,263,196円

同期中における一部解約元本額	23,765,306,843円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,870,186,685円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,984,949,690円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	867,795,402円
イオン・バランス戦略ファンド	638,596,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,542,125円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,912,620円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,979,459円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,962,368円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,749,100円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,490,431円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,255,064,175円
S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,964,126円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	304,109,668円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,017,845,382円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	76,378,386円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	370,161,329円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	516,146,904円
合計	17,979,833,935円

(2020年 9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,979,833,935円
同期中における追加設定元本額	9,281,056,738円
同期中における一部解約元本額	12,326,435,300円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,239,062,689円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	643,981,489円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,020,472円
イオン・バランス戦略ファンド	485,835,396円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	746,127,691円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	251,850,646円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	405,713,683円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	89,843,936円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	17,236,408円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	16,988,243円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,047,561,449円
S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,370,846円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,072,854,395円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	114,308,290円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	342,582,870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>	445,116,870円
合計	14,934,455,373円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.125	900,000.00	899,085.94	
		US TREASURY N/B 0.25	100,000.00	99,906.25	
		US TREASURY N/B 0.375	900,000.00	904,640.62	
		US TREASURY N/B 0.5	700,000.00	702,078.12	
		US TREASURY N/B 0.5	330,000.00	330,773.43	
		US TREASURY N/B 0.5	460,000.00	460,826.56	
		US TREASURY N/B 0.625	300,000.00	303,468.75	
		US TREASURY N/B 0.625	820,000.00	815,451.55	
		US TREASURY N/B 0.625	420,000.00	416,784.37	
		US TREASURY N/B 1.125	250,000.00	252,519.53	
		US TREASURY N/B 1.125	190,000.00	186,571.09	
		US TREASURY N/B 1.25	200,000.00	202,468.75	
		US TREASURY N/B 1.25	350,000.00	364,136.72	
		US TREASURY N/B 1.25	260,000.00	246,654.68	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,025,468.75	
		US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	981,988.28	
		US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	207,093.75	
		US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	310,898.43	
		US TREASURY N/B 1.375	240,000.00	254,006.25	
		US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	293,835.93	
		US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	557,777.34	
		US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	611,109.37	
		US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	615,515.62	
		US TREASURY N/B 1.5	1,200,000.00	1,240,781.25	
		US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	473,800.78	
		US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	585,921.87	
		US TREASURY N/B 1.5	230,000.00	245,542.96	
		US TREASURY N/B 1.5	590,000.00	635,402.34	
US TREASURY N/B 1.625	250,000.00	257,089.84			



US TREASURY N/B 1.625	1,300,000.00	1,341,437.50
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	826,625.00
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,038,203.13
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,039,453.13
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	836,000.00
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	641,390.62
US TREASURY N/B 1.625	650,000.00	696,160.15
US TREASURY N/B 1.625	700,000.00	751,460.94
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	537,265.62
US TREASURY N/B 1.625	680,000.00	739,075.00
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	204,640.62
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	615,984.37
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	308,320.31
US TREASURY N/B 1.75	350,000.00	361,484.37
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,037,734.38
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	729,476.56
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	329,742.18
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	612,609.37
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	716,625.00
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	512,578.12
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	308,015.62
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,027,812.50
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,033,750.00
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	319,593.75
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	651,937.50
US TREASURY N/B 2	250,000.00	255,195.31
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,021,796.88
US TREASURY N/B 2	700,000.00	716,734.37
US TREASURY N/B 2	600,000.00	615,796.87
US TREASURY N/B 2	700,000.00	724,281.25
US TREASURY N/B 2	600,000.00	623,625.00
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,044,218.75
US TREASURY N/B 2	200,000.00	212,890.62
US TREASURY N/B 2	500,000.00	533,085.94
US TREASURY N/B 2	600,000.00	640,218.75
US TREASURY N/B 2	600,000.00	649,921.87
US TREASURY N/B 2	300,000.00	329,179.68
US TREASURY N/B 2	600,000.00	679,078.12
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	408,250.00
US TREASURY N/B 2.125	750,000.00	769,101.56
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	828,250.00
US TREASURY N/B 2.125	430,000.00	449,417.18

US TREASURY N/B 2.125	1,100,000.00	1,173,304.69
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	854,500.00
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	751,242.19
US TREASURY N/B 2.125	750,000.00	807,304.68
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	539,414.06
US TREASURY N/B 2.125	320,000.00	352,050.00
US TREASURY N/B 2.25	550,000.00	587,125.00
US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	491,876.56
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	866,437.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	975,164.06
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	542,851.56
US TREASURY N/B 2.25	720,000.00	791,437.50
US TREASURY N/B 2.25	450,000.00	501,644.53
US TREASURY N/B 2.25	570,000.00	639,157.03
US TREASURY N/B 2.25	700,000.00	786,789.06
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	353,953.12
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	713,765.62
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	413,375.00
US TREASURY N/B 2.375	600,000.00	650,250.00
US TREASURY N/B 2.375	750,000.00	845,156.25
US TREASURY N/B 2.375	800,000.00	919,187.50
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	610,703.12
US TREASURY N/B 2.5	250,000.00	257,871.09
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	320,273.43
US TREASURY N/B 2.5	830,000.00	899,253.12
US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	768,687.50
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	1,005,539.06
US TREASURY N/B 2.5	190,000.00	233,625.78
US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	616,484.37
US TREASURY N/B 2.5	200,000.00	246,796.87
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	412,375.00
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	553,476.56
US TREASURY N/B 2.625	430,000.00	482,809.37
US TREASURY N/B 2.625	350,000.00	408,324.22
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	966,515.62
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	972,914.06
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	555,429.69
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	670,875.00
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	672,656.25
US TREASURY N/B 2.75	730,000.00	848,853.12
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	511,250.00
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	388,945.31
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	389,507.81

US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	722,421.87
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	977,484.37
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,120,234.38
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	673,218.75
US TREASURY N/B 2.875	640,000.00	752,500.00
US TREASURY N/B 2.875	440,000.00	519,096.87
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	260,640.62
US TREASURY N/B 2.875	110,000.00	144,392.18
US TREASURY N/B 2.875	540,000.00	713,137.50
US TREASURY N/B 2.875	420,000.00	562,406.25
US TREASURY N/B 3	620,000.00	703,990.62
US TREASURY N/B 3	400,000.00	530,906.25
US TREASURY N/B 3	400,000.00	533,718.75
US TREASURY N/B 3	610,000.00	816,017.97
US TREASURY N/B 3	300,000.00	402,492.18
US TREASURY N/B 3	250,000.00	337,910.15
US TREASURY N/B 3	430,000.00	581,978.12
US TREASURY N/B 3	400,000.00	543,437.50
US TREASURY N/B 3	480,000.00	654,225.00
US TREASURY N/B 3	550,000.00	751,867.18
US TREASURY N/B 3.125	750,000.00	902,695.31
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	404,625.00
US TREASURY N/B 3.125	150,000.00	202,875.00
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	541,062.50
US TREASURY N/B 3.125	500,000.00	679,648.44
US TREASURY N/B 3.125	600,000.00	833,859.37
US TREASURY N/B 3.375	450,000.00	634,148.43
US TREASURY N/B 3.375	640,000.00	931,100.00
US TREASURY N/B 3.5	100,000.00	140,125.00
US TREASURY N/B 3.625	200,000.00	291,125.00
US TREASURY N/B 3.625	140,000.00	204,301.56
US TREASURY N/B 3.75	350,000.00	519,066.40
US TREASURY N/B 3.875	120,000.00	177,112.50
US TREASURY N/B 4.25	170,000.00	260,179.68
US TREASURY N/B 4.25	140,000.00	216,945.31
US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	307,296.87
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	467,695.31
US TREASURY N/B 4.375	360,000.00	568,603.12
US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	151,218.75
US TREASURY N/B 4.625	100,000.00	160,687.50
US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	275,312.50
US TREASURY N/B 5.25	260,000.00	360,303.12

	US TREASURY N/B 5.375	80,000.00	117,918.75
	US TREASURY N/B 5.5	120,000.00	166,434.37
	US TREASURY N/B 8	1,500,000.00	1,637,343.75
	米ドル 小計	83,470,000.00	93,002,929.32 (9,878,771,152)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	400,000.00	401,604.00
	CANADA-GOV'T 0.5	250,000.00	251,512.50
	CANADA-GOV'T 0.75	110,000.00	110,480.70
	CANADA-GOV'T 1	210,000.00	218,049.30
	CANADA-GOV'T 1.5	180,000.00	183,164.40
	CANADA-GOV'T 1.5	500,000.00	517,295.00
	CANADA-GOV'T 1.5	250,000.00	266,087.50
	CANADA-GOV'T 1.75	280,000.00	290,407.60
	CANADA-GOV'T 2	200,000.00	210,192.00
	CANADA-GOV'T 2	310,000.00	345,705.80
	CANADA-GOV'T 2	40,000.00	49,420.00
	CANADA-GOV'T 2.25	350,000.00	381,815.00
	CANADA-GOV'T 2.25	190,000.00	217,836.90
	CANADA-GOV'T 2.5	250,000.00	270,520.00
	CANADA-GOV'T 2.75	350,000.00	365,295.00
	CANADA-GOV'T 2.75	300,000.00	420,885.00
	CANADA-GOV'T 2.75	50,000.00	79,157.00
	CANADA-GOV'T 3.5	200,000.00	307,926.00
	CANADA-GOV'T 4	100,000.00	156,314.00
	CANADA-GOV'T 5	70,000.00	114,914.10
CANADA-GOV'T 5.75	160,000.00	257,539.20	
	カナダドル 小計	4,750,000.00	5,416,121.00 (437,080,964)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	3,700,000.00	4,415,284.00
	MEXICAN BONOS 5.75	4,500,000.00	4,620,285.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,220,000.00	4,360,650.49
	MEXICAN BONOS 7.5	4,700,000.00	5,233,920.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,138,310.00
	MEXICAN BONOS 7.75	3,000,000.00	3,407,460.00
	MEXICAN BONOS 7.75	3,400,000.00	3,741,530.00
	MEXICAN BONOS 8	2,200,000.00	2,415,952.00
	MEXICAN BONOS 8	1,500,000.00	1,669,785.00
	MEXICAN BONOS 8.5	2,500,000.00	2,966,400.00
	MEXICAN BONOS 8.5	1,000,000.00	1,190,080.00
		メキシコペソ 小計	31,720,000.00
ユーロ	BELGIAN 0.1	150,000.00	154,458.00
	BELGIAN 0.2	80,000.00	82,122.40

BELGIAN 0.4	50,000.00	50,800.50
BELGIAN 0.8	100,000.00	106,703.00
BELGIAN 0.8	250,000.00	271,147.50
BELGIAN 0.8	360,000.00	393,084.00
BELGIAN 0291 5.5	120,000.00	174,060.00
BELGIAN 0304 5	220,000.00	378,166.80
BELGIAN 0308 4	300,000.00	321,774.00
BELGIAN 0320 4.25	200,000.00	355,750.00
BELGIAN 0321 4.25	100,000.00	105,101.00
BELGIAN 0324 4.5	80,000.00	102,634.40
BELGIAN 0328 2.25	100,000.00	108,148.00
BELGIAN 0332 2.6	100,000.00	112,330.00
BELGIAN 0333 3	120,000.00	169,417.20
BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	104,620.00
BELGIAN 0347 0.9	130,000.00	143,685.10
BELGIAN 0348 1.7	40,000.00	53,104.00
BELGIAN 1	200,000.00	217,660.00
BELGIAN 1	220,000.00	247,225.00
BELGIAN 1.25	170,000.00	198,393.40
BELGIAN 1.6	140,000.00	179,715.20
BELGIAN 1.9	50,000.00	64,675.00
BELGIAN 2.15	130,000.00	210,090.40
BELGIAN 3.75	100,000.00	178,228.00
BTPS 0.35	400,000.00	402,504.00
BTPS 0.65	300,000.00	305,196.00
BTPS 0.95	400,000.00	409,312.00
BTPS 0.95	140,000.00	139,116.60
BTPS 1.25	500,000.00	519,040.00
BTPS 1.35	350,000.00	358,228.50
BTPS 1.35	590,000.00	609,647.00
BTPS 1.45	700,000.00	721,427.00
BTPS 1.45	500,000.00	523,820.00
BTPS 1.45	100,000.00	100,076.00
BTPS 1.5	600,000.00	630,192.00
BTPS 1.6	240,000.00	254,037.60
BTPS 1.65	50,000.00	52,765.00
BTPS 1.65	400,000.00	421,216.00
BTPS 1.85	300,000.00	317,949.00
BTPS 2	220,000.00	237,146.80
BTPS 2.05	200,000.00	217,642.00
BTPS 2.15	100,000.00	102,936.00
BTPS 2.2	210,000.00	230,670.30
BTPS 2.25	250,000.00	277,715.00

BTPS 2.3	710,000.00	729,510.80
BTPS 2.45	250,000.00	284,270.00
BTPS 2.45	100,000.00	110,204.00
BTPS 2.5	350,000.00	381,601.50
BTPS 2.5	350,000.00	385,983.50
BTPS 2.7	240,000.00	278,728.80
BTPS 2.8	150,000.00	173,077.50
BTPS 2.8	140,000.00	164,575.60
BTPS 2.95	150,000.00	181,032.00
BTPS 3	200,000.00	235,404.00
BTPS 3.1	100,000.00	122,810.00
BTPS 3.25	160,000.00	203,644.80
BTPS 3.35	210,000.00	262,909.50
BTPS 3.45	200,000.00	264,010.00
BTPS 3.75	100,000.00	113,588.00
BTPS 3.85	100,000.00	141,204.00
BTPS 4	170,000.00	229,773.70
BTPS 4.5	200,000.00	223,544.00
BTPS 4.5	80,000.00	91,936.00
BTPS 4.5	200,000.00	242,432.00
BTPS 4.75	300,000.00	340,584.00
BTPS 4.75	270,000.00	351,032.40
BTPS 4.75	200,000.00	311,212.00
BTPS 5	200,000.00	215,250.00
BTPS 5	300,000.00	361,461.00
BTPS 5	400,000.00	582,044.00
BTPS 5	250,000.00	385,022.50
BTPS 5	180,000.00	278,919.00
BTPS 5.25	360,000.00	495,489.60
BTPS 5.5	350,000.00	391,324.50
BTPS 5.75	200,000.00	302,430.00
BTPS 6	250,000.00	371,705.00
BTPS 6.5	470,000.00	655,189.40
BTPS 9	170,000.00	217,372.20
BUNDESÖBL-120 0	330,000.00	340,692.00
BUNDESÖBL-174 0	200,000.00	201,452.00
BUNDESÖBL-175 0	200,000.00	202,198.00
BUNDESSCHATZANW 0	180,000.00	181,819.80
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	312,312.00
DEUTSCHLAND REP 0	250,000.00	262,190.00
DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	157,201.50
DEUTSCHLAND REP 0	100,000.00	104,720.00

DEUTSCHLAND REP 0	70,000.00	72,679.60
DEUTSCHLAND REP 0	70,000.00	70,264.60
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	423,960.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	427,284.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	450,000.00	481,711.50
DEUTSCHLAND REP 0.5	450,000.00	474,669.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	520,000.00	554,361.60
DEUTSCHLAND REP 0.5	350,000.00	378,255.50
DEUTSCHLAND REP 1	100,000.00	106,876.00
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	217,104.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	230,000.00	312,829.90
DEUTSCHLAND REP 1.5	450,000.00	469,948.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	350,000.00	369,239.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	424,156.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	649,896.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	600,000.00	626,838.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	200,000.00	217,304.00
DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	259,087.50
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	216,196.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	360,000.00	587,577.60
DEUTSCHLAND REP 2.5	320,000.00	535,100.80
DEUTSCHLAND REP 3.25	210,000.00	369,394.20
DEUTSCHLAND REP 4	330,000.00	566,250.30
DEUTSCHLAND REP 4.25	250,000.00	465,705.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	240,000.00	414,343.20
DEUTSCHLAND REP 4.75	250,000.00	501,435.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	200,000.00	326,912.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	602,425.30
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	246,940.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	290,000.00	478,697.20
DEUTSCHLAND REP 6.5	60,000.00	89,980.20
FINNISH GOV'T 0	120,000.00	122,318.40
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	107,611.00
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	107,435.00
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	116,925.00
FINNISH GOV'T 1.375	50,000.00	66,288.00
FINNISH GOV'T 1.5	100,000.00	105,593.00
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	104,608.00
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	219,238.00
FINNISH GOV'T 2.625	80,000.00	124,416.80
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	125,150.00
FRANCE O.A.T. 0	250,000.00	252,360.00
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	707,770.00

FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	304,674.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	203,244.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	204,324.00	
FRANCE O.A.T. 0	220,000.00	225,669.40	
FRANCE O.A.T. 0	480,000.00	490,848.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	330,000.00	345,048.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	440,000.00	462,391.60	
FRANCE O.A.T. 0.5	350,000.00	370,594.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	650,000.00	695,162.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	610,000.00	662,911.40	
FRANCE O.A.T. 0.75	380,000.00	414,002.40	
FRANCE O.A.T. 0.75	220,000.00	233,415.60	
FRANCE O.A.T. 1	280,000.00	302,845.20	
FRANCE O.A.T. 1	330,000.00	362,257.50	
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	350,601.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	220,000.00	258,832.20	
FRANCE O.A.T. 1.5	650,000.00	766,135.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	250,000.00	319,667.50	
FRANCE O.A.T. 1.75	310,000.00	330,174.80	
FRANCE O.A.T. 1.75	630,000.00	692,886.60	
FRANCE O.A.T. 1.75	350,000.00	450,135.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	150,000.00	217,944.00	
FRANCE O.A.T. 2	300,000.00	421,692.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	320,000.00	339,836.80	
FRANCE O.A.T. 2.25	430,000.00	476,100.30	
FRANCE O.A.T. 2.5	550,000.00	697,224.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	430,000.00	528,934.40	
FRANCE O.A.T. 3	250,000.00	264,870.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	450,000.00	469,732.50	
FRANCE O.A.T. 3.25	300,000.00	502,971.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	850,000.00	1,045,491.50	
FRANCE O.A.T. 4	250,000.00	421,742.50	
FRANCE O.A.T. 4	170,000.00	355,427.50	
FRANCE O.A.T. 4	110,000.00	242,216.70	
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	692,526.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	400,000.00	741,340.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	360,000.00	609,170.40	
FRANCE O.A.T. 5.5	200,000.00	301,822.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	400,000.00	686,416.00	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	537,064.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	248,556.00	
IRISH GOVT 0.8	100,000.00	102,098.00	



IRISH GOVT 0.9	220,000.00	240,116.80
IRISH GOVT 1.1	130,000.00	144,862.90
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	124,404.00
IRISH GOVT 2	200,000.00	275,376.00
IRISH GOVT 2.4	100,000.00	124,828.00
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	228,216.00
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	222,964.00
IRISH GOVT 5.4	50,000.00	63,464.00
NETHERLANDS GOVT 0	50,000.00	50,422.00
NETHERLANDS GOVT 0	170,000.00	173,649.90
NETHERLANDS GOVT 0	220,000.00	227,673.60
NETHERLANDS GOVT 0.25	200,000.00	208,564.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	120,000.00	127,690.80
NETHERLANDS GOVT 0.5	130,000.00	144,354.60
NETHERLANDS GOVT 0.75	250,000.00	271,927.50
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	109,743.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	200,000.00	213,854.00
NETHERLANDS GOVT 2	60,000.00	66,205.20
NETHERLANDS GOVT 2.25	100,000.00	105,398.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	100,000.00	134,736.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	180,000.00	310,577.40
NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	220,930.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	170,000.00	309,508.80
NETHERLANDS GOVT 4	200,000.00	337,592.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	150,000.00	217,224.00
REP OF AUSTRIA 0.5	150,000.00	159,849.00
REP OF AUSTRIA 0.5	150,000.00	161,253.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	215,934.00
REP OF AUSTRIA 0.75	230,000.00	250,769.00
REP OF AUSTRIA 0.75	50,000.00	56,934.50
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	218,740.00
REP OF AUSTRIA 1.5	70,000.00	93,106.30
REP OF AUSTRIA 1.75	80,000.00	86,032.80
REP OF AUSTRIA 2.4	100,000.00	134,451.00
REP OF AUSTRIA 3.15	100,000.00	170,502.00
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	218,052.00
REP OF AUSTRIA 3.5	400,000.00	416,800.00
REP OF AUSTRIA 3.8	140,000.00	326,081.00
REP OF AUSTRIA 4.15	200,000.00	337,852.00
REP OF AUSTRIA 4.85	200,000.00	261,176.00
SPANISH GOV'T 0.25	200,000.00	204,568.00
SPANISH GOV'T 0.35	400,000.00	408,624.00
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	304,266.00

	SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	509,740.00
	SPANISH GOV'T 0.5	230,000.00	235,025.50
	SPANISH GOV'T 0.6	300,000.00	310,227.00
	SPANISH GOV'T 0.8	200,000.00	210,858.00
	SPANISH GOV'T 1	60,000.00	57,814.80
	SPANISH GOV'T 1.2	60,000.00	63,274.80
	SPANISH GOV'T 1.25	220,000.00	239,998.00
	SPANISH GOV'T 1.3	600,000.00	651,834.00
	SPANISH GOV'T 1.4	350,000.00	385,812.00
	SPANISH GOV'T 1.45	200,000.00	220,180.00
	SPANISH GOV'T 1.45	280,000.00	310,349.20
	SPANISH GOV'T 1.5	200,000.00	220,620.00
	SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	325,869.00
	SPANISH GOV'T 1.85	150,000.00	175,491.00
	SPANISH GOV'T 1.95	220,000.00	246,144.80
	SPANISH GOV'T 1.95	200,000.00	232,340.00
	SPANISH GOV'T 2.15	50,000.00	56,082.50
	SPANISH GOV'T 2.35	50,000.00	61,384.50
	SPANISH GOV'T 2.7	210,000.00	291,328.80
	SPANISH GOV'T 2.75	400,000.00	450,996.00
	SPANISH GOV'T 2.9	210,000.00	298,840.50
	SPANISH GOV'T 3.45	130,000.00	221,371.80
	SPANISH GOV'T 3.8	350,000.00	403,105.50
	SPANISH GOV'T 4.2	280,000.00	433,053.60
	SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	345,372.00
	SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	309,867.50
	SPANISH GOV'T 4.7	250,000.00	432,615.00
	SPANISH GOV'T 4.8	100,000.00	117,611.00
	SPANISH GOV'T 4.9	200,000.00	349,850.00
	SPANISH GOV'T 5.15	300,000.00	421,824.00
	SPANISH GOV'T 5.15	160,000.00	303,129.60
	SPANISH GOV'T 5.75	300,000.00	485,466.00
	SPANISH GOV'T 5.85	350,000.00	380,863.00
	SPANISH GOV'T 6	180,000.00	267,759.00
	ユーロ 小計	61,570,000.00	74,307,092.30 (9,318,109,374)
英bond	UK TSY GILT 0.125	140,000.00	140,604.80
	UK TSY GILT 0.5	470,000.00	475,010.20
	UK TSY GILT 0.625	170,000.00	175,550.50
	UK TSY GILT 0.75	310,000.00	317,641.50
	UK TSY GILT 0.875	160,000.00	169,852.80
	UK TSY GILT 1	250,000.00	260,042.50

	UK TSY GILT 1.25	200,000.00	216,578.00
	UK TSY GILT 1.25	70,000.00	76,700.40
	UK TSY GILT 1.5	170,000.00	185,345.90
	UK TSY GILT 1.5	200,000.00	234,100.00
	UK TSY GILT 1.625	80,000.00	114,455.20
	UK TSY GILT 1.625	220,000.00	246,941.20
	UK TSY GILT 1.625	40,000.00	50,110.00
	UK TSY GILT 1.75	280,000.00	290,259.20
	UK TSY GILT 1.75	280,000.00	329,585.20
	UK TSY GILT 1.75	90,000.00	111,870.00
	UK TSY GILT 1.75	220,000.00	290,774.00
	UK TSY GILT 2	150,000.00	165,675.00
	UK TSY GILT 2.25	250,000.00	267,567.50
	UK TSY GILT 2.5	190,000.00	319,146.80
	UK TSY GILT 2.75	300,000.00	334,212.00
	UK TSY GILT 3.25	210,000.00	320,869.50
	UK TSY GILT 3.5	250,000.00	400,412.50
	UK TSY GILT 3.5	200,000.00	426,506.00
	UK TSY GILT 3.75	90,000.00	93,393.90
	UK TSY GILT 3.75	220,000.00	405,105.80
	UK TSY GILT 4	100,000.00	106,064.00
	UK TSY GILT 4	140,000.00	296,422.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	260,632.00
	UK TSY GILT 4.25	250,000.00	361,732.50
	UK TSY GILT 4.25	180,000.00	278,658.00
	UK TSY GILT 4.25	150,000.00	245,676.00
	UK TSY GILT 4.25	190,000.00	316,659.70
	UK TSY GILT 4.25	230,000.00	418,468.90
	UK TSY GILT 4.25	170,000.00	323,686.80
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	415,598.00
	UK TSY GILT 4.5	150,000.00	231,688.50
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	354,062.00
	UK TSY GILT 4.75	200,000.00	291,298.00
	UK TSY GILT 4.75	140,000.00	239,316.00
	UK TSY GILT 5	80,000.00	98,319.20
	UK TSY GILT 6	60,000.00	88,629.00
	英bond 小計	7,850,000.00	10,745,221.00 (1,482,518,141)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.125	350,000.00	353,202.50
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	200,000.00	213,944.00
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	350,000.00	376,442.50
	SWEDISH GOVRNMNT 1	820,000.00	882,902.20
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	900,000.00	953,091.00

	SWEDISH GOVRMNT 2.5	850,000.00	962,693.00	
	SWEDISH GOVRMNT 3.5	1,200,000.00	1,279,968.00	
	SWEDISH GOVRMNT 3.5	600,000.00	937,518.00	
スウェーデンクローナ 小計		5,270,000.00	5,959,761.20	(72,351,500)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	330,000.00	351,681.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	800,000.00	847,120.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	250,000.00	265,725.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	900,000.00	972,630.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	100,000.00	109,810.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	300,000.00	314,400.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	400,000.00	443,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	800,000.00	876,480.00	
ノルウェークローネ 小計		3,880,000.00	4,181,046.00	(49,294,532)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	1,350,000.00	1,440,720.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	870,000.00	937,425.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	150,000.00	159,885.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	400,000.00	447,720.00	
	DENMARK - BULLET 3	1,100,000.00	1,145,320.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	1,320,000.00	2,477,772.00	
	DENMARK - BULLET 7	420,000.00	554,232.00	
デンマーククローネ 小計		5,610,000.00	7,163,074.00	(120,769,427)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	700,000.00	699,097.91	
	POLAND GOVT BOND 2.25	700,000.00	750,400.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	280,000.00	305,323.20	
	POLAND GOVT BOND 2.5	800,000.00	874,056.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	350,000.00	388,822.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	220,000.00	246,873.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	350,000.00	392,808.50	
	POLAND GOVT BOND 4	650,000.00	725,426.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	500,000.00	532,205.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	280,000.00	385,781.20	
ポーランドズロチ 小計		4,830,000.00	5,300,792.81	(149,641,381)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	180,000.00	179,325.18	
	AUSTRALIAN GOVT. 1	260,000.00	261,524.64	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.25	270,000.00	276,830.46	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	170,000.00	178,840.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	140,000.00	137,696.86	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	190,000.00	194,180.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	310,000.00	323,454.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	350,000.00	388,570.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	340,000.00	389,844.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	420,000.00	457,442.16
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	350,000.00	399,875.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	320,000.00	369,968.32
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	291,025.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	150,000.00	179,715.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	30,000.00	35,751.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	120,000.00	152,315.88
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	400,000.00	452,120.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	450,000.00	539,595.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	254,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	80,000.00	108,473.60
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	500,000.00	603,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	400,000.00	507,280.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	330,000.00	374,913.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	100,000.00	110,049.00
	オーストラリアドル 小計	6,310,000.00	7,166,858.10 (553,138,108)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	250,000.00	252,750.00
	SINGAPORE GOV'T 1.875	70,000.00	81,041.10
	SINGAPORE GOV'T 2.125	250,000.00	272,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.625	310,000.00	352,160.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	380,000.00	405,878.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	126,250.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	260,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	170,000.00	198,730.00
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	330,780.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	200,000.00	211,560.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	319,500.00
	シンガポールドル 小計	2,480,000.00	2,811,049.10 (218,418,515)
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.75	750,000.00	758,925.00
	ISRAEL FIXED 1.5	430,000.00	447,569.80
	ISRAEL FIXED 2.25	450,000.00	508,621.50
	ISRAEL FIXED 3.75	400,000.00	581,116.00
	ISRAEL FIXED 6.25	420,000.00	567,667.80
	イスラエルシュケル 小計	2,450,000.00	2,863,900.10 (89,554,156)
	合計		22,544,039,146 (22,544,039,146)

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 159銘柄	43.0%	43.8%
カナダドル	国債証券 21銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 11銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 249銘柄	40.6%	41.3%
英ポンド	国債証券 42銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	2.4%	2.5%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	1.0%	1.0%
イスラエルシェケル	国債証券 5銘柄	0.4%	0.4%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	359,861,426	358,456,809
コール・ローン	304,105,412	585,525,253
国債証券	152,381,911,523	164,257,613,313
未収利息	971,694,786	924,002,069
前払費用	27,360,488	30,790,787
流動資産合計	154,044,933,635	166,156,388,231
資産合計	154,044,933,635	166,156,388,231
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	337,070	-
未払金	-	46,356,918
未払解約金	176,807,023	206,852,998
未払利息	630	1,712
その他未払費用	24,932	14,488
流動負債合計	177,169,655	253,226,116
負債合計	177,169,655	253,226,116
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	85,552,532,956	86,651,796,345
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	68,315,231,024	79,251,365,770
元本等合計	153,867,763,980	165,903,162,115

(2019年 9月10日現在)

(2020年 9月10日現在)

純資産合計	153,867,763,980	165,903,162,115
負債純資産合計	154,044,933,635	166,156,388,231

## 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	85,552,532,956口	86,651,796,345口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7985円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,985円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.9146円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 19,146円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
----	--------------------------------

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



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

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

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(2020年 9月10日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2019年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	100,766,478,176円
同期中における追加設定元本額	8,406,111,355円
同期中における一部解約元本額	23,620,056,575円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	11,781,084,481円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	624,034,740円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,658,861,937円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	816,230,829円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,916,951円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,477,790円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	87,658,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	121,608,738円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	64,354,968円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	139,595,794円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	18,345,535円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	168,536,737円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	184,947,939円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	178,697,308円
イオン・バランス戦略ファンド	26,882,224円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,831,207円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	37,548,866円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,023,792円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	71,922,383円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	30,131,496円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,168,572円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	32,391,000円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,364円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,738,760,543円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,992,477,306円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,580,003,468円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,498,783,912円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,984,328円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	550,315円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	719,074,489円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,249,804,938円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,538,130,778円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,918,853,792円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,343,994,831円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,624,200円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,716,683,112円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	391,323,984円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	432,873,574円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	177,116,717円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	168,408,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	141,761,439円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,602,622円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,631,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	140,663,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	538,237,993円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	89,596,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,962,548円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,587,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,611,476円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,325,471,719円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	2,970,600,439円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,466,158,024円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,936,761,816円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	668,036,293円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	8,879,303円
SMAM・年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	36,780,079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>	195,516,151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>	272,287,686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>	506,071,933円

合計	85,552,532,956円
----	-----------------

(2020年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	85,552,532,956円
同期中における追加設定元本額	21,945,133,013円
同期中における一部解約元本額	20,845,869,624円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	22,708,464,861円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	657,808,704円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,765,641,515円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	885,355,779円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	135,214,150円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,442,392円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,932,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	88,963,745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)	147,123,191円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	86,958,263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)	169,760,535円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,589,170円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	152,976,060円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	177,017,525円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	125,667,599円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	8,400,078円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,233,958円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	28,737,397円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	68,259,528円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	21,374,275円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,787,073円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	56,728,071円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	59,355,709円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	3,401,354円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	11,013,159円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	5,661,161円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	1,437,654円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,325,407,859円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	62,516,303円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	8,969,125,020円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	4,882,034,678円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	11,081,288,238円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	34,927,566円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	92,654,350円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	364,139円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	667,821,535円

S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	117,038,834円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,130,698,774円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,406,378,119円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	1,693,637,685円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	5,375,225,533円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,096,475円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	8,991,550,157円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	372,710,683円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	156,656,035円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	94,741,730円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	35,622,173円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	12,330,649円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	114,449,543円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	457,949,726円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	131,485,417円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	41,665,026円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,430,860円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,136,440,664円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	5,339,525円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,434,006,438円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,193,432,057円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	5,014,430,246円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	523,340,928円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	62,703,933円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	53,516,287円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	188,026,035円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	243,881,171円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,054,566,362円
合計	86,651,796,345円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,294,289.08	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,011,328.15	
		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,716,843.75	

US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,396,625.00	
US TREASURY N/B 0.375	1,500,000.00	1,505,039.07	
US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	3,015,468.75	
US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,516,289.07	
US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	3,008,906.25	
US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,517,343.75	
US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	7,458,398.47	
US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,725,101.57	
US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,121,164.07	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	4,057,187.52	
US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,558,359.37	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	3,131,718.75	
US TREASURY N/B 1.25	4,500,000.00	4,555,546.87	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,092,578.14	
US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	4,838,226.58	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,101,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,088,359.39	
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	516,835.94	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,588,671.87	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,108,984.39	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,048,828.13	
US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,751,734.38	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,055,546.89	
US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,594,882.83	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,099,375.00	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,101,953.14	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,105,781.26	
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,597,968.75	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,067,578.13	
US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,846,289.08	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,056,718.76	
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,498,281.25	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,611,562.50	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,133,125.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,114,609.39	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,118,359.39	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,135,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,565,562.51	
US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,479,644.56	
US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,186,710.95	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,223,593.75	
US TREASURY N/B 1.625	5,450,000.00	5,923,468.75	

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,057,890.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,069,609.39
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,844,296.88
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,462,062.51
US TREASURY N/B 1.75	1,600,000.00	1,642,625.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,083,203.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,086,953.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,098,437.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,113,203.14
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,813,695.32
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,483,109.43
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	900,335.93
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,598,187.51
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,396,562.52
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,457,000.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,053,437.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,083,437.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,088,359.39
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,754,984.37
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,962,000.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,109,921.89
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,917,562.50
US TREASURY N/B 1.875	3,500,000.00	3,802,968.75
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,479,500.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,053,906.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,062,343.75
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,393,726.58
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,583,671.87
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,181,617.20
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,104,062.50
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,637,812.50
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,203,906.25
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,968,031.25
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,128,906.26
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,518,367.20
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,667,578.12
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,767,421.87
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,657,773.45
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,486,328.15
US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	3,169,031.26
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,061,875.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,076,406.25
US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,582,226.57

US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,105,937.50	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,180,625.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,292,296.87	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,133,281.26	
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,942,812.50	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,756,210.95	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,305,625.00	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,941,890.63	
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,319,945.33	
US TREASURY N/B 2.125	3,900,000.00	4,290,609.37	
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,443,445.33	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,202,500.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,352,453.13	
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,079,062.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,624,570.32	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,826,148.46	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,365,679.70	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,396,875.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,700,000.00	2,984,343.75	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,904,968.77	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,709,578.14	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,945,531.27	
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	3,362,554.68	
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	4,163,632.83	
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,720,375.00	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,263,281.25	
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,977,210.95	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	6,069,000.00	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,521,687.50	
US TREASURY N/B 2.375	5,200,000.00	5,974,718.77	
US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	2,320,671.87	
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,959,820.32	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,616,757.83	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,337,890.65	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,175,593.75	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,733,625.00	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,564,171.88	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,041,398.45	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,575,609.37	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,059,335.95	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,092,812.50	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,242,812.52	



US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,545,992.19
US TREASURY N/B 2.625	4,800,000.00	5,380,875.02
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	7,349,835.96
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,095,937.52
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,436,640.63
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,096,882.82
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,070,000.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,147,812.50
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,088,859.39
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,540,265.64
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,546,648.46
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,221,718.76
US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	5,143,375.00
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,354,296.87
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,581,500.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,558,906.26
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	383,437.50
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,926,640.64
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,947,539.07
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,128,125.00
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,083,750.00
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,172,187.50
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,464,515.63
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,234,234.37
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,831,054.70
US TREASURY N/B 2.875	5,000,000.00	5,878,906.25
US TREASURY N/B 2.875	5,500,000.00	6,488,710.96
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,909,609.39
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	5,250,625.00
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,754,250.00
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,874,687.50
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,541,875.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,525,039.07
US TREASURY N/B 3	800,000.00	1,061,812.50
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,670,039.08
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	4,013,203.14
US TREASURY N/B 3	3,700,000.00	4,964,070.33
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,379,101.57
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,977,562.50
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	4,211,640.62
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	7,360,031.25
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	5,194,718.75
US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	5,055,093.75

	US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,483,625.00
	US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,352,500.00
	US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	3,111,109.37
	US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	5,165,328.14
	US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	3,335,437.51
	US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	4,227,656.25
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,510,015.62
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,121,000.00
	US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,493,500.00
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	5,253,468.76
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	2,197,968.75
	US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	1,038,132.81
	US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	737,968.75
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,530,468.75
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	929,765.62
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	768,242.19
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	1,091,289.06
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	2,191,765.63
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	473,835.93
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,134,140.62
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	311,937.50
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,577,578.13
	US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	964,125.00
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,469,375.00
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	809,882.81
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	688,281.25
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	471,675.00
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	693,476.56
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,304,687.50
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,401,093.75
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	942,375.00
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,419,031.25
	米ドル 小計	608,370,000.00	677,426,148.88 (71,956,205,534)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,008,020.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,008,740.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,044,280.00
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,349,829.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,800,000.00	1,911,240.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,069,180.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,046,740.00
	CANADA-GOV'T 1.5	3,100,000.00	3,299,485.00

	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,140,887.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	1,003,662.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,067,490.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,527,260.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,261,161.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,272,368.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,878,660.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,543,245.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	791,570.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,022,080.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,309,445.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,344,710.00
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,380,363.50
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	360,582.50
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	804,810.00
	CANADA-GOV'T 8	700,000.00	1,050,035.00
	カナダドル 小計	34,100,000.00	39,495,843.00 (3,187,314,530)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	38,186,240.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	20,534,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	52,000,000.00	53,733,134.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	27,840,000.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,829,860.00
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	20,444,760.00
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	29,650,320.00
	MEXICAN BONOS 8.5	16,000,000.00	18,984,960.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	47,603,200.00
	メキシコペソ 小計	236,000,000.00	263,807,074.00 (1,308,483,087)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,034,726.00
	BELGIAN 0.1	2,000,000.00	2,059,440.00
	BELGIAN 0.8	800,000.00	853,624.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,084,590.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	545,950.00
	BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,595,550.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,750,304.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	750,806.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,134,500.00
	BELGIAN 0321 4.25	2,300,000.00	2,417,323.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,282,930.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,872,482.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,622,220.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,583,590.00

BELGIAN 0333 3	700,000.00	988,267.00
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,046,200.00
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	778,360.00
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	484,088.00
BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,436,851.00
BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	663,800.00
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,523,620.00
BELGIAN 1	1,000,000.00	1,123,750.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	466,808.00
BELGIAN 1.6	850,000.00	1,091,128.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,293,500.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	808,040.00
BELGIAN 3.75	800,000.00	1,425,824.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,509,390.00
BTPS 0.35	3,500,000.00	3,499,895.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,034,640.00
BTPS 0.85	1,700,000.00	1,719,550.00
BTPS 0.9	2,250,000.00	2,292,795.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,046,240.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,046,560.00
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,788,642.00
BTPS 1	1,000,000.00	1,020,400.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,020,700.00
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,660,928.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,047,020.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,061,220.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,885,752.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,047,690.00
BTPS 1.45	600,000.00	600,456.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,835,864.00
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,270,188.00
BTPS 1.65	2,400,000.00	2,527,296.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,059,830.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,066,310.00
BTPS 2	1,300,000.00	1,401,322.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,739,104.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,632,315.00
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,085,650.00
BTPS 2.15	500,000.00	514,680.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,098,430.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,333,032.00
BTPS 2.3	600,000.00	616,488.00
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,250,788.00

BTPS 2.45	400,000.00	440,816.00	
BTPS 2.5	600,000.00	654,174.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,315,901.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,800,123.50	
BTPS 2.8	300,000.00	346,155.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,057,986.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,568,944.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,119,570.00	
BTPS 3.1	700,000.00	859,670.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,909,170.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,064,157.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,848,070.00	
BTPS 3.5	4,900,000.00	6,015,142.00	
BTPS 3.75	2,200,000.00	2,277,726.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,271,760.00	
BTPS 3.85	900,000.00	1,270,836.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,514,186.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,570,756.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,447,600.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,181,888.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,725,840.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,838,200.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,250,300.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,489,696.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,152,500.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,204,870.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,012,077.70	
BTPS 5	1,800,000.00	2,772,162.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,634,235.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,332,420.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,236,140.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,570,655.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,271,004.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,369,834.00	
BTPS 7.25	400,000.00	559,172.00	
BTPS 9	300,000.00	383,598.00	
BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,613,400.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,021,780.00	
BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,029,640.00	
BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,936,271.00	
BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,334,073.00	
BUNDESSCHATZANW 0	3,400,000.00	3,434,374.00	

DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,498,496.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,670,660.00
DEUTSCHLAND REP 0	2,300,000.00	2,308,694.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	4,027,620.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,097,809.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,033,893.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,637,050.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,900,000.00	2,025,552.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,674,482.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	4,100,000.00	4,447,106.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,389,388.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,225,316.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,244,214.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,215,437.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,378,507.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,166,320.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,298,406.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	3,000,000.00	3,259,560.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,161,960.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,440,292.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,590,752.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,600,000.00	4,347,694.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,110,824.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,088,638.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,769,679.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,287,616.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,700,000.00	4,661,361.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,309,471.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,471,104.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,469,330.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,481,640.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	825,340.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,499,670.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	404,064.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	429,452.00
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	860,888.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	554,090.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	233,850.00
FINNISH GOV'T 1.375	300,000.00	397,728.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,055,930.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,046,080.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,096,190.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	777,605.00

FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	750,900.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,226,310.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,018,880.00
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,224,420.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,032,440.00
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,086,480.00
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,230,924.00
FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,601,700.00
FRANCE O.A.T. 0.25	4,900,000.00	5,123,440.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,047,581.00
FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000.00	4,764,780.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,994,544.00
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,716,850.00
FRANCE O.A.T. 0.75	3,200,000.00	3,486,336.00
FRANCE O.A.T. 0.75	500,000.00	530,490.00
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,217,259.50
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,744,375.00
FRANCE O.A.T. 1.25	3,300,000.00	3,856,611.00
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,823,624.00
FRANCE O.A.T. 1.5	4,350,000.00	5,127,214.50
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	3,068,808.00
FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,473,336.00
FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,859,532.00
FRANCE O.A.T. 1.75	2,400,000.00	3,086,640.00
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,162,368.00
FRANCE O.A.T. 2	2,200,000.00	3,092,408.00
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,017,781.00
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,764,514.00
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,436,880.00
FRANCE O.A.T. 2.75	2,550,000.00	3,136,704.00
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,297,400.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,609,625.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,688,454.00
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,074,975.00
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,373,940.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,864,327.50
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	3,082,758.00
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,462,630.00
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,374,715.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,722,708.00
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,150,052.50
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,603,684.00

FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,027,980.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	745,668.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	404,980.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	714,686.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	764,008.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,083,100.00
IRISH GOVT 1.1	1,600,000.00	1,782,928.00
IRISH GOVT 1.35	500,000.00	575,570.00
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	507,040.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	373,212.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,376,880.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	748,968.00
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	570,540.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	557,410.00
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	1,015,424.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,815,192.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,021,470.00
NETHERLANDS GOVT 0	900,000.00	931,392.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,042,820.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,300,000.00	1,377,844.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,200,000.00	1,276,908.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	800,000.00	888,336.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	900,000.00	978,939.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,097,430.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,710,832.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,103,420.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,580,970.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,347,360.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,070,516.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	773,255.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,366,832.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,600,000.00	2,700,736.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,013,712.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,120,284.00
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	852,528.00
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	913,767.00
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	971,703.00
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	763,210.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,000,000.00	1,138,690.00
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,093,700.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	311,482.00
REP OF AUSTRIA 1.5	400,000.00	532,036.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,205,325.00



REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,075,410.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,210,059.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	1,023,012.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,199,286.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,042,000.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,069,600.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,630,405.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,196,038.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	652,940.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,468,730.00	
SPANISH GOV'T 0	500,000.00	505,560.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,000,000.00	2,045,680.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,028,440.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	509,740.00	
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,021,850.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,021,100.00	
SPANISH GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,181,800.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,933,253.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,201,680.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,763,712.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,862,340.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,214,331.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,323,720.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,389,706.00	
SPANISH GOV'T 1.85	2,400,000.00	2,807,856.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,908,984.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,974,890.00	
SPANISH GOV'T 2.15	3,200,000.00	3,589,280.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,700,000.00	2,087,073.00	
SPANISH GOV'T 2.7	1,550,000.00	2,150,284.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,367,729.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,992,270.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,873,146.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,188,287.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,551,923.00	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,302,480.00	
SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,231,046.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,595,690.00	
SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,764,165.00	
SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,623,875.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,109,120.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,273,472.00	

	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,564,640.00
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,427,330.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,393,996.00
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	677,895.00
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,272,610.00
	ユーロ 小計	450,540,000.00	541,664,992.20 (67,924,790,021)
英ポンド	UK TSY GILT 0.375	1,000,000.00	1,009,150.00
	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,819,188.00
	UK TSY GILT 0.625	2,000,000.00	2,065,300.00
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,715,322.50
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,061,580.00
	UK TSY GILT 1	1,300,000.00	1,352,221.00
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,082,890.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,090,270.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,989,850.00
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	786,879.50
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,244,920.00
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	626,375.00
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,243,968.00
	UK TSY GILT 1.75	2,800,000.00	3,295,852.00
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	932,250.00
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,214,950.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,889,729.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,687,552.00
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,448,252.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,444,720.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,642,722.50
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	3,092,168.50
	UK TSY GILT 3.75	1,500,000.00	1,556,565.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,946,224.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,590,960.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,599,410.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,433,476.00
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,302,237.00
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,625,505.00
	UK TSY GILT 4.25	2,050,000.00	3,357,572.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,166,619.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,729,145.00
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,713,636.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,532,583.00
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,699,049.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,389,918.50

	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,674,963.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	2,051,280.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,597,687.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	960,147.50	
	UK TSY GILT 8	820,000.00	868,839.20	
英ポンド 小計		57,020,000.00	78,531,926.70	(10,835,049,926)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,278,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	6,400,000.00	6,890,944.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,412,930.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,662,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,533,120.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,187,638.00	
スウェーデンクローナ 小計		35,000,000.00	39,966,412.00	(485,192,241)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,131,400.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,706,150.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,188,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,964,870.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,288,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,972,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,382,400.00	
ノルウェークローネ 小計		30,200,000.00	32,633,520.00	(384,749,200)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	11,100,000.00	11,845,920.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	2,000,000.00	2,155,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,329,500.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,715,800.00	
	DENMARK - BULLET 3	5,000,000.00	5,206,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	19,709,550.00	
デンマーククローネ 小計		39,600,000.00	50,961,770.00	(859,215,442)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.25	3,000,000.00	3,106,530.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,906,980.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,277,710.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	4,500,000.00	5,049,675.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,743,939.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	3,013,308.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,257,640.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,675,640.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,700,000.00	3,720,033.00	
ポーランドズロチ 小計		33,700,000.00	37,751,455.00	

オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	3,300,000.00	3,471,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,022,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,565,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,330,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,547,910.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,722,870.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,600,000.00	4,113,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,081,071.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	4,300,000.00	5,005,630.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	958,480.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,777,018.60
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,147,570.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,518,110.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	3,248,955.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,627,104.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,197,225.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,958,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,916,860.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,272,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	1,800,000.00	1,866,996.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,751,225.00	
オーストラリアドル 小計		44,950,000.00	52,100,125.40 (4,021,087,678)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,116,170.00
	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,151,110.00
	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	454,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,281,720.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	505,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	911,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	474,056.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	771,820.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	846,240.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	830,700.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,767,750.00
	シンガポールドル 小計		8,850,000.00
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,218,844.50
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,467,640.28
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,776,086.81
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,774,967.50
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,532,296.30
		28,200,000.00	30,769,835.39

マレーシアリングット 小計			(784,630,802)	
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.75	6,200,000.00	6,273,780.00	
	ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	3,018,494.00	
	ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,695,405.00	
	ISRAEL FIXED 3.75	3,700,000.00	5,375,323.00	
	ISRAEL FIXED 6.25	3,500,000.00	4,730,565.00	
イスラエルシュケル 小計		17,800,000.00	21,093,567.00	(659,595,840)
合計			164,257,613,313	(164,257,613,313)

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 205銘柄	43.4%	43.8%
カナダドル	国債証券 24銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 274銘柄	40.9%	41.4%
英ポンド	国債証券 41銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	2.4%	2.4%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	0.5%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 5銘柄	0.4%	0.4%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド( B号)

#### 貸借対照表

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	396,959
コール・ローン	2,844,592,131	1,924,077,371
株式	162,317,778,960	171,265,905,610
派生商品評価勘定	9,394,560	11,871,100
未収入金	82,093,400	323,400
未収配当金	87,854,297	78,005,333

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
差入委託証拠金	-	24,345,000
流動資産合計	165,341,713,348	173,304,924,773
資産合計	165,341,713,348	173,304,924,773
負債の部		
流動負債		
前受金	9,576,000	11,980,000
未払金	75,412,440	-
未払解約金	314,201,129	371,068,201
未払利息	5,898	5,626
その他未払費用	80,285	46,575
流動負債合計	399,275,752	383,100,402
負債合計	399,275,752	383,100,402
純資産の部		
元本等		
元本	67,012,358,207	65,642,531,273
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	97,930,079,389	107,279,293,098
元本等合計	164,942,437,596	172,921,824,371
純資産合計	164,942,437,596	172,921,824,371
負債純資産合計	165,341,713,348	173,304,924,773

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2019年 9月10日現在）	（2020年 9月10日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式 2,873,200,000円	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式 2,782,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,012,358,207口	65,642,531,273口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.4614円 (10,000口当たりの純資産額 24,614円)	1口当たり純資産額 2.6343円 (10,000口当たりの純資産額 26,343円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引



(単位:円)

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

(2020年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100
	東証株価指数先物	1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100
合計		1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100

(注)1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2019年9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,586,990,177円
同期中における追加設定元本額	14,402,624,359円
同期中における一部解約元本額	13,977,256,329円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,297,535,093円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	936,629,094円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,372,622,152円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,077,596,599円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	79,548,105円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,521,416円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	26,449,717円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	69,280,114円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	114,015,385円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	72,611,248円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	162,043,173円
国内株式指数ファンド(T O P I X )	1,881,721,931円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	10,681,862,873円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	703,214,947円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	704,638,089円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	657,634,234円
イオン・バランス戦略ファンド	20,200,789円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,674,460円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,643,496円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	43,779,782円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	118,883,698円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	67,721,066円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	97,101,612円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	11,942,118円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	84,449円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	145,980円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	205,814円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,295,208,817円
バランスファンドV A (安定運用型) <適格機関投資家限定>	25,179,682円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 <適格機関投資家限定>	225,151,325円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	3,425,849,637円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	2,478,628,566円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	9,114,813,234円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	61,727,246円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	228,715,429円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	820,636円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	944,525,520円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	59,055,804円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	383,289,354円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,117,775,166円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	946,532,566円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,069,470,019円

S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,178,238円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	320,817,705円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	64,850,126円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	124,813,482円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	106,238,219円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	50,196,487円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	23,479,637円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	210,333,929円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	391,125,797円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	88,869,499円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	124,403,903円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	62,637,257円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,693,725円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	77,976,450円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	944,546,625円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A ( 適格機関投資家専用 )	205,369,341円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	21,266,288円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	1,371,586,190円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	216,497,008円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	133,073,322円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	12,426,668円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	62,248,962円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	85,931,741円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	83,433,172円
合計	67,012,358,207円

( 2020年 9月10日現在 )

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,012,358,207円
同期中における追加設定元本額	16,719,008,847円
同期中における一部解約元本額	18,088,835,781円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,813,378,482円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	953,041,285円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	4,557,926,901円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	3,246,692,882円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 機動的資産配分型 )	131,539,547円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	6,261,625円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	24,034,515円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 ( 4 資産タイプ )	67,454,138円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 ( 4 資産タイプ )	129,852,969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)	94,086,891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)	193,204,597円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,493,615,700円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,225,871,549円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	557,959,858円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	630,495,924円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	447,100,100円
イオン・バランス戦略ファンド	79,845,037円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,359,609円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	106,722,289円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	84,278,805円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	274,421,727円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	142,865,288円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	159,916,843円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,691,114円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	84,086,424円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,992,000円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	28,393,555円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	20,856,396円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,094,930円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,486,612,046円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	19,476,993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>	186,206,344円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	2,812,194,105円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,214,774,108円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	8,246,410,160円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	51,276,484円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	205,573,161円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	540,428円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	875,143,551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>	57,132,852円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	353,640,333円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,043,896,738円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	830,900,906円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,647,623,830円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	804,861円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	56,901,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	69,745,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	43,825,793円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	21,322,488円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	169,576,105円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	335,050,151円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	96,790,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	51,654,165円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	9,439,355円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	62,708,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	834,474,721円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	192,328,030円

SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	5,300,553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>	651,269,490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>	170,212,578円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,464,565,051円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	112,200,588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>	16,640,426円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	57,544,240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>	74,945,830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>	512,787,716円
合計	65,642,531,273円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	2,721.00	10,339,800	
日本水産	101,600	463.00	47,040,800	
マルハニチロ	14,600	2,417.00	35,288,200	
カネコ種苗	4,600	1,439.00	6,619,400	
サカタのタネ	11,900	3,550.00	42,245,000	
ホクト	7,800	2,170.00	16,926,000	
日鉄鉱業	2,500	4,655.00	11,637,500	
三井松島ホールディングス	5,600	740.00	4,144,000	
国際石油開発帝石	376,700	636.90	239,920,230	
石油資源開発	12,900	1,852.00	23,890,800	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,508.00	8,444,800	
ヒノキヤグループ	3,600	1,950.00	7,020,000	
ショーボンドホールディングス	15,500	5,130.00	79,515,000	
ミライト・ホールディングス	30,100	1,529.00	46,022,900	
タマホーム	6,500	1,308.00	8,502,000	
スペースバリューホールディングス	17,900	444.00	7,947,600	
安藤・間	60,900	758.00	46,162,200	
東急建設	30,200	472.00	14,254,400	
コムシスホールディングス	36,100	2,933.00	105,881,300	
ピーアールホールディングス	13,400	759.00	10,170,600	
高松コンストラクショングループ	6,400	2,224.00	14,233,600	
東建コーポレーション	3,000	7,040.00	21,120,000	

大成建設	78,500	3,615.00	283,777,500
大林組	234,500	1,021.00	239,424,500
清水建設	237,800	802.00	190,715,600
飛島建設	8,700	1,065.00	9,265,500
長谷工コーポレーション	90,400	1,472.00	133,068,800
松井建設	11,800	658.00	7,764,400
銭高組	1,600	3,755.00	6,008,000
鹿島建設	184,300	1,323.00	243,828,900
不動テトラ	7,600	1,473.00	11,194,800
大末建設	6,300	897.00	5,651,100
鉄建建設	6,100	1,998.00	12,187,800
西松建設	18,600	2,008.00	37,348,800
三井住友建設	61,000	427.00	26,047,000
大豊建設	5,900	2,863.00	16,891,700
前田建設工業	60,900	752.00	45,796,800
奥村組	13,000	2,524.00	32,812,000
東鉄工業	9,500	2,674.00	25,403,000
浅沼組	3,000	4,125.00	12,375,000
戸田建設	98,000	690.00	67,620,000
熊谷組	10,700	2,645.00	28,301,500
北野建設	2,200	2,579.00	5,673,800
矢作建設工業	12,100	842.00	10,188,200
ピーエス三菱	10,600	589.00	6,243,400
日本ハウスホールディングス	26,100	274.00	7,151,400
大東建託	26,000	9,494.00	246,844,000
新日本建設	10,500	873.00	9,166,500
N I P P O	18,900	2,740.00	51,786,000
東亜道路工業	2,000	3,380.00	6,760,000
前田道路	21,700	1,910.00	41,447,000
日本道路	2,400	7,540.00	18,096,000
東亜建設工業	8,300	1,626.00	13,495,800
日本国土開発	22,900	608.00	13,923,200
若築建設	6,000	1,175.00	7,050,000
東洋建設	29,900	404.00	12,079,600
五洋建設	94,800	689.00	65,317,200
世紀東急工業	14,000	798.00	11,172,000
福田組	2,800	4,955.00	13,874,000
住友林業	60,000	1,727.00	103,620,000
日本基礎技術	13,700	457.00	6,260,900
巴コーポレーション	16,200	368.00	5,961,600
大和ハウス工業	233,600	2,941.00	687,017,600
ライト工業	13,000	1,589.00	20,657,000

積水ハウス	255,900	2,106.00	538,925,400
ユアテック	15,200	621.00	9,439,200
日本リーテック	5,500	2,724.00	14,982,000
中電工	8,500	2,274.00	19,329,000
関電工	30,600	846.00	25,887,600
きんでん	55,600	1,812.00	100,747,200
東京エネシス	9,800	729.00	7,144,200
トーエネック	2,900	3,565.00	10,338,500
住友電設	6,400	2,324.00	14,873,600
日本電設工業	11,900	2,150.00	25,585,000
協和エクシオ	35,300	2,690.00	94,957,000
新日本空調	6,700	2,093.00	14,023,100
九電工	16,700	3,055.00	51,018,500
三機工業	16,400	1,186.00	19,450,400
日揮ホールディングス	73,100	1,108.00	80,994,800
中外炉工業	4,100	1,476.00	6,051,600
ヤマト	9,400	673.00	6,326,200
太平電業	6,100	2,210.00	13,481,000
高砂熱学工業	19,100	1,523.00	29,089,300
朝日工業社	2,200	2,820.00	6,204,000
明星工業	15,600	787.00	12,277,200
大気社	11,200	2,853.00	31,953,600
ダイダン	5,700	2,641.00	15,053,700
日比谷総合設備	8,000	1,740.00	13,920,000
OSJBホールディングス	43,100	233.00	10,042,300
レイズネクスト	13,300	1,280.00	17,024,000
日本製粉	20,500	1,656.00	33,948,000
日清製粉グループ本社	84,800	1,678.00	142,294,400
昭和産業	6,600	3,520.00	23,232,000
鳥越製粉	8,500	947.00	8,049,500
中部飼料	8,900	1,589.00	14,142,100
フィード・ワン	55,900	189.00	10,565,100
日本甜菜製糖	4,700	1,796.00	8,441,200
三井製糖	5,900	1,914.00	11,292,600
日新製糖	3,600	1,843.00	6,634,800
森永製菓	17,800	4,035.00	71,823,000
中村屋	2,900	4,025.00	11,672,500
江崎グリコ	20,800	4,630.00	96,304,000
名糖産業	6,200	1,558.00	9,659,600
井村屋グループ	4,800	2,336.00	11,212,800
不二家	5,100	2,294.00	11,699,400
山崎製パン	56,600	1,756.00	99,389,600

モロゾフ	1,700	5,540.00	9,418,000
亀田製菓	4,200	5,280.00	22,176,000
寿スピリッツ	7,100	5,110.00	36,281,000
カルビー	34,600	3,335.00	115,391,000
森永乳業	14,000	5,120.00	71,680,000
六甲バター	5,900	1,790.00	10,561,000
ヤクルト本社	52,000	5,640.00	293,280,000
明治ホールディングス	49,700	7,990.00	397,103,000
雪印メグミルク	17,900	2,280.00	40,812,000
プリマハム	11,300	2,983.00	33,707,900
日本ハム	28,700	4,715.00	135,320,500
丸大食品	8,000	1,857.00	14,856,000
S Foods	5,800	2,940.00	17,052,000
柿安本店	3,200	2,644.00	8,460,800
伊藤ハム米久ホールディングス	43,700	699.00	30,546,300
サッポロホールディングス	25,900	1,899.00	49,184,100
アサヒグループホールディングス	158,200	3,758.00	594,515,600
キリンホールディングス	320,100	2,015.00	645,001,500
宝ホールディングス	56,300	1,068.00	60,128,400
オエノンホールディングス	24,100	424.00	10,218,400
養命酒製造	3,500	1,851.00	6,478,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	58,100	1,770.00	102,837,000
サントリー食品インターナショナル	50,400	3,960.00	199,584,000
ダイドーグループホールディングス	3,800	5,250.00	19,950,000
伊藤園	22,800	6,830.00	155,724,000
キーコーヒー	6,900	2,265.00	15,628,500
日清オイリオグループ	9,400	3,165.00	29,751,000
不二製油グループ本社	18,300	3,120.00	57,096,000
かどや製油	1,300	3,645.00	4,738,500
J - オイルミルズ	3,900	3,805.00	14,839,500
キッコーマン	54,200	5,750.00	311,650,000
味の素	166,900	2,006.00	334,801,400
キューピー	41,800	2,043.00	85,397,400
ハウス食品グループ本社	28,000	3,540.00	99,120,000
カゴメ	30,600	3,330.00	101,898,000
焼津水産化学工業	6,600	929.00	6,131,400
アリアケジャパン	6,900	7,560.00	52,164,000
ニチレイ	36,000	2,747.00	98,892,000
東洋水産	38,800	5,650.00	219,220,000
イトアンド	4,100	1,952.00	8,003,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,100	913.00	4,656,300
日清食品ホールディングス	32,100	9,960.00	319,716,000



永谷園ホールディングス	4,200	2,244.00	9,424,800
一正蒲鉾	5,900	1,039.00	6,130,100
フジッコ	7,700	2,042.00	15,723,400
ロック・フィールド	9,300	1,400.00	13,020,000
日本たばこ産業	404,400	1,993.00	805,969,200
ケンコーマヨネーズ	4,800	1,818.00	8,726,400
わらべや日洋ホールディングス	6,000	1,486.00	8,916,000
なとり	5,400	1,908.00	10,303,200
ピククルスコーポレーション	2,100	2,594.00	5,447,400
北の達人コーポレーション	26,400	536.00	14,150,400
ユーグレナ	33,800	827.00	27,952,600
ミヨシ油脂	4,500	1,148.00	5,166,000
理研ビタミン	7,100	2,145.00	15,229,500
片倉工業	12,300	1,197.00	14,723,100
グンゼ	5,700	3,915.00	22,315,500
東洋紡	29,700	1,576.00	46,807,200
ユニチカ	25,200	380.00	9,576,000
富士紡ホールディングス	4,000	3,555.00	14,220,000
倉敷紡績	7,900	1,939.00	15,318,100
日本毛織	25,400	978.00	24,841,200
ダイドーリミテッド	17,100	199.00	3,402,900
帝国繊維	8,600	2,651.00	22,798,600
帝人	59,600	1,704.00	101,558,400
東レ	534,900	508.40	271,943,160
住江織物	2,600	1,792.00	4,659,200
アツギ	13,600	529.00	7,194,400
ダイニック	6,400	799.00	5,113,600
セーレン	18,800	1,562.00	29,365,600
小松マテーレ	13,500	832.00	11,232,000
ワコールホールディングス	19,000	1,868.00	35,492,000
ホギメディカル	8,700	3,395.00	29,536,500
T S Iホールディングス	26,400	321.00	8,474,400
マツオカコーポレーション	3,000	2,076.00	6,228,000
ワールド	10,700	1,455.00	15,568,500
オンワードホールディングス	45,900	276.00	12,668,400
ゴールドウイン	13,400	7,580.00	101,572,000
デサント	14,600	1,824.00	26,630,400
特種東海製紙	4,500	4,520.00	20,340,000
王子ホールディングス	305,200	499.00	152,294,800
日本製紙	32,400	1,341.00	43,448,400
三菱製紙	12,500	355.00	4,437,500
北越コーポレーション	42,200	374.00	15,782,800

中越パルプ工業	4,800	1,443.00	6,926,400
大王製紙	32,000	1,397.00	44,704,000
レンゴー	70,500	779.00	54,919,500
トモク	5,300	1,704.00	9,031,200
ザ・パック	5,800	2,856.00	16,564,800
クラレ	115,100	1,123.00	129,257,300
旭化成	487,800	940.90	458,971,020
昭和電工	55,700	1,990.00	110,843,000
住友化学	536,000	376.00	201,536,000
住友精化	3,500	3,320.00	11,620,000
日産化学	40,900	5,510.00	225,359,000
ラサ工業	3,300	1,769.00	5,837,700
クレハ	6,100	4,730.00	28,853,000
多木化学	3,000	6,150.00	18,450,000
テイカ	5,800	1,442.00	8,363,600
石原産業	14,300	764.00	10,925,200
日本曹達	10,700	3,095.00	33,116,500
東ソー	113,300	1,772.00	200,767,600
トクヤマ	21,100	2,703.00	57,033,300
セントラル硝子	15,100	2,201.00	33,235,100
東亜合成	45,400	1,116.00	50,666,400
大阪ソーダ	7,000	2,616.00	18,312,000
関東電化工業	18,600	771.00	14,340,600
デンカ	27,100	3,220.00	87,262,000
信越化学工業	126,500	13,880.00	1,755,820,000
日本カーバイド工業	4,700	1,233.00	5,795,100
堺化学工業	5,200	2,071.00	10,769,200
第一稀元素化学工業	9,800	814.00	7,977,200
エア・ウォーター	68,400	1,496.00	102,326,400
大陽日酸	70,900	1,830.00	129,747,000
日本化学工業	2,900	2,367.00	6,864,300
日本パーカラライジング	37,300	998.00	37,225,400
高压ガス工業	13,000	842.00	10,946,000
チタン工業	2,100	1,739.00	3,651,900
四国化成工業	10,700	1,153.00	12,337,100
ステラ ケミファ	4,400	2,980.00	13,112,000
保土谷化学工業	2,900	4,795.00	13,905,500
日本触媒	11,400	5,790.00	66,006,000
大日精化工業	6,300	2,267.00	14,282,100
カネカ	18,900	2,938.00	55,528,200
三菱瓦斯化学	68,300	1,969.00	134,482,700
三井化学	67,900	2,699.00	183,262,100

J S R	68,900	2,476.00	170,596,400
東京応化工業	12,800	5,200.00	66,560,000
大阪有機化学工業	6,800	2,602.00	17,693,600
三菱ケミカルホールディングス	491,600	661.00	324,947,600
K Hネオケム	13,100	2,586.00	33,876,600
ダイセル	95,400	820.00	78,228,000
住友ベークライト	11,900	3,115.00	37,068,500
積水化学工業	154,100	1,728.00	266,284,800
日本ゼオン	66,700	1,184.00	78,972,800
アイカ工業	22,000	3,720.00	81,840,000
宇部興産	36,500	1,959.00	71,503,500
積水樹脂	12,900	2,186.00	28,199,400
タキロンシーアイ	16,000	705.00	11,280,000
旭有機材	5,100	1,294.00	6,599,400
ニチバン	4,800	1,634.00	7,843,200
リケンテクノス	21,600	400.00	8,640,000
大倉工業	3,900	1,550.00	6,045,000
積水化成成品工業	10,900	574.00	6,256,600
群栄化学工業	2,400	2,384.00	5,721,600
ミライアル	3,800	1,013.00	3,849,400
ダイキョーニシカワ	15,900	587.00	9,333,300
森六ホールディングス	5,200	1,862.00	9,682,400
日本化薬	45,800	980.00	44,884,000
カーリットホールディングス	11,500	503.00	5,784,500
日本精化	6,700	1,550.00	10,385,000
扶桑化学工業	7,200	3,515.00	25,308,000
トリケミカル研究所	1,700	11,230.00	19,091,000
A D E K A	33,300	1,552.00	51,681,600
日油	27,500	4,160.00	114,400,000
ハリマ化成グループ	7,000	992.00	6,944,000
花王	180,100	8,021.00	1,444,582,100
第一工業製薬	2,900	4,475.00	12,977,500
ニイタカ	2,000	3,010.00	6,020,000
三洋化成工業	4,100	4,985.00	20,438,500
大日本塗料	9,100	919.00	8,362,900
日本ペイントホールディングス	60,800	9,240.00	561,792,000
関西ペイント	82,700	2,595.00	214,606,500
中国塗料	21,800	1,004.00	21,887,200
日本特殊塗料	6,500	936.00	6,084,000
藤倉化成	12,600	530.00	6,678,000
太陽ホールディングス	5,400	5,620.00	30,348,000
D I C	30,900	2,655.00	82,039,500

サカティンクス	15,400	1,077.00	16,585,800
東洋インキSCホールディングス	14,000	1,967.00	27,538,000
T & K TOKA	7,600	800.00	6,080,000
富士フイルムホールディングス	144,400	4,999.00	721,855,600
資生堂	149,600	6,167.00	922,583,200
ライオン	97,900	2,227.00	218,023,300
高砂香料工業	5,100	2,065.00	10,531,500
マンダム	17,100	1,827.00	31,241,700
ミルボン	10,100	5,650.00	57,065,000
ファンケル	30,500	3,615.00	110,257,500
コーセー	14,200	12,690.00	180,198,000
コタ	5,900	1,260.00	7,434,000
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	2,011.00	64,553,100
ノエビアホールディングス	6,200	5,030.00	31,186,000
エステー	5,600	2,147.00	12,023,200
アグロ カネショウ	4,000	1,615.00	6,460,000
コニシ	11,600	1,464.00	16,982,400
長谷川香料	12,800	2,051.00	26,252,800
小林製薬	21,000	9,650.00	202,650,000
荒川化学工業	7,000	1,243.00	8,701,000
メック	5,800	1,812.00	10,509,600
タカラバイオ	19,900	2,773.00	55,182,700
JCU	9,000	3,380.00	30,420,000
デクセリアルズ	20,200	1,093.00	22,078,600
アース製薬	5,600	7,750.00	43,400,000
北興化学工業	9,100	706.00	6,424,600
大成ラミック	3,600	2,645.00	9,522,000
クミアイ化学工業	31,300	1,007.00	31,519,100
日本農薬	16,100	499.00	8,033,900
アキレス	5,900	1,764.00	10,407,600
有沢製作所	12,800	954.00	12,211,200
日東電工	51,700	6,620.00	342,254,000
レック	8,200	1,604.00	13,152,800
三光合成	15,300	277.00	4,238,100
藤森工業	6,300	4,080.00	25,704,000
前澤化成工業	7,500	1,038.00	7,785,000
未来工業	5,000	1,986.00	9,930,000
JSP	5,000	1,626.00	8,130,000
エフピコ	8,400	8,040.00	67,536,000
天馬	5,400	1,873.00	10,114,200
信越ポリマー	13,200	910.00	12,012,000
東リ	23,100	252.00	5,821,200

ニフコ	27,500	2,927.00	80,492,500
バルカー	6,600	1,887.00	12,454,200
ユニ・チャーム	159,700	4,502.00	718,969,400
協和キリン	75,400	2,839.00	214,060,600
武田薬品工業	625,700	3,868.00	2,420,207,600
アステラス製薬	651,800	1,610.00	1,049,398,000
大日本住友製薬	56,100	1,348.00	75,622,800
塩野義製薬	94,600	5,798.00	548,490,800
あすか製薬	9,800	1,267.00	12,416,600
日本新薬	19,600	8,600.00	168,560,000
中外製薬	235,000	4,709.00	1,106,615,000
科研製薬	13,000	4,720.00	61,360,000
エーザイ	90,100	9,231.00	831,713,100
ロート製薬	38,400	3,475.00	133,440,000
小野薬品工業	172,800	3,220.00	556,416,000
久光製薬	19,800	5,100.00	100,980,000
持田製薬	10,400	3,940.00	40,976,000
参天製薬	140,000	2,034.00	284,760,000
扶桑薬品工業	3,700	2,700.00	9,990,000
日本ケミファ	2,200	2,524.00	5,552,800
ツムラ	23,300	3,095.00	72,113,500
日医工	22,000	1,207.00	26,554,000
キッセイ薬品工業	13,500	2,331.00	31,468,500
生化学工業	14,900	1,131.00	16,851,900
栄研化学	13,400	1,991.00	26,679,400
鳥居薬品	4,900	2,851.00	13,969,900
JCRファーマ	5,300	11,660.00	61,798,000
東和薬品	9,500	2,120.00	20,140,000
富士製薬工業	6,800	1,161.00	7,894,800
沢井製薬	15,400	5,480.00	84,392,000
ゼリア新薬工業	13,400	2,005.00	26,867,000
第一三共	215,200	9,464.00	2,036,652,800
キョーリン製薬ホールディングス	16,800	2,123.00	35,666,400
大幸薬品	9,700	2,360.00	22,892,000
ダイト	4,900	3,340.00	16,366,000
大塚ホールディングス	156,200	4,515.00	705,243,000
大正製薬ホールディングス	15,700	6,630.00	104,091,000
ペプチドリーム	38,100	4,250.00	161,925,000
日本コークス工業	104,500	62.00	6,479,000
ニチレキ	9,200	1,663.00	15,299,600
ユシロ化学工業	6,400	1,315.00	8,416,000
出光興産	83,900	2,364.00	198,339,600

E N E O Sホールディングス	1,133,900	411.00	466,032,900
コスモエネルギーホールディングス	22,400	1,620.00	36,288,000
横浜ゴム	42,500	1,728.00	73,440,000
T O Y O T I R E	43,500	1,808.00	78,648,000
ブリヂストン	200,100	3,442.00	688,744,200
住友ゴム工業	65,800	1,027.00	67,576,600
オカモト	4,600	4,230.00	19,458,000
ニッタ	7,800	2,320.00	18,096,000
住友理工	16,100	585.00	9,418,500
三ツ星ベルト	10,000	1,683.00	16,830,000
バンドー化学	14,400	605.00	8,712,000
日東紡績	11,300	4,205.00	47,516,500
A G C	68,700	3,230.00	221,901,000
日本板硝子	15,400	438.00	6,745,200
日本山村硝子	5,400	889.00	4,800,600
日本電気硝子	29,900	2,130.00	63,687,000
オハラ	4,000	1,053.00	4,212,000
住友大阪セメント	14,400	3,590.00	51,696,000
太平洋セメント	47,700	2,889.00	137,805,300
日本ヒューム	10,600	801.00	8,490,600
日本コンクリート工業	22,200	300.00	6,660,000
三谷セキサン	3,400	6,130.00	20,842,000
アジアパイルホールディングス	15,000	474.00	7,110,000
東海カーボン	78,000	1,063.00	82,914,000
日本カーボン	4,200	3,685.00	15,477,000
東洋炭素	4,900	1,723.00	8,442,700
ノリタケカンパニーリミテド	4,100	3,415.00	14,001,500
T O T O	53,500	4,740.00	253,590,000
日本碍子	89,500	1,598.00	143,021,000
日本特殊陶業	56,800	1,932.00	109,737,600
M A R U W A	2,900	9,320.00	27,028,000
品川リフラクトリーズ	2,400	2,434.00	5,841,600
黒崎播磨	1,800	3,175.00	5,715,000
ヨータイ	8,200	705.00	5,781,000
東京窯業	16,500	339.00	5,593,500
フジインコーポレーテッド	6,800	3,580.00	24,344,000
ニチアス	20,200	2,515.00	50,803,000
ニチハ	10,200	2,952.00	30,110,400
日本製鉄	332,300	1,164.00	386,797,200
神戸製鋼所	135,900	441.00	59,931,900
中山製鋼所	13,000	346.00	4,498,000
合同製鐵	4,700	2,127.00	9,996,900

ジェイ エフ イー ホールディングス	198,700	880.00	174,856,000
東京製鐵	36,400	748.00	27,227,200
共英製鋼	9,200	1,390.00	12,788,000
大和工業	16,000	2,615.00	41,840,000
東京鐵鋼	4,300	1,633.00	7,021,900
大阪製鐵	4,500	1,108.00	4,986,000
淀川製鋼所	9,500	1,855.00	17,622,500
丸一鋼管	23,900	2,817.00	67,326,300
モリ工業	2,700	2,271.00	6,131,700
大同特殊鋼	12,100	3,400.00	41,140,000
日本冶金工業	6,900	1,649.00	11,378,100
山陽特殊製鋼	6,300	995.00	6,268,500
愛知製鋼	4,400	2,650.00	11,660,000
日立金属	80,500	1,669.00	134,354,500
大平洋金属	5,600	1,784.00	9,990,400
新日本電工	53,400	207.00	11,053,800
栗本鐵工所	4,400	1,962.00	8,632,800
三菱製鋼	8,900	576.00	5,126,400
シンニッタン	19,900	214.00	4,258,600
大紀アルミニウム工業所	12,700	568.00	7,213,600
日本輕金属ホールディングス	193,000	189.00	36,477,000
三井金属鉱業	20,300	2,765.00	56,129,500
三菱マテリアル	49,100	2,326.00	114,206,600
住友金属鉱山	95,300	3,543.00	337,647,900
D O W A ホールディングス	18,900	3,415.00	64,543,500
古河機械金属	13,100	1,116.00	14,619,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,700	997.00	9,670,900
東邦チタニウム	15,200	734.00	11,156,800
U A C J	11,400	2,061.00	23,495,400
C K サンエツ	2,100	3,315.00	6,961,500
古河電気工業	23,400	2,566.00	60,044,400
住友電気工業	278,000	1,277.50	355,145,000
フジクラ	94,700	313.00	29,641,100
昭和電線ホールディングス	10,100	1,112.00	11,231,200
タツタ電線	16,300	619.00	10,089,700
リョービ	9,700	1,194.00	11,581,800
アーレスティ	15,700	342.00	5,369,400
アサヒホールディングス	13,400	3,520.00	47,168,000
稲葉製作所	6,000	1,337.00	8,022,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,604.00	5,293,200
トーカロ	21,000	1,050.00	22,050,000
アルファC o	4,300	945.00	4,063,500

SUMCO	95,500	1,405.00	134,177,500
川田テクノロジーズ	1,800	4,930.00	8,874,000
RS Technologies	2,800	3,230.00	9,044,000
東洋製罐グループホールディングス	47,900	1,152.00	55,180,800
ホッカンホールディングス	4,800	1,520.00	7,296,000
コロナ	5,900	1,012.00	5,970,800
横河ブリッジホールディングス	13,900	1,914.00	26,604,600
三和ホールディングス	70,800	1,158.00	81,986,400
文化シャッター	23,400	779.00	18,228,600
三協立山	11,100	981.00	10,889,100
アルインコ	7,900	964.00	7,615,600
LIXILグループ	109,700	1,999.00	219,290,300
ノーリツ	15,500	1,407.00	21,808,500
長府製作所	8,000	2,061.00	16,488,000
リンナイ	14,500	9,940.00	144,130,000
日東精工	12,400	452.00	5,604,800
岡部	15,300	785.00	12,010,500
ジーテクト	9,800	1,264.00	12,387,200
東プレ	13,900	1,255.00	17,444,500
高周波熱錬	16,200	514.00	8,326,800
東京製網	8,200	532.00	4,362,400
パイオラックス	11,900	1,600.00	19,040,000
エイチワン	9,300	601.00	5,589,300
日本発條	79,500	721.00	57,319,500
三益半導体工業	5,800	2,235.00	12,963,000
日本製鋼所	23,000	1,572.00	36,156,000
三浦工業	32,200	4,285.00	137,977,000
タクマ	24,800	1,684.00	41,763,200
ツガミ	15,600	1,233.00	19,234,800
オークマ	8,600	5,320.00	45,752,000
芝浦機械	8,900	2,229.00	19,838,100
アマダ	91,000	1,020.00	92,820,000
アイダエンジニアリング	18,700	712.00	13,314,400
F U J I	30,800	1,893.00	58,304,400
牧野フライス製作所	8,500	4,035.00	34,297,500
オーエスジー	36,900	1,683.00	62,102,700
旭ダイヤモンド工業	20,300	511.00	10,373,300
D M G 森精機	47,000	1,554.00	73,038,000
ソディック	18,100	757.00	13,701,700
ディスコ	10,100	23,810.00	240,481,000
日東工器	4,500	1,996.00	8,982,000
日進工具	3,400	2,296.00	7,806,400



パンチ工業	11,300	413.00	4,666,900
豊和工業	5,700	828.00	4,719,600
島精機製作所	11,800	1,655.00	19,529,000
オプトラン	9,500	2,077.00	19,731,500
イワキポンプ	5,900	930.00	5,487,000
フリー	9,200	1,091.00	10,037,200
ヤマシンフィルタ	16,100	1,077.00	17,339,700
日阪製作所	10,600	823.00	8,723,800
やまびこ	14,000	1,260.00	17,640,000
平田機工	3,400	5,910.00	20,094,000
ペガサスミシン製造	15,300	301.00	4,605,300
マルマエ	4,200	867.00	3,641,400
タツモ	3,900	1,354.00	5,280,600
ナプテスコ	43,700	3,530.00	154,261,000
三井海洋開発	8,200	1,792.00	14,694,400
レオン自動機	7,900	1,108.00	8,753,200
S M C	23,600	57,200.00	1,349,920,000
ホソカワミクロン	2,600	5,930.00	15,418,000
ユニオンツール	2,900	3,085.00	8,946,500
オイレス工業	9,100	1,480.00	13,468,000
日精エー・エス・ピー機械	2,600	4,200.00	10,920,000
サトーホールディングス	10,700	2,056.00	21,999,200
技研製作所	6,600	3,800.00	25,080,000
日精樹脂工業	7,700	856.00	6,591,200
小松製作所	340,400	2,385.50	812,024,200
住友重機械工業	42,500	2,513.00	106,802,500
日立建機	29,800	3,710.00	110,558,000
日工	13,400	704.00	9,433,600
巴工業	4,200	1,885.00	7,917,000
井関農機	8,100	1,309.00	10,602,900
T O W A	8,700	1,075.00	9,352,500
北川鉄工所	4,100	1,484.00	6,084,400
ローツェ	3,300	4,615.00	15,229,500
クボタ	398,800	1,929.00	769,285,200
荏原実業	2,600	2,777.00	7,220,200
三菱化工機	3,700	1,771.00	6,552,700
月島機械	13,700	1,238.00	16,960,600
帝国電機製作所	7,300	1,103.00	8,051,900
新東工業	17,200	735.00	12,642,000
澁谷工業	6,300	3,395.00	21,388,500
アイチ コーポレーション	14,100	840.00	11,844,000
小森コーポレーション	18,900	764.00	14,439,600

鶴見製作所	6,100	1,803.00	10,998,300
住友精密工業	2,200	2,247.00	4,943,400
酒井重工業	1,900	2,367.00	4,497,300
荏原製作所	31,200	2,813.00	87,765,600
西島製作所	10,900	810.00	8,829,000
北越工業	9,300	1,051.00	9,774,300
ダイキン工業	95,700	19,485.00	1,864,714,500
オルガノ	2,700	5,620.00	15,174,000
トーヨーカネツ	4,200	2,319.00	9,739,800
栗田工業	40,500	3,375.00	136,687,500
椿本チエイン	9,800	2,468.00	24,186,400
大同工業	7,000	578.00	4,046,000
アネスト岩田	12,600	833.00	10,495,800
ダイフク	38,200	9,300.00	355,260,000
サムコ	2,300	2,699.00	6,207,700
加藤製作所	6,000	1,132.00	6,792,000
タダノ	36,700	843.00	30,938,100
フジテック	26,800	2,250.00	60,300,000
C K D	20,500	1,533.00	31,426,500
キトー	7,500	1,240.00	9,300,000
平和	20,800	1,807.00	37,585,600
理想科学工業	7,400	1,529.00	11,314,600
S A N K Y O	17,100	2,960.00	50,616,000
日本金銭機械	10,700	571.00	6,109,700
マースグループホールディングス	5,900	1,682.00	9,923,800
フクシマガリレイ	4,600	3,500.00	16,100,000
ダイコク電機	5,800	1,071.00	6,211,800
竹内製作所	12,500	2,256.00	28,200,000
アマノ	19,700	2,294.00	45,191,800
J U K I	13,200	476.00	6,283,200
マックス	11,100	1,558.00	17,293,800
グローリー	19,400	2,287.00	44,367,800
新晃工業	7,500	1,422.00	10,665,000
大和冷機工業	12,600	913.00	11,503,800
セガサミーホールディングス	74,800	1,259.00	94,173,200
日本ピストンリング	4,400	1,015.00	4,466,000
リケン	3,900	2,645.00	10,315,500
T P R	9,900	1,369.00	13,553,100
ツバキ・ナカシマ	16,300	907.00	14,784,100
ホシザキ	23,700	8,100.00	191,970,000
大豊工業	8,200	558.00	4,575,600
日本精工	139,500	894.00	124,713,000

NTN	175,500	228.00	40,014,000
ジェイテクト	70,500	910.00	64,155,000
不二越	7,000	3,640.00	25,480,000
日本トムソン	25,800	413.00	10,655,400
THK	47,000	2,699.00	126,853,000
ユーシン精機	8,000	713.00	5,704,000
前澤給装工業	3,700	2,123.00	7,855,100
イーグル工業	9,600	815.00	7,824,000
日本ピラー工業	8,100	1,512.00	12,247,200
キッツ	30,200	616.00	18,603,200
マキタ	97,900	4,755.00	465,514,500
日立造船	57,600	434.00	24,998,400
三菱重工業	125,900	2,605.00	327,969,500
IHI	54,400	1,550.00	84,320,000
スター精密	11,800	1,403.00	16,555,400
日清紡ホールディングス	46,700	753.00	35,165,100
イビデン	46,200	3,545.00	163,779,000
コニカミノルタ	167,300	324.00	54,205,200
ブラザー工業	91,400	1,774.00	162,143,600
ミネベアミツミ	138,900	2,064.00	286,689,600
日立製作所	361,300	3,713.00	1,341,506,900
三菱電機	750,700	1,482.50	1,112,912,750
富士電機	45,200	3,525.00	159,330,000
東洋電機製造	4,200	1,090.00	4,578,000
安川電機	80,700	3,960.00	319,572,000
シンフォニアテクノロジー	11,000	1,125.00	12,375,000
明電舎	14,000	1,673.00	23,422,000
オリジン	3,600	1,298.00	4,672,800
山洋電気	3,800	4,845.00	18,411,000
デンヨー	6,600	2,286.00	15,087,600
東芝テック	9,400	4,680.00	43,992,000
芝浦メカトロニクス	1,800	3,000.00	5,400,000
マブチモーター	20,800	4,010.00	83,408,000
日本電産	180,900	9,329.00	1,687,616,100
トレックス・セミコンダクター	5,900	1,198.00	7,068,200
東光高岳	6,500	1,035.00	6,727,500
宮越ホールディングス	5,200	703.00	3,655,600
ダイヘン	8,000	4,140.00	33,120,000
ヤーマン	13,800	1,586.00	21,886,800
ミマキエンジニアリング	11,900	390.00	4,641,000
I-PEX	4,200	2,257.00	9,479,400
日新電機	17,400	1,160.00	20,184,000

大崎電気工業	18,000	611.00	10,998,000
オムロン	67,200	8,060.00	541,632,000
日東工業	10,800	1,964.00	21,211,200
I D E C	11,400	1,884.00	21,477,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,600	1,842.00	47,155,200
サクサホールディングス	3,100	1,387.00	4,299,700
メルコホールディングス	3,100	2,472.00	7,663,200
日本電気	91,200	5,620.00	512,544,000
富士通	72,500	13,470.00	976,575,000
沖電気工業	31,500	1,050.00	33,075,000
電気興業	4,000	2,549.00	10,196,000
サンケン電気	8,700	2,443.00	21,254,100
アイホン	5,100	1,417.00	7,226,700
ルネサスエレクトロニクス	322,800	785.00	253,398,000
セイコーエプソン	93,100	1,256.00	116,933,600
ワコム	51,800	681.00	35,275,800
アルバック	14,000	3,890.00	54,460,000
E I Z O	5,800	3,870.00	22,446,000
日本信号	18,900	1,050.00	19,845,000
京三製作所	19,700	493.00	9,712,100
能美防災	9,900	2,175.00	21,532,500
ホーチキ	6,200	1,209.00	7,495,800
エレコム	8,400	4,890.00	41,076,000
パナソニック	859,200	983.70	845,195,040
シャープ	87,200	1,335.00	116,412,000
アンリツ	48,700	2,273.00	110,695,100
富士通ゼネラル	20,600	2,895.00	59,637,000
ソニー	471,000	8,216.00	3,869,736,000
T D K	36,300	11,760.00	426,888,000
帝国通信工業	5,800	1,187.00	6,884,600
タムラ製作所	26,300	559.00	14,701,700
アルプスアルパイン	67,300	1,680.00	113,064,000
日本トリム	1,600	3,775.00	6,040,000
ローランド ディー・ジー	6,200	1,346.00	8,345,200
フォスター電機	9,100	1,279.00	11,638,900
S M K	2,500	2,596.00	6,490,000
ヨコオ	5,000	2,641.00	13,205,000
ホシデン	20,400	966.00	19,706,400
ヒロセ電機	11,500	12,480.00	143,520,000
日本航空電子工業	17,400	1,417.00	24,655,800
T O A	9,600	759.00	7,286,400
マクセルホールディングス	16,400	1,106.00	18,138,400

古野電気	11,000	957.00	10,527,000
ユニデンホールディングス	3,200	1,576.00	5,043,200
スミダコーポレーション	9,000	711.00	6,399,000
アイコム	4,500	2,716.00	12,222,000
リオン	3,800	2,287.00	8,690,600
船井電機	12,900	486.00	6,269,400
横河電機	69,300	1,788.00	123,908,400
新電元工業	3,300	2,027.00	6,689,100
アズビル	47,300	3,410.00	161,293,000
東亜ディーケーケー	5,500	861.00	4,735,500
日本光電工業	31,400	3,475.00	109,115,000
チノー	4,200	1,345.00	5,649,000
共和電業	15,200	423.00	6,429,600
堀場製作所	15,000	5,720.00	85,800,000
アドバンテスト	55,800	4,915.00	274,257,000
エスベック	6,900	1,850.00	12,765,000
キーエンス	68,100	44,800.00	3,050,880,000
日置電機	4,200	3,800.00	15,960,000
シスメックス	53,700	9,038.00	485,340,600
日本マイクロニクス	14,100	1,053.00	14,847,300
メガチップス	7,600	2,342.00	17,799,200
O B A R A G R O U P	4,500	3,745.00	16,852,500
コーセル	11,900	900.00	10,710,000
イリソ電子工業	6,500	4,285.00	27,852,500
オブテックスグループ	13,100	1,410.00	18,471,000
千代田インテグレ	4,500	1,547.00	6,961,500
レーザーテック	33,000	7,790.00	257,070,000
スタンレー電気	52,800	3,145.00	166,056,000
岩崎電気	4,100	1,447.00	5,932,700
ウシオ電機	42,300	1,359.00	57,485,700
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	296.00	3,936,800
日本セラミック	7,800	2,677.00	20,880,600
古河電池	6,200	1,065.00	6,603,000
山一電機	6,300	1,369.00	8,624,700
図研	5,100	2,557.00	13,040,700
日本電子	15,000	3,040.00	45,600,000
カシオ計算機	66,900	1,715.00	114,733,500
ファナック	70,700	21,155.00	1,495,658,500
日本シイエムケイ	20,800	496.00	10,316,800
エンプラス	4,700	2,285.00	10,739,500
ローム	31,200	7,870.00	245,544,000
浜松ホトニクス	53,800	4,950.00	266,310,000

三井ハイテック	9,000	1,790.00	16,110,000	
新光電気工業	25,300	1,624.00	41,087,200	
京セラ	105,700	6,256.00	661,259,200	
太陽誘電	33,600	3,065.00	102,984,000	
村田製作所	220,900	6,596.00	1,457,056,400	
双葉電子工業	12,900	899.00	11,597,100	
北陸電気工業	5,700	909.00	5,181,300	
ニチコン	26,000	810.00	21,060,000	
日本ケミコン	6,100	1,518.00	9,259,800	
K O A	11,900	1,101.00	13,101,900	
市光工業	12,800	477.00	6,105,600	
小糸製作所	44,800	5,550.00	248,640,000	
ミツバ	15,900	395.00	6,280,500	
S C R E E Nホールディングス	13,200	5,250.00	69,300,000	
キャノン電子	7,700	1,465.00	11,280,500	
キャノン	373,700	1,750.00	653,975,000	
リコー	191,500	762.00	145,923,000	
象印マホービン	22,100	1,620.00	35,802,000	
東京エレクトロン	47,700	25,590.00	1,220,643,000	
トヨタ紡織	21,800	1,508.00	32,874,400	
ユニプレス	14,900	948.00	14,125,200	
豊田自動織機	60,800	6,630.00	403,104,000	
モリタホールディングス	13,200	1,938.00	25,581,600	
三櫻工業	11,100	618.00	6,859,800	
デンソー	165,200	4,525.00	747,530,000	
東海理化電機製作所	19,800	1,611.00	31,897,800	
川崎重工業	58,400	1,544.00	90,169,600	
名村造船所	29,600	159.00	4,706,400	
日本車輛製造	3,400	2,721.00	9,251,400	
三菱ロジスネクスト	10,700	999.00	10,689,300	
日産自動車	887,400	416.00	369,158,400	
いすゞ自動車	218,700	1,034.50	226,245,150	
トヨタ自動車	839,000	6,955.00	5,835,245,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	93,700	687.00	64,371,900	
三菱自動車工業	278,500	262.00	72,967,000	
エフテック	8,800	499.00	4,391,200	
武蔵精密工業	17,500	1,121.00	19,617,500	
日産車体	14,800	957.00	14,163,600	
新明和工業	20,400	922.00	18,808,800	
極東開発工業	13,500	1,315.00	17,752,500	
日信工業	15,600	2,247.00	35,053,200	
トピー工業	7,200	1,180.00	8,496,000	

ティラド	4,100	1,265.00	5,186,500
曙ブレーキ工業	49,300	165.00	8,134,500
タチエス	12,800	885.00	11,328,000
N O K	40,800	1,195.00	48,756,000
フタバ産業	21,700	560.00	12,152,000
K Y B	8,300	2,179.00	18,085,700
大同メタル工業	18,300	542.00	9,918,600
プレス工業	40,500	310.00	12,555,000
太平洋工業	16,300	1,011.00	16,479,300
ケーヒン	17,300	2,595.00	44,893,500
河西工業	13,400	376.00	5,038,400
アイシン精機	61,500	3,620.00	222,630,000
マツダ	221,000	695.00	153,595,000
今仙電機製作所	10,000	681.00	6,810,000
本田技研工業	591,700	2,668.50	1,578,951,450
スズキ	149,300	4,555.00	680,061,500
S U B A R U	233,800	2,216.00	518,100,800
安永	4,500	1,049.00	4,720,500
ヤマハ発動機	105,700	1,693.00	178,950,100
ショーワ	17,700	2,295.00	40,621,500
T B K	13,100	426.00	5,580,600
エクセディ	10,200	1,407.00	14,351,400
豊田合成	24,200	2,408.00	58,273,600
愛三工業	14,600	483.00	7,051,800
日本プラスト	8,800	451.00	3,968,800
ヨロズ	8,900	1,027.00	9,140,300
エフ・シー・シー	12,300	2,064.00	25,387,200
シマノ	28,100	21,260.00	597,406,000
テイ・エス テック	17,200	3,265.00	56,158,000
ジャムコ	6,700	691.00	4,629,700
テルモ	212,900	4,295.00	914,405,500
日機装	24,300	1,093.00	26,559,900
日本エム・ディ・エム	5,200	2,131.00	11,081,200
島津製作所	89,600	3,255.00	291,648,000
J M S	8,300	885.00	7,345,500
長野計器	7,400	847.00	6,267,800
ブイ・テクノロジー	3,500	4,055.00	14,192,500
東京計器	6,400	929.00	5,945,600
インターアクション	4,600	1,769.00	8,137,400
東京精密	13,500	3,185.00	42,997,500
マニー	30,100	2,778.00	83,617,800
ニコン	114,800	759.00	87,133,200

トプコン	39,100	992.00	38,787,200
オリンパス	416,700	2,083.00	867,986,100
理研計器	6,300	2,687.00	16,928,100
タムロン	6,400	1,685.00	10,784,000
H O Y A	149,300	10,545.00	1,574,368,500
ノーリツ鋼機	5,600	1,560.00	8,736,000
エー・アンド・デイ	9,400	650.00	6,110,000
朝日インテック	85,300	3,095.00	264,003,500
シチズン時計	88,100	313.00	27,575,300
メニコン	10,600	6,540.00	69,324,000
松風	4,300	1,527.00	6,566,100
セイコーホールディングス	10,500	1,517.00	15,928,500
ニプロ	53,000	1,236.00	65,508,000
スノーピーク	6,200	1,638.00	10,155,600
パラマウントベッドホールディングス	7,700	4,240.00	32,648,000
トランザクション	6,000	1,089.00	6,534,000
ニホンフラッシュ	7,600	1,399.00	10,632,400
前田工織	8,400	2,557.00	21,478,800
永大産業	15,600	305.00	4,758,000
アートネイチャー	10,600	642.00	6,805,200
バンダイナムコホールディングス	77,800	6,680.00	519,704,000
S H O E I	6,800	3,195.00	21,726,000
フランスベッドホールディングス	12,500	873.00	10,912,500
パイロットコーポレーション	13,300	3,125.00	41,562,500
萩原工業	5,200	1,499.00	7,794,800
トッパン・フォームズ	16,000	958.00	15,328,000
フジシールインターナショナル	16,900	1,886.00	31,873,400
タカラトミー	33,300	855.00	28,471,500
廣濟堂	8,800	655.00	5,764,000
プロネクサス	7,600	1,086.00	8,253,600
大建工業	5,500	1,686.00	9,273,000
凸版印刷	104,400	1,516.00	158,270,400
大日本印刷	97,800	2,121.00	207,433,800
共同印刷	2,900	2,590.00	7,511,000
N I S S H A	15,700	1,235.00	19,389,500
T A K A R A & C O M P A N Y	4,500	2,263.00	10,183,500
アシックス	66,500	1,514.00	100,681,000
小松ウオール工業	3,100	1,780.00	5,518,000
ヤマハ	44,500	4,870.00	216,715,000
河合楽器製作所	2,800	2,702.00	7,565,600
クリナップ	9,300	510.00	4,743,000
ピジョン	48,200	4,830.00	232,806,000



オリバー	2,000	2,531.00	5,062,000
キングジム	8,200	895.00	7,339,000
リンテック	17,400	2,478.00	43,117,200
イトーキ	20,000	351.00	7,020,000
任天堂	46,100	59,030.00	2,721,283,000
三菱鉛筆	12,200	1,279.00	15,603,800
タカラスタANDARD	13,400	1,310.00	17,554,000
コクヨ	35,400	1,251.00	44,285,400
ナカバヤシ	9,900	630.00	6,237,000
グローブライド	4,000	3,215.00	12,860,000
オカムラ	25,100	738.00	18,523,800
美津濃	6,800	1,981.00	13,470,800
東京電力ホールディングス	595,100	310.00	184,481,000
中部電力	230,100	1,322.50	304,307,250
関西電力	286,100	1,041.00	297,830,100
中国電力	108,100	1,311.00	141,719,100
北陸電力	69,100	759.00	52,446,900
東北電力	185,700	1,069.00	198,513,300
四国電力	67,500	789.00	53,257,500
九州電力	153,600	953.00	146,380,800
北海道電力	71,700	447.00	32,049,900
沖縄電力	14,700	1,673.00	24,593,100
電源開発	59,500	1,642.00	97,699,000
イーレックス	11,200	1,062.00	11,894,400
レノバ	13,400	1,147.00	15,369,800
東京瓦斯	145,300	2,334.50	339,202,850
大阪瓦斯	145,100	2,036.00	295,423,600
東邦瓦斯	37,000	4,595.00	170,015,000
北海道瓦斯	5,800	1,551.00	8,995,800
広島ガス	22,700	363.00	8,240,100
西部瓦斯	8,600	2,608.00	22,428,800
静岡ガス	20,900	857.00	17,911,300
メタウォーター	3,700	4,545.00	16,816,500
SBSホールディングス	6,600	1,990.00	13,134,000
東武鉄道	78,000	3,355.00	261,690,000
相鉄ホールディングス	24,000	2,934.00	70,416,000
東急	187,800	1,447.00	271,746,600
京浜急行電鉄	95,800	1,600.00	153,280,000
小田急電鉄	110,800	2,595.00	287,526,000
京王電鉄	38,800	6,500.00	252,200,000
京成電鉄	52,200	3,100.00	161,820,000
富士急行	10,500	3,665.00	38,482,500

新京成電鉄	3,300	2,300.00	7,590,000
東日本旅客鉄道	132,400	6,959.00	921,371,600
西日本旅客鉄道	67,400	5,712.00	384,988,800
東海旅客鉄道	62,500	16,355.00	1,022,187,500
西武ホールディングス	99,400	1,280.00	127,232,000
鴻池運輸	11,600	1,098.00	12,736,800
西日本鉄道	20,700	3,085.00	63,859,500
ハマキョウレックス	5,800	3,230.00	18,734,000
サカイ引越センター	3,900	4,940.00	19,266,000
近鉄グループホールディングス	71,000	4,670.00	331,570,000
阪急阪神ホールディングス	94,800	3,495.00	331,326,000
南海電気鉄道	34,100	2,344.00	79,930,400
京阪ホールディングス	31,500	4,570.00	143,955,000
神戸電鉄	2,800	3,850.00	10,780,000
名古屋鉄道	57,900	2,982.00	172,657,800
山陽電気鉄道	6,000	2,091.00	12,546,000
日本通運	24,600	6,220.00	153,012,000
ヤマトホールディングス	125,000	2,636.00	329,500,000
山九	19,800	4,420.00	87,516,000
丸全昭和運輸	5,900	3,230.00	19,057,000
センコーグループホールディングス	38,600	959.00	37,017,400
トナミホールディングス	1,900	5,830.00	11,077,000
ニッコンホールディングス	25,500	2,260.00	57,630,000
福山通運	9,000	5,100.00	45,900,000
セイノーホールディングス	52,900	1,580.00	83,582,000
神奈川中央交通	2,300	4,130.00	9,499,000
日立物流	13,000	3,620.00	47,060,000
丸和運輸機関	7,500	3,830.00	28,725,000
C & F ロジホールディングス	8,200	1,574.00	12,906,800
九州旅客鉄道	62,700	2,347.00	147,156,900
S Gホールディングス	74,800	4,615.00	345,202,000
日本郵船	60,800	1,870.00	113,696,000
商船三井	46,100	2,300.00	106,030,000
川崎汽船	14,300	1,307.00	18,690,100
N S ユナイテッド海運	5,500	1,508.00	8,294,000
飯野海運	39,100	377.00	14,740,700
乾汽船	8,100	826.00	6,690,600
日本航空	126,300	2,219.00	280,259,700
A N A ホールディングス	130,600	2,785.00	363,721,000
トランコム	2,100	7,160.00	15,036,000
日新	6,700	1,532.00	10,264,400
三菱倉庫	22,500	3,155.00	70,987,500

三井倉庫ホールディングス	8,700	1,806.00	15,712,200
住友倉庫	25,400	1,342.00	34,086,800
澁澤倉庫	4,900	2,010.00	9,849,000
東陽倉庫	20,900	330.00	6,897,000
日本トランスシティ	18,500	527.00	9,749,500
川西倉庫	4,000	1,120.00	4,480,000
安田倉庫	8,000	957.00	7,656,000
東洋埠頭	4,900	1,433.00	7,021,700
上組	38,500	2,118.00	81,543,000
近鉄エクスプレス	14,900	2,096.00	31,230,400
エーアイティー	8,200	1,016.00	8,331,200
日本コンセプト	4,500	1,398.00	6,291,000
N E C ネットエスアイ	20,900	1,891.00	39,521,900
システナ	26,300	1,786.00	46,971,800
デジタルアーツ	3,800	7,600.00	28,880,000
日鉄ソリューションズ	11,000	3,005.00	33,055,000
キューブシステム	7,700	1,242.00	9,563,400
コア	4,100	1,328.00	5,444,800
ソリトンシステムズ	4,500	1,734.00	7,803,000
ソフトクリエイティブホールディングス	4,100	2,617.00	10,729,700
T I S	74,100	2,068.00	153,238,800
電算システム	3,800	3,435.00	13,053,000
グリー	46,400	456.00	21,158,400
コーエーテクモホールディングス	15,100	4,270.00	64,477,000
三菱総合研究所	3,300	4,130.00	13,629,000
ファインデックス	8,200	1,254.00	10,282,800
ブレインパッド	2,100	3,965.00	8,326,500
K L a b	15,700	915.00	14,365,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,600	903.00	9,571,800
ネクソン	186,300	2,604.00	485,125,200
エムアップホールディングス	2,500	3,330.00	8,325,000
エイチーム	7,800	976.00	7,612,800
エニグモ	7,700	1,610.00	12,397,000
コロプラ	24,900	939.00	23,381,100
ブロードリーフ	38,700	507.00	19,620,900
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,011.00	6,167,100
システム情報	6,300	1,215.00	7,654,500
メディアドゥ	2,800	7,090.00	19,852,000
じげん	23,900	348.00	8,317,200
ブイキューブ	5,400	1,559.00	8,418,600
ディー・エル・イー	6,100	461.00	2,812,100
フィックスターズ	9,300	1,030.00	9,579,000

CARTA HOLDINGS	5,300	1,166.00	6,179,800
オブティム	4,300	2,870.00	12,341,000
セレス	4,000	1,935.00	7,740,000
SHIFT	3,000	12,320.00	36,960,000
ティーガイア	6,500	2,041.00	13,266,500
セック	1,600	3,050.00	4,880,000
テクマトリックス	10,600	2,093.00	22,185,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,300	2,191.00	40,095,300
GMOペイメントゲートウェイ	15,700	10,540.00	165,478,000
システムリサーチ	2,900	1,685.00	4,886,500
インターネットイニシアティブ	11,200	4,190.00	46,928,000
さくらインターネット	11,200	678.00	7,593,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,700	8,020.00	13,634,000
SRAホールディングス	4,800	2,356.00	11,308,800
eBASE	9,800	1,183.00	11,593,400
アバント	7,800	974.00	7,597,200
アドソル日進	3,400	2,465.00	8,381,000
フリービット	6,200	870.00	5,394,000
コムチュア	8,400	2,505.00	21,042,000
アステリア	8,900	709.00	6,310,100
アイル	4,600	1,282.00	5,897,200
マークラインズ	4,800	2,048.00	9,830,400
メディカル・データ・ビジョン	8,900	1,777.00	15,815,300
gumi	10,900	1,051.00	11,455,900
モバイルファクトリー	2,800	1,215.00	3,402,000
テラスカイ	3,100	4,305.00	13,345,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,600	1,240.00	5,704,000
ダブルスタンダード	1,300	4,380.00	5,694,000
オープンドア	5,300	1,475.00	7,817,500
アカツキ	2,800	4,120.00	11,536,000
Ubicomホールディングス	2,600	1,861.00	4,838,600
LINE	22,300	5,380.00	119,974,000
カナミックネットワーク	8,100	751.00	6,083,100
チェンジ	5,200	8,710.00	45,292,000
オークネット	6,400	1,255.00	8,032,000
AOI TYO Holdings	11,200	419.00	4,692,800
マクロミル	17,100	804.00	13,748,400
オロ	2,800	3,130.00	8,764,000
サインポスト	2,300	1,283.00	2,950,900
ソルクシーズ	4,700	929.00	4,366,300
プロトコーポレーション	8,400	1,225.00	10,290,000
野村総合研究所	104,700	2,811.00	294,311,700

サイバネットシステム	8,000	818.00	6,544,000
インテージホールディングス	11,100	906.00	10,056,600
ソースネクスト	39,300	288.00	11,318,400
インフォコム	8,100	3,705.00	30,010,500
HEROZ	1,200	3,625.00	4,350,000
ラクスル	6,300	3,595.00	22,648,500
アルテリア・ネットワークス	9,000	1,814.00	16,326,000
フォーカスシステムズ	7,100	875.00	6,212,500
クレスコ	5,900	1,257.00	7,416,300
フジ・メディア・ホールディングス	70,800	1,045.00	73,986,000
オービック	25,500	18,190.00	463,845,000
ジャストシステム	11,900	7,040.00	83,776,000
TDCソフト	7,400	935.00	6,919,000
Zホールディングス	1,014,200	634.00	643,002,800
トレンドマイクロ	39,500	6,390.00	252,405,000
IDホールディングス	3,900	1,384.00	5,397,600
日本オラクル	15,000	11,860.00	177,900,000
アルファシステムズ	2,700	3,705.00	10,003,500
フューチャー	9,100	1,977.00	17,990,700
CAC Holdings	6,100	1,311.00	7,997,100
S Bテクノロジー	3,000	3,110.00	9,330,000
オービックビジネスコンサルタント	7,500	5,800.00	43,500,000
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,860.00	129,696,000
アイティフォー	10,900	812.00	8,850,800
大塚商会	39,900	5,130.00	204,687,000
サイボウズ	8,900	3,025.00	26,922,500
電通国際情報サービス	4,500	5,650.00	25,425,000
ACCESS	9,000	927.00	8,343,000
デジタルガレージ	13,800	3,275.00	45,195,000
EMシステムズ	12,200	845.00	10,309,000
ウェザーニューズ	3,100	5,240.00	16,244,000
CIJ	7,500	854.00	6,405,000
WOWOW	3,800	2,794.00	10,617,200
スカラ	8,400	755.00	6,342,000
IMAGICA GROUP	10,100	397.00	4,009,700
ネットワンシステムズ	28,300	4,190.00	118,577,000
アルゴグラフィックス	6,200	3,420.00	21,204,000
マーベラス	14,900	776.00	11,562,400
エイベックス	13,500	989.00	13,351,500
日本ユニシス	23,400	3,050.00	71,370,000
兼松エレクトロニクス	4,000	4,005.00	16,020,000
東京放送ホールディングス	44,900	1,799.00	80,775,100

日本テレビホールディングス	61,300	1,215.00	74,479,500
朝日放送グループホールディングス	10,600	711.00	7,536,600
テレビ朝日ホールディングス	20,600	1,658.00	34,154,800
スカパーJ S A Tホールディングス	49,200	456.00	22,435,200
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,317.00	14,133,700
ビジョン	10,800	862.00	9,309,600
USEN - N E X T H O L D I N G S	3,800	1,173.00	4,457,400
コネクシオ	5,000	1,245.00	6,225,000
日本通信	39,500	229.00	9,045,500
日本電信電話	985,900	2,358.00	2,324,752,200
K D D I	538,200	2,949.00	1,587,151,800
ソフトバンク	671,000	1,314.50	882,029,500
光通信	7,600	23,950.00	182,020,000
N T T ドコモ	527,200	2,845.50	1,500,147,600
エムティーアイ	10,300	699.00	7,199,700
G M O インターネット	26,800	2,668.00	71,502,400
K A D O K A W A	20,100	2,431.00	48,863,100
学研ホールディングス	10,100	1,552.00	15,675,200
ゼンリン	15,300	1,150.00	17,595,000
アイネット	5,200	1,565.00	8,138,000
松竹	4,900	14,870.00	72,863,000
東宝	43,600	4,165.00	181,594,000
東映	2,700	16,840.00	45,468,000
エヌ・ティ・ティ・データ	195,800	1,247.00	244,162,600
ピー・シー・エー	1,600	4,620.00	7,392,000
D T S	16,200	2,197.00	35,591,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,600	6,770.00	213,932,000
シーイーシー	8,200	1,543.00	12,652,600
カブコン	35,000	5,380.00	188,300,000
ジャステック	6,400	1,313.00	8,403,200
S C S K	17,200	5,560.00	95,632,000
日本システムウエア	3,100	1,914.00	5,933,400
アイネス	8,700	1,478.00	12,858,600
T K C	6,100	5,930.00	36,173,000
富士ソフト	9,200	4,680.00	43,056,000
N S D	23,800	1,820.00	43,316,000
コナミホールディングス	27,000	4,480.00	120,960,000
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,766.00	9,957,600
J B C C ホールディングス	6,200	1,647.00	10,211,400
ミロク情報サービス	7,000	2,116.00	14,812,000
ソフトバンクグループ	585,400	5,800.00	3,395,320,000
伊藤忠食品	2,100	5,490.00	11,529,000

エレマテック	8,600	928.00	7,980,800
JALUX	3,500	1,593.00	5,575,500
あらた	5,800	5,020.00	29,116,000
東京エレクトロン デバイス	3,400	2,924.00	9,941,600
フィールズ	11,100	339.00	3,762,900
双日	406,500	246.00	99,999,000
アルフレッサ ホールディングス	82,300	2,206.00	181,553,800
横浜冷凍	19,800	908.00	17,978,400
アルコニックス	8,700	1,532.00	13,328,400
神戸物産	25,500	5,800.00	147,900,000
あい ホールディングス	11,200	1,835.00	20,552,000
ダイワボウホールディングス	6,300	6,290.00	39,627,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,800	1,883.00	33,517,400
ラクト・ジャパン	3,500	3,570.00	12,495,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,087.00	15,218,000
八洲電機	8,800	999.00	8,791,200
レスターホールディングス	7,800	2,106.00	16,426,800
ジューテックホールディングス	3,200	996.00	3,187,200
TOKAIホールディングス	38,100	1,014.00	38,633,400
三洋貿易	8,900	1,013.00	9,015,700
ウイン・パートナーズ	6,500	964.00	6,266,000
シップヘルスケアホールディングス	12,000	4,970.00	59,640,000
コメダホールディングス	17,200	1,885.00	32,422,000
小野建	7,500	1,136.00	8,520,000
佐島電機	7,600	835.00	6,346,000
伯東	5,700	1,134.00	6,463,800
コンドーテック	7,700	1,225.00	9,432,500
ナガイレーベン	10,100	2,660.00	26,866,000
三菱食品	7,500	2,755.00	20,662,500
松田産業	6,500	1,496.00	9,724,000
第一興商	11,600	3,420.00	39,672,000
メディバルホールディングス	79,300	2,081.00	165,023,300
S P K	5,400	1,332.00	7,192,800
萩原電気ホールディングス	3,700	2,107.00	7,795,900
アズワン	4,800	14,080.00	67,584,000
尾家産業	3,600	1,480.00	5,328,000
シモジマ	6,100	1,267.00	7,728,700
ドウシシャ	7,700	2,036.00	15,677,200
高速	5,600	1,512.00	8,467,200
ハピネット	7,300	1,320.00	9,636,000
日本ライフライン	21,900	1,404.00	30,747,600
マルカ	3,800	1,983.00	7,535,400

I D O M	22,600	557.00	12,588,200
進和	5,500	2,130.00	11,715,000
ダイترون	4,300	1,496.00	6,432,800
シークス	11,500	1,070.00	12,305,000
オーハシテクニカ	5,700	1,413.00	8,054,100
伊藤忠商事	517,500	2,766.00	1,431,405,000
丸紅	771,800	656.80	506,918,240
長瀬産業	40,800	1,421.00	57,976,800
蝶理	5,400	1,583.00	8,548,200
豊田通商	82,000	3,240.00	265,680,000
三共生興	16,400	404.00	6,625,600
兼松	27,100	1,337.00	36,232,700
三井物産	640,700	1,940.00	1,242,958,000
日本紙パルプ商事	4,300	3,670.00	15,781,000
カメイ	9,900	1,043.00	10,325,700
スターゼン	3,100	4,010.00	12,431,000
山善	27,200	1,007.00	27,390,400
椿本興業	1,900	3,215.00	6,108,500
住友商事	467,400	1,339.00	625,848,600
内田洋行	3,100	5,160.00	15,996,000
三菱商事	485,300	2,568.50	1,246,493,050
第一実業	3,800	3,630.00	13,794,000
キャノンマーケティングジャパン	18,400	1,908.00	35,107,200
西華産業	6,200	1,339.00	8,301,800
佐藤商事	7,700	928.00	7,145,600
菱洋エレクトロ	7,800	2,703.00	21,083,400
東京産業	10,500	523.00	5,491,500
ユアサ商事	6,600	3,220.00	21,252,000
神鋼商事	2,700	1,750.00	4,725,000
阪和興業	13,900	2,295.00	31,900,500
正栄食品工業	4,800	4,430.00	21,264,000
カナデン	7,400	1,437.00	10,633,800
菱電商事	6,500	1,444.00	9,386,000
フルサト工業	5,000	1,354.00	6,770,000
岩谷産業	16,700	4,100.00	68,470,000
極東貿易	3,300	1,350.00	4,455,000
イワキ	12,900	489.00	6,308,100
三愛石油	18,000	967.00	17,406,000
稲畑産業	15,100	1,320.00	19,932,000
明和産業	10,000	497.00	4,970,000
ヤマエ久野	6,800	1,185.00	8,058,000
ワキタ	16,200	955.00	15,471,000



東邦ホールディングス	23,800	2,216.00	52,740,800
サンゲツ	21,200	1,618.00	34,301,600
ミツウロコグループホールディングス	11,000	1,230.00	13,530,000
シナネンホールディングス	3,800	3,250.00	12,350,000
伊藤忠エネクス	15,700	971.00	15,244,700
サンリオ	22,000	1,904.00	41,888,000
サンワテクノス	7,000	853.00	5,971,000
リョーサン	8,000	2,003.00	16,024,000
新光商事	13,800	847.00	11,688,600
トーホー	5,100	1,911.00	9,746,100
三信電気	5,400	1,855.00	10,017,000
東陽テクニカ	10,400	963.00	10,015,200
モスフードサービス	9,900	2,945.00	29,155,500
加賀電子	7,600	2,190.00	16,644,000
ソーダニッカ	12,000	536.00	6,432,000
立花エレテック	6,000	1,724.00	10,344,000
PALTAC	12,000	5,820.00	69,840,000
太平洋興発	7,500	615.00	4,612,500
西本Wismettacホールディングス	2,800	1,900.00	5,320,000
国際紙パルプ商事	24,700	276.00	6,817,200
ヤマタネ	6,500	1,267.00	8,235,500
日鉄物産	4,600	3,220.00	14,812,000
泉州電業	3,100	2,950.00	9,145,000
トラスコ中山	16,700	2,437.00	40,697,900
オートバックスセブン	28,700	1,391.00	39,921,700
モリト	9,700	611.00	5,926,700
加藤産業	10,200	3,630.00	37,026,000
イノテック	6,000	1,015.00	6,090,000
イエローハット	13,900	1,719.00	23,894,100
J Kホールディングス	8,700	728.00	6,333,600
日伝	6,800	2,164.00	14,715,200
杉本商事	4,900	1,814.00	8,888,600
因幡電機産業	20,500	2,588.00	53,054,000
東テク	3,100	2,368.00	7,340,800
ミスミグループ本社	92,700	2,919.00	270,591,300
タキヒヨー	4,000	1,803.00	7,212,000
スズケン	31,500	4,085.00	128,677,500
ジェコス	7,200	924.00	6,652,800
ローソン	18,900	5,170.00	97,713,000
サンエー	5,800	4,335.00	25,143,000
カワチ薬品	5,700	2,783.00	15,863,100
エービーシー・マート	11,500	5,300.00	60,950,000

アスクル	8,000	3,550.00	28,400,000
ゲオホールディングス	13,300	1,677.00	22,304,100
アダストリア	10,600	1,660.00	17,596,000
くら寿司	4,400	5,110.00	22,484,000
キャンドウ	5,000	2,138.00	10,690,000
パルグループホールディングス	8,700	1,121.00	9,752,700
エディオン	32,500	1,085.00	35,262,500
サーラコーポレーション	16,400	567.00	9,298,800
ハローズ	3,000	4,015.00	12,045,000
フジオフードグループ本社	7,700	1,401.00	10,787,700
あみやき亭	2,300	3,010.00	6,923,000
ひらまつ	26,900	219.00	5,891,100
大黒天物産	2,200	5,370.00	11,814,000
ハニーズホールディングス	7,500	1,016.00	7,620,000
アルペン	6,700	1,859.00	12,455,300
クオールホールディングス	11,900	1,184.00	14,089,600
ジinzホールディングス	4,000	7,840.00	31,360,000
ビックカメラ	43,300	1,098.00	47,543,400
D C Mホールディングス	41,700	1,248.00	52,041,600
Monotaro	52,900	4,320.00	228,528,000
アークランドサービスホールディングス	6,500	2,080.00	13,520,000
J . フロント リテイリング	89,000	731.00	65,059,000
ドトール・日レスホールディングス	10,000	1,674.00	16,740,000
マツモトキヨシホールディングス	30,400	3,625.00	110,200,000
ブロンコビリー	4,300	2,311.00	9,937,300
Z O Z O	51,300	2,785.00	142,870,500
物語コーポレーション	2,000	10,030.00	20,060,000
ココカラファイン	7,600	6,460.00	49,096,000
三越伊勢丹ホールディングス	129,300	572.00	73,959,600
Hamee	3,600	2,466.00	8,877,600
ウエルシアホールディングス	44,000	4,235.00	186,340,000
クリエイトSDホールディングス	12,200	3,615.00	44,103,000
チムニー	3,500	1,516.00	5,306,000
シュッピン	7,600	883.00	6,710,800
オイシックス・ラ・大地	7,600	3,145.00	23,902,000
ネクステージ	12,800	1,044.00	13,363,200
ジョイフル本田	21,100	1,437.00	30,320,700
鳥貴族	3,400	1,531.00	5,205,400
麒麟堂ホールディングス	3,600	3,015.00	10,854,000
ホットランド	7,500	1,201.00	9,007,500
すかいらーくホールディングス	83,500	1,684.00	140,614,000
S F Pホールディングス	5,400	1,465.00	7,911,000

綿半ホールディングス	3,400	2,810.00	9,554,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,600	1,174.00	24,184,400
B E E N O S	4,300	1,757.00	7,555,100
あさひ	5,800	1,720.00	9,976,000
日本調剤	5,400	1,593.00	8,602,200
コスモス薬品	6,500	17,700.00	115,050,000
セブン&アイ・ホールディングス	289,800	3,350.00	970,830,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,800	676.00	27,580,800
ツルハホールディングス	16,100	14,100.00	227,010,000
サンマルクホールディングス	6,300	1,654.00	10,420,200
トリドールホールディングス	18,800	1,477.00	27,767,600
T O K Y O B A S E	9,800	364.00	3,567,200
J Mホールディングス	5,700	3,205.00	18,268,500
パロックジャパンリミテッド	8,400	607.00	5,098,800
クスリのアオキホールディングス	6,700	8,900.00	59,630,000
力の源ホールディングス	4,500	698.00	3,141,000
スシローグローバルホールディングス	40,700	2,616.00	106,471,200
メディカルシステムネットワーク	11,300	475.00	5,367,500
ノジマ	13,000	2,859.00	37,167,000
カッパ・クリエイト	11,000	1,587.00	17,457,000
良品計画	98,700	1,730.00	170,751,000
アドヴァン	11,500	1,301.00	14,961,500
アルビス	3,600	2,658.00	9,568,800
コナカ	18,700	294.00	5,497,800
G - 7ホールディングス	4,500	2,814.00	12,663,000
イオン北海道	12,100	800.00	9,680,000
コジマ	16,100	542.00	8,726,200
コーナン商事	10,400	3,685.00	38,324,000
エコス	3,200	2,071.00	6,627,200
ワタミ	10,100	1,117.00	11,281,700
パン・パシフィック・インターナショナルホ	162,900	2,316.00	377,276,400
西松屋チェーン	16,600	1,247.00	20,700,200
ゼンショーホールディングス	35,700	2,555.00	91,213,500
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,742.00	10,626,200
サイゼリヤ	11,000	2,076.00	22,836,000
V Tホールディングス	33,200	375.00	12,450,000
フジ・コーポレーション	3,000	2,228.00	6,684,000
ユナイテッドアローズ	8,200	1,565.00	12,833,000
ハイデイ日高	10,100	1,836.00	18,543,600
コロワイド	22,000	1,847.00	40,634,000
ピーシーデポコーポレーション	13,100	626.00	8,200,600

壱番屋	5,100	5,550.00	28,305,000
スギホールディングス	14,800	7,420.00	109,816,000
薬王堂ホールディングス	3,600	2,482.00	8,935,200
スクロール	15,800	918.00	14,504,400
ヨンドシーホールディングス	8,100	1,809.00	14,652,900
ファミリーマート	58,700	2,345.00	137,651,500
木曽路	9,100	2,540.00	23,114,000
S R S ホールディングス	12,000	989.00	11,868,000
千趣会	17,800	370.00	6,586,000
リテールパートナーズ	10,200	1,745.00	17,799,000
ケーヨー	19,400	808.00	15,675,200
上新電機	8,300	2,313.00	19,197,900
日本瓦斯	11,900	4,385.00	52,181,500
ロイヤルホールディングス	12,900	1,907.00	24,600,300
いなげや	9,100	1,841.00	16,753,100
島忠	13,900	2,746.00	38,169,400
チヨダ	9,600	952.00	9,139,200
ライフコーポレーション	5,700	4,430.00	25,251,000
リンガーハット	9,300	2,568.00	23,882,400
MrMaxHD	12,500	770.00	9,625,000
AOKIホールディングス	17,200	574.00	9,872,800
オークワ	11,600	1,317.00	15,277,200
コメリ	11,400	3,085.00	35,169,000
青山商事	18,900	602.00	11,377,800
しまむら	8,500	8,530.00	72,505,000
高島屋	54,600	853.00	46,573,800
松屋	17,100	665.00	11,371,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,100	714.00	25,061,400
近鉄百貨店	3,000	3,015.00	9,045,000
丸井グループ	68,300	1,930.00	131,819,000
アクシアル リテイリング	6,000	4,590.00	27,540,000
イオン	284,800	2,677.50	762,552,000
イズミ	15,200	3,825.00	58,140,000
平和堂	14,500	2,146.00	31,117,000
フジ	8,600	1,805.00	15,523,000
ヤオコー	8,200	7,800.00	63,960,000
ゼビオホールディングス	9,800	756.00	7,408,800
ケーズホールディングス	71,000	1,427.00	101,317,000
Olympicグループ	6,800	885.00	6,018,000
日産東京販売ホールディングス	18,400	253.00	4,655,200
Genky DrugStores	3,700	3,585.00	13,264,500
ブックオフグループホールディングス	5,900	940.00	5,546,000

アインホールディングス	9,300	6,730.00	62,589,000
元気寿司	2,600	2,510.00	6,526,000
ヤマダ電機	224,700	553.00	124,259,100
アークランドサカモト	11,800	2,000.00	23,600,000
ニトリホールディングス	32,100	20,965.00	672,976,500
グルメ杵屋	8,400	1,098.00	9,223,200
吉野家ホールディングス	25,100	2,106.00	52,860,600
松屋フーズホールディングス	3,500	3,640.00	12,740,000
サガミホールディングス	10,600	1,430.00	15,158,000
関西スーパーマーケット	6,900	1,283.00	8,852,700
王将フードサービス	5,200	6,080.00	31,616,000
プレナス	8,200	1,782.00	14,612,400
ミニストップ	6,500	1,490.00	9,685,000
アークス	14,800	2,531.00	37,458,800
パローホールディングス	15,900	2,640.00	41,976,000
ベルク	3,700	6,900.00	25,530,000
大庄	5,400	1,243.00	6,712,200
ファーストリテイリング	9,900	66,420.00	657,558,000
サンドラッグ	27,900	3,870.00	107,973,000
サックスパー ホールディングス	9,200	540.00	4,968,000
ベルーナ	17,200	907.00	15,600,400
じもとホールディングス	64,400	114.00	7,341,600
めぶきフィナンシャルグループ	379,900	256.00	97,254,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,600	1,200.00	12,720,000
九州フィナンシャルグループ	160,500	482.00	77,361,000
ゆうちょ銀行	208,700	844.00	176,142,800
富山第一銀行	23,100	302.00	6,976,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	420,100	375.00	157,537,500
西日本フィナンシャルホールディングス	51,100	714.00	36,485,400
関西みらいフィナンシャルグループ	44,500	458.00	20,381,000
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,358.00	9,098,600
第四北越フィナンシャルグループ	12,900	2,106.00	27,167,400
新生銀行	54,100	1,469.00	79,472,900
あおぞら銀行	44,400	1,868.00	82,939,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,072,800	437.40	2,218,842,720
りそなホールディングス	802,100	389.60	312,498,160
三井住友トラスト・ホールディングス	140,000	3,063.00	428,820,000
三井住友フィナンシャルグループ	512,700	3,090.00	1,584,243,000
千葉銀行	245,400	602.00	147,730,800
群馬銀行	141,600	355.00	50,268,000
武蔵野銀行	11,200	1,651.00	18,491,200
千葉興業銀行	20,200	252.00	5,090,400

筑波銀行	38,800	197.00	7,643,600
七十七銀行	25,000	1,574.00	39,350,000
青森銀行	5,600	2,381.00	13,333,600
秋田銀行	5,800	1,579.00	9,158,200
山形銀行	8,700	1,298.00	11,292,600
岩手銀行	5,400	2,442.00	13,186,800
東邦銀行	70,600	224.00	15,814,400
東北銀行	4,000	1,017.00	4,068,000
みちのく銀行	5,500	1,189.00	6,539,500
ふくおかフィナンシャルグループ	62,000	1,882.00	116,684,000
静岡銀行	178,700	765.00	136,705,500
十六銀行	9,300	1,945.00	18,088,500
スルガ銀行	77,400	393.00	30,418,200
八十二銀行	177,200	415.00	73,538,000
山梨中央銀行	9,200	835.00	7,682,000
大垣共立銀行	14,600	2,202.00	32,149,200
福井銀行	6,900	1,663.00	11,474,700
北國銀行	7,800	3,015.00	23,517,000
清水銀行	4,300	1,761.00	7,572,300
富山銀行	1,900	2,490.00	4,731,000
滋賀銀行	14,700	2,494.00	36,661,800
南都銀行	12,200	1,908.00	23,277,600
百五銀行	66,300	319.00	21,149,700
京都銀行	26,300	4,930.00	129,659,000
紀陽銀行	26,200	1,537.00	40,269,400
ほくほくフィナンシャルグループ	48,300	1,021.00	49,314,300
広島銀行	106,600	557.00	59,376,200
山陰合同銀行	44,200	564.00	24,928,800
中国銀行	62,900	971.00	61,075,900
伊予銀行	103,800	685.00	71,103,000
百十四銀行	7,900	1,782.00	14,077,800
四国銀行	12,500	756.00	9,450,000
阿波銀行	11,800	2,402.00	28,343,600
大分銀行	4,800	2,408.00	11,558,400
宮崎銀行	5,300	2,321.00	12,301,300
佐賀銀行	5,700	1,382.00	7,877,400
沖縄銀行	7,100	2,922.00	20,746,200
琉球銀行	19,100	882.00	16,846,200
セブン銀行	249,400	262.00	65,342,800
みずほフィナンシャルグループ	10,073,900	141.10	1,421,427,290
山口フィナンシャルグループ	92,200	704.00	64,908,800
名古屋銀行	5,900	2,348.00	13,853,200

北洋銀行	114,400	229.00	26,197,600
愛知銀行	3,100	3,250.00	10,075,000
中京銀行	3,900	2,016.00	7,862,400
大光銀行	2,500	1,298.00	3,245,000
愛媛銀行	11,300	1,158.00	13,085,400
京葉銀行	31,900	492.00	15,694,800
栃木銀行	40,100	187.00	7,498,700
北日本銀行	2,700	1,754.00	4,735,800
東和銀行	14,200	721.00	10,238,200
トモニホールディングス	58,500	340.00	19,890,000
フィデアホールディングス	75,000	113.00	8,475,000
池田泉州ホールディングス	94,800	173.00	16,400,400
F P G	25,100	625.00	15,687,500
S B I ホールディングス	81,800	2,685.00	219,633,000
ジャフコ	11,700	4,245.00	49,666,500
大和証券グループ本社	592,000	465.20	275,398,400
野村ホールディングス	1,302,200	539.80	702,927,560
岡三証券グループ	65,600	344.00	22,566,400
丸三証券	27,100	423.00	11,463,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,500	273.00	24,160,500
水戸証券	26,500	201.00	5,326,500
いちよし証券	16,300	451.00	7,351,300
松井証券	42,900	948.00	40,669,200
マネックスグループ	56,300	266.00	14,975,800
極東証券	13,900	588.00	8,173,200
岩井コスモホールディングス	8,000	1,259.00	10,072,000
藍澤證券	14,500	694.00	10,063,000
スパークス・グループ	40,800	201.00	8,200,800
かんぽ生命保険	27,000	1,696.00	45,792,000
S O M P O ホールディングス	139,200	3,903.00	543,297,600
アニコム ホールディングス	6,600	4,275.00	28,215,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	193,400	2,972.50	574,881,500
第一生命ホールディングス	418,700	1,562.00	654,009,400
東京海上ホールディングス	262,000	4,932.00	1,292,184,000
T & D ホールディングス	220,800	1,128.00	249,062,400
アドバンスクリエイト	3,000	2,290.00	6,870,000
全国保証	21,300	4,020.00	85,626,000
日本モーゲージサービス	4,600	1,022.00	4,701,200
C a s a	3,000	1,203.00	3,609,000
アルヒ	12,700	1,622.00	20,599,400
プレミアグループ	4,900	1,950.00	9,555,000
クレディセゾン	51,500	1,209.00	62,263,500

芙蓉総合リース	7,600	6,800.00	51,680,000
みずほリース	11,300	2,706.00	30,577,800
東京センチュリー	14,800	5,770.00	85,396,000
日本証券金融	34,700	541.00	18,772,700
アイフル	116,900	257.00	30,043,300
リコーリース	6,200	2,753.00	17,068,600
イオンフィナンシャルサービス	45,000	963.00	43,335,000
アコム	147,700	420.00	62,034,000
ジャックス	8,500	1,748.00	14,858,000
オリエントコーポレーション	203,500	118.00	24,013,000
日立キャピタル	17,400	2,599.00	45,222,600
アプラスフィナンシャル	55,500	76.00	4,218,000
オリックス	459,500	1,372.00	630,434,000
三菱UFJリース	185,000	527.00	97,495,000
日本取引所グループ	212,900	2,914.00	620,390,600
イー・ギャランティ	8,800	2,205.00	19,404,000
NECキャピタルソリューション	3,300	1,895.00	6,253,500
いちご	96,300	303.00	29,178,900
日本駐車場開発	99,200	131.00	12,995,200
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,281.00	6,148,800
ヒューリック	156,600	984.00	154,094,400
三栄建築設計	3,800	1,426.00	5,418,800
野村不動産ホールディングス	45,200	2,127.00	96,140,400
三重交通グループホールディングス	19,400	452.00	8,768,800
サムティ	10,300	1,470.00	15,141,000
ディア・ライフ	14,300	578.00	8,265,400
日本商業開発	6,100	1,668.00	10,174,800
プレサンスコーポレーション	13,100	1,387.00	18,169,700
日本管理センター	7,000	1,220.00	8,540,000
フージャースホールディングス	17,600	657.00	11,563,200
オープンハウス	23,400	3,615.00	84,591,000
東急不動産ホールディングス	199,600	484.00	96,606,400
飯田グループホールディングス	60,900	2,101.00	127,950,900
ムゲンエステート	10,200	481.00	4,906,200
ビーロッド	5,700	692.00	3,944,400
ハウスドゥ	4,700	1,102.00	5,179,400
ジェイ・エス・ビー	2,400	2,914.00	6,993,600
パーク24	39,900	1,816.00	72,458,400
バラカ	3,100	1,760.00	5,456,000
三井不動産	365,500	1,977.00	722,593,500
三菱地所	519,300	1,652.00	857,883,600
平和不動産	13,600	2,859.00	38,882,400



東京建物	76,600	1,364.00	104,482,400
ダイビル	19,500	1,140.00	22,230,000
京阪神ビルディング	13,000	1,583.00	20,579,000
住友不動産	166,500	3,147.00	523,975,500
テオオーシー	17,100	687.00	11,747,700
東京楽天地	1,700	4,190.00	7,123,000
スターツコーポレーション	10,300	2,327.00	23,968,100
フジ住宅	11,800	524.00	6,183,200
空港施設	13,300	439.00	5,838,700
ゴールドクレスト	6,900	1,436.00	9,908,400
エスリード	4,000	1,317.00	5,268,000
日神グループホールディングス	14,500	392.00	5,684,000
日本エスコン	15,700	807.00	12,669,900
タカラレーベン	36,400	349.00	12,703,600
A V A N T I A	7,000	773.00	5,411,000
イオンモール	36,700	1,455.00	53,398,500
ファースト住建	4,800	1,014.00	4,867,200
カチタス	18,400	2,769.00	50,949,600
トーセイ	11,600	1,000.00	11,600,000
サンフロンティア不動産	12,400	851.00	10,552,400
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	825.00	6,270,000
ランドビジネス	11,600	366.00	4,245,600
日本空港ビルデング	23,800	4,890.00	116,382,000
日本工営	4,900	2,845.00	13,940,500
L I F U L L	28,500	471.00	13,423,500
ミクシィ	13,700	2,580.00	35,346,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	1,319.00	7,650,200
日本M&Aセンター	55,100	5,090.00	280,459,000
メンバーズ	2,800	1,641.00	4,594,800
UTグループ	11,500	3,355.00	38,582,500
アイティメディア	3,300	2,307.00	7,613,100
タケエイ	8,600	959.00	8,247,400
ビーネックスグループ	10,800	1,169.00	12,625,200
コシダカホールディングス	19,800	443.00	8,771,400
パソナグループ	8,400	1,540.00	12,936,000
リンクアンドモチベーション	18,700	388.00	7,255,600
G C A	12,100	644.00	7,792,400
エス・エム・エス	22,600	2,851.00	64,432,600
パーソルホールディングス	72,200	1,780.00	128,516,000
リニカル	5,900	799.00	4,714,100
クックパッド	30,600	362.00	11,077,200
学情	4,100	1,093.00	4,481,300

スタジオアリス	5,100	1,672.00	8,527,200
シミックホールディングス	5,100	1,360.00	6,936,000
総合警備保障	28,500	5,070.00	144,495,000
カカクコム	53,500	2,550.00	136,425,000
アイロムグループ	3,300	1,969.00	6,497,700
ルネサンス	6,200	1,004.00	6,224,800
ディップ	10,100	2,316.00	23,391,600
デジタルホールディングス	5,800	1,259.00	7,302,200
新日本科学	10,200	706.00	7,201,200
ツクイ	19,600	595.00	11,662,000
ベネフィット・ワン	26,200	2,536.00	66,443,200
エムスリー	158,400	6,220.00	985,248,000
アウトソーシング	41,700	944.00	39,364,800
ウェルネット	11,700	606.00	7,090,200
ワールドホールディングス	3,000	1,877.00	5,631,000
ディー・エヌ・エー	31,000	1,843.00	57,133,000
博報堂D Yホールディングス	99,100	1,375.00	136,262,500
ぐるなび	15,500	748.00	11,594,000
タカミヤ	12,500	526.00	6,575,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,100	1,012.00	7,185,200
ファンコミュニケーションズ	22,800	471.00	10,738,800
ライク	3,300	1,804.00	5,953,200
エスプール	19,500	765.00	14,917,500
WDBホールディングス	3,600	2,926.00	10,533,600
バリューコマース	4,900	3,235.00	15,851,500
インフォマート	79,700	769.00	61,289,300
J Pホールディングス	28,800	294.00	8,467,200
E P Sホールディングス	10,800	1,037.00	11,199,600
プレステージ・インターナショナル	27,300	924.00	25,225,200
アミューズ	4,500	2,473.00	11,128,500
ドリームインキュベータ	4,000	1,460.00	5,840,000
クイック	5,400	1,251.00	6,755,400
ケネディクス	68,300	535.00	36,540,500
電通グループ	81,000	3,040.00	246,240,000
ぴあ	2,200	3,470.00	7,634,000
イオンファンタジー	3,500	1,738.00	6,083,000
シーティーエス	9,700	995.00	9,651,500
ネクシィーズグループ	4,800	941.00	4,516,800
H . U . グループホールディングス	20,700	2,657.00	54,999,900
アルプス技研	7,000	1,884.00	13,188,000
日本空調サービス	10,000	738.00	7,380,000
オリエンタルランド	76,400	14,730.00	1,125,372,000

ダスキン	17,600	2,799.00	49,262,400
明光ネットワークジャパン	12,400	733.00	9,089,200
ファルコホールディングス	5,300	1,516.00	8,034,800
ラウンドワン	20,800	871.00	18,116,800
リゾートトラスト	33,500	1,634.00	54,739,000
ビー・エム・エル	9,200	2,913.00	26,799,600
りらいあコミュニケーションズ	13,200	1,267.00	16,724,400
リソー教育	38,600	283.00	10,923,800
ユー・エス・エス	80,000	1,828.00	146,240,000
サイバーエージェント	44,500	5,530.00	246,085,000
楽天	335,700	1,094.00	367,255,800
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,273.00	6,365,000
テー・オー・ダブリュー	17,700	320.00	5,664,000
山田コンサルティンググループ	5,600	1,111.00	6,221,600
セントラルスポーツ	3,400	2,424.00	8,241,600
フルキャストホールディングス	7,900	1,655.00	13,074,500
エン・ジャパン	12,900	3,010.00	38,829,000
テクノプロ・ホールディングス	14,600	6,140.00	89,644,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,000	12,300.00	36,900,000
K e e P e r 技研	3,100	2,808.00	8,704,800
G u n o s y	5,800	910.00	5,278,000
イー・ガーディアン	3,700	3,025.00	11,192,500
ジャパンマテリアル	22,000	1,417.00	31,174,000
ベクトル	10,300	961.00	9,898,300
チャーム・ケア・コーポレーション	6,900	1,036.00	7,148,400
I B J	7,600	1,047.00	7,957,200
アサンテ	5,000	1,540.00	7,700,000
N・フィールド	9,300	643.00	5,979,900
バリューHR	4,300	1,511.00	6,497,300
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	3,910.00	23,069,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	2,379.00	9,040,200
シグマクシス	5,500	1,516.00	8,338,000
ウィルグループ	6,300	813.00	5,121,900
リクルートホールディングス	514,700	4,146.00	2,133,946,200
エラン	5,100	2,443.00	12,459,300
日本郵政	588,100	764.90	449,837,690
ベルシステム24ホールディングス	12,500	1,679.00	20,987,500
鎌倉新書	6,400	865.00	5,536,000
L I T A L I C O	3,000	2,731.00	8,193,000
アトラエ	2,400	2,999.00	7,197,600
ストライク	2,800	4,560.00	12,768,000
ソラスト	20,100	1,300.00	26,130,000

インソース	3,500	2,654.00	9,289,000
ペイカレント・コンサルティング	4,400	11,470.00	50,468,000
グレイステクノロジー	3,500	4,210.00	14,735,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	8,100	3,615.00	29,281,500
日総工産	6,700	827.00	5,540,900
キュービーネットホールディングス	4,000	1,853.00	7,412,000
R P Aホールディングス	6,600	812.00	5,359,200
スプリックス	4,100	916.00	3,755,600
マネジメントソリューションズ	4,500	1,298.00	5,841,000
プロレド・パートナーズ	1,100	5,580.00	6,138,000
カーブスホールディングス	21,300	680.00	14,484,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	764.00	4,507,600
リログループ	39,700	2,408.00	95,597,600
東祥	5,800	1,416.00	8,212,800
エイチ・アイ・エス	11,400	2,090.00	23,826,000
共立メンテナンス	12,000	4,205.00	50,460,000
イチネンホールディングス	9,100	1,251.00	11,384,100
建設技術研究所	5,500	1,940.00	10,670,000
スペース	6,000	790.00	4,740,000
燦ホールディングス	4,500	1,111.00	4,999,500
東京テアトル	4,700	1,299.00	6,105,300
ナガワ	2,300	7,170.00	16,491,000
よみうりランド	2,100	4,030.00	8,463,000
東京都競馬	4,900	5,010.00	24,549,000
カナモト	12,800	2,353.00	30,118,400
東京ドーム	29,900	837.00	25,026,300
西尾レントオール	6,500	2,370.00	15,405,000
トランス・コスモス	7,000	2,703.00	18,921,000
乃村工藝社	31,100	769.00	23,915,900
日本管財	7,000	2,005.00	14,035,000
トーカイ	6,800	2,086.00	14,184,800
セコム	76,100	9,836.00	748,519,600
セントラル警備保障	3,700	3,385.00	12,524,500
丹青社	15,800	727.00	11,486,600
メイテック	9,000	5,400.00	48,600,000
応用地質	8,600	1,192.00	10,251,200
船井総研ホールディングス	15,000	2,276.00	34,140,000
オオバ	8,900	762.00	6,781,800
ベネッセホールディングス	24,400	2,661.00	64,928,400
イオンディライト	8,500	2,956.00	25,126,000
ナック	6,000	984.00	5,904,000
ダイセキ	12,200	2,602.00	31,744,400

合 計	87,913,600	171,265,905,610
-----	------------	-----------------

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

	(単位:円)	
	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,506,546,886	2,322,343,471
コール・ローン	123,456,493	271,687,989
株式	168,596,815,846	229,758,511,547
投資証券	4,540,908,500	5,708,432,598
派生商品評価勘定	112,492,819	77,221,722
未収入金	5,180,797	1,701,004
未収配当金	411,546,646	417,053,912
差入委託証拠金	1,121,198,738	1,721,013,258
流動資産合計	178,418,146,725	240,277,965,501
資産合計	178,418,146,725	240,277,965,501
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,819,569	49,135,763
前受金	103,060,160	27,840,759
未払金	-	31,457,561
未払解約金	92,048,569	88,109,992
未払利息	255	794
その他未払費用	14,311	7,574
流動負債合計	204,942,864	196,552,443
負債合計	204,942,864	196,552,443
純資産の部		
元本等		
元本	49,466,918,390	59,853,159,106
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	128,746,285,471	180,228,253,952
元本等合計	178,213,203,861	240,081,413,058
純資産合計	178,213,203,861	240,081,413,058
負債純資産合計	178,418,146,725	240,277,965,501

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	49,466,918,390口	59,853,159,106口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6027円 (10,000口当たりの純資産額 36,027円)	1口当たり純資産額 4.0112円 (10,000口当たりの純資産額 40,112円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
----	--------------------------------

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

## . 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「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)

(2019年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,814,636,086	-	4,917,696,246	103,060,160
	SPMINI 1909	3,494,877,063	-	3,568,084,628	73,207,565
	DJ EUR 1909	815,865,744	-	841,464,049	25,598,305
	FTSE 1909	288,046,648	-	287,839,035	207,613
	SPI200 1909	215,846,631	-	220,308,534	4,461,903
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	217,291,590	-	217,678,500	386,910
	米ドル	151,217,200	-	151,481,300	264,100
	カナダドル	5,700,700	-	5,707,800	7,100
	ユーロ	22,493,100	-	22,547,300	54,200
	英ポンド	18,552,500	-	18,571,000	18,500
	スイスフラン	1,082,400	-	1,082,600	200
	ノルウェークローネ	120,330	-	120,300	30
	デンマーククローネ	636,240	-	636,400	160



	オーストラリアドル	16,910,700	-	16,953,300	42,600
	香港ドル	274,100	-	274,000	100
	イスラエルシケル	304,320	-	304,500	180
	合計	5,031,927,676	-	5,135,374,746	102,673,250

(2020年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,643,464,237	-	4,671,304,996	27,840,759
	SPMINI 2009	3,500,347,325	-	3,521,503,693	21,156,368
	DJ EUR 2009	762,631,386	-	772,294,710	9,663,324
	FTSE 2009	206,807,372	-	207,903,543	1,096,171
	SPI200 2009	173,678,154	-	169,603,050	4,075,104
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	170,679,600	-	170,924,500	244,900
	米ドル	96,530,600	-	96,651,100	120,500
	カナダドル	8,051,400	-	8,069,000	17,600
	ユーロ	38,829,900	-	38,874,000	44,100
	英ポンド	4,120,800	-	4,138,800	18,000
	スイスフラン	11,622,800	-	11,648,000	25,200
	スウェーデンクローナ	4,967,600	-	4,977,400	9,800
	ノルウェークローネ	940,400	-	942,400	2,000
	デンマーククローネ	2,861,300	-	2,866,200	4,900
	ニュージーランドドル	708,900	-	709,000	100
	香港ドル	956,900	-	959,000	2,100
	シンガポールドル	777,000	-	776,900	100
	イスラエルシケル	312,000	-	312,700	700
売建	9,244,500	-	9,244,200	300	

英ポンド	4,139,100	-	4,138,800	300
オーストラリアドル	1,543,400	-	1,543,400	-
香港ドル	3,562,000	-	3,562,000	-
合計	4,823,388,337	-	4,851,473,696	28,085,959

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2019年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	52,668,903,258円
同期中における追加設定元本額	13,741,540,617円
同期中における一部解約元本額	16,943,525,485円

2019年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	15,911,239,515円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	324,923,476円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,289,610,420円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	844,073,259円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	81,776,697円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,262,931円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	9,053,468円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	23,995,600円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	50,062,229円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	35,803,979円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	83,929,695円
外国株式指数ファンド	524,029,710円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	4,083,860,343円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	425,075,130円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	422,770,839円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	393,371,996円
イオン・バランス戦略ファンド	23,408,517円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,155,384円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,786,847円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,067,042円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	81,659,431円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	46,255,302円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,886,041円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	16,546,398円
三井住友D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	56,291円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,585,100,603円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,590,525円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	76,749,837円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,538,560,440円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,460,709,925円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,139,461,309円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	20,735,530円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	103,934,006円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	416,205円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	739,732,943円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	60,844,158円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	171,173,908円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	770,537,138円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	637,137,232円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,547,704,635円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	807,485円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	303,220,325円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	220,743,582円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	135,085,674円

三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	85,886,577円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	23,771,920円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	13,453,501円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	6,751,404円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	45,905,122円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	110,966,595円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用>	61,127,502円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定>	934,227,203円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定>	148,739,209円
S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	6,079,631,479円
S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	291,044,596円
S M A M・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定>	1,116,346,988円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	8,696,255円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	45,189,709円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	62,375,876円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	99,546,999円
合計	49,466,918,390円

(2020年 9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	49,466,918,390円
同期中における追加設定元本額	29,160,154,060円
同期中における一部解約元本額	18,773,913,344円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	27,034,677,257円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	309,137,541円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	1,275,097,010円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	842,001,443円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	59,512,894円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	1,726,629円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	7,345,183円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	21,350,419円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	51,016,249円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	44,068,516円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	92,573,242円
外国株式指数ファンド	558,312,178円
三井住友・D C つみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	7,016,966,881円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	313,577,921円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	352,729,063円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	249,687,520円
イオン・バランス戦略ファンド	68,689,281円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	10,567,496円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	76,921,529円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,327,592円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	194,062,543円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	99,496,955円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	109,235,569円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,928,571円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	83,521,551円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	1,598,370円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	7,890,591円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	5,409,033円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,791,304円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	276,321円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,024,852,716円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	6,086,336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>	59,688,739円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,189,934,147円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,255,200,561円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,343,517,229円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	16,031,634円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	86,614,229円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	274,725円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	651,864,841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>	54,595,763円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	154,273,858円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	678,822,097円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	530,085,597円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,278,255,149円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	516,296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)	268,527,607円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	111,955,417円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	14,783,156円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,284,569円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	5,874,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	35,545,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	90,634,725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>	418,153,613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>	110,332,710円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,911,651,620円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	210,853,707円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,761,001,918円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	10,193,688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>	36,957,323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>	48,272,628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>	499,025,860円
合計	59,853,159,106円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	14.12	451,472.88	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	18.58	364,762.56	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	49.33	579,479.51	
	CHEVRON CORPORATION	99,151	80.03	7,935,054.53	
	CONCHO RESOURCES INC	10,172	48.80	496,393.60	
	CONOCOPHILLIPS	55,797	34.46	1,922,764.62	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	32.18	255,323.60	
	EOG RESOURCES INC	30,830	41.86	1,290,543.80	
	EXXON MOBIL CORPORATION	223,098	37.95	8,466,569.10	
	HALLIBURTON CO	44,317	15.06	667,414.02	
	HESS CORPORATION	15,362	46.95	721,245.90	
	KINDER MORGAN INC	112,374	13.22	1,485,584.28	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	32,824	31.77	1,042,818.48	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	25,892	11.50	297,758.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	44,207	11.07	489,371.49	
	ONEOK INC	21,837	26.48	578,243.76	
	PHILLIPS 66	22,492	57.87	1,301,612.04	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,858	96.60	855,682.80	
	SCHLUMBERGER LTD	73,444	18.61	1,366,792.84	
	VALERO ENERGY CORP	22,007	47.75	1,050,834.25	
	WILLIAMS COS INC	64,802	21.02	1,362,138.04	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,440	303.27	3,469,408.80	
	ALBEMARLE CORPORATION	4,821	95.42	460,019.82	
	AMCOR PLC	82,302	11.01	906,145.02	
	AVERY DENNISON CORP	4,832	116.35	562,203.20	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	22.63	284,911.70	
	BALL CORPORATION	16,674	81.62	1,360,931.88	
	CELANESE CORPORATION	6,420	106.44	683,344.80	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	32.33	388,024.66	
	CORTEVA INC	38,111	28.74	1,095,310.14	
	CROWN HOLDINGS INC	6,863	75.50	518,156.50	
DOW INC	37,953	49.23	1,868,426.19		
DUPONT DE NEMOURS INC	38,956	57.93	2,256,721.08		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	79.80	560,754.60		
ECOLAB INC	13,649	203.00	2,770,747.00		

FMC CORPORATION	6,676	107.91	720,407.16
FREEMPORT-MCMORAN INC	80,752	16.14	1,303,337.28
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	38.29	732,870.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	122.00	594,262.00
LINDE PLC	27,980	251.15	7,027,177.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,068	72.69	949,912.92
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	203.45	629,067.40
MOSAIC CO/THE	18,584	17.97	333,954.48
NEWMONT CORPORATION	43,268	68.17	2,949,579.56
NUCOR CORP	15,455	46.06	711,857.30
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	104.51	489,315.82
PPG INDUSTRIES INC	12,931	125.34	1,620,771.54
RPM INTERNATIONAL INC	7,621	83.25	634,448.25
SEALED AIR CORP	7,895	39.24	309,799.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,330	694.43	3,006,881.90
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	29.34	299,003.94
VULCAN MATERIALS CO	6,698	121.66	814,878.68
WESTROCK CO	13,034	32.40	422,301.60
3M COMPANY	30,542	165.70	5,060,809.40
AERCAP HOLDINGS NV	6,864	28.84	197,957.76
ALLEGION PLC	4,764	98.69	470,159.16
AMETEK INC	11,727	99.35	1,165,077.45
BOEING CO	28,369	160.78	4,561,167.82
CARRIER GLOBAL CORP	42,223	30.13	1,272,178.99
CATERPILLAR INC	28,960	152.69	4,421,902.40
CUMMINS INC	8,000	212.07	1,696,560.00
DEERE & CO	15,991	215.52	3,446,380.32
DOVER CORP	7,186	111.51	801,310.86
EATON CORP PLC	21,253	102.56	2,179,707.68
EMERSON ELECTRIC CO	30,935	68.70	2,125,234.50
FASTENAL COMPANY	29,021	45.23	1,312,619.83
FORTIVE CORP	16,958	75.66	1,283,042.28
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	8,209	82.55	677,652.95
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	146.17	1,847,881.14
GENERAL ELECTRIC CO	467,018	6.16	2,876,830.88
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	41.89	326,197.43
HEICO CORP	1,888	108.61	205,055.68
HEICO CORP-CLASS A	4,435	88.68	393,295.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,454	165.75	6,208,000.50
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	17.12	325,690.88
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	141.35	297,824.45
IDEX CORP	3,839	179.69	689,829.91

ILLINOIS TOOL WORKS	16,690	195.14	3,256,886.60
INGERSOLL-RAND INC	16,918	35.42	599,235.56
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	92.80	642,825.60
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	39.76	457,240.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,600	19.66	208,396.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,974	41.21	1,688,538.54
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,698	180.84	2,115,466.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,056	273.42	562,151.52
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,468	385.24	5,188,412.32
MASCO CORP	14,885	57.95	862,585.75
NORDSON CORP	3,207	189.82	608,752.74
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	339.41	2,815,405.95
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	62.08	1,310,570.88
OWENS CORNING	5,205	65.71	342,020.55
PACCAR INC	17,781	84.96	1,510,673.76
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,505	207.09	1,347,120.45
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	44.86	368,749.20
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	80,415	59.58	4,791,125.70
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	224.57	1,396,600.83
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,603	399.90	2,240,639.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	43.09	327,484.00
SMITH(A.O.) CORP	7,157	48.25	345,325.25
SNAP-ON INC	2,407	150.45	362,133.15
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,560	157.60	1,349,056.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	312.47	643,688.20
TEXTRON INC	11,803	38.53	454,769.59
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	117.07	1,493,696.13
TRANSDIGM GROUP INC	2,610	500.93	1,307,427.30
UNITED RENTALS INC	3,596	175.89	632,500.44
WABTEC CORP	9,231	68.39	631,308.09
WW GRAINGER INC	2,390	361.28	863,459.20
XYLEM INC	9,124	83.41	761,032.84
CINTAS CORP	4,514	325.93	1,471,248.02
COPART INC	11,816	103.04	1,217,520.64
COSTAR GROUP INC	1,993	803.51	1,601,395.43
EQUIFAX INC	6,127	167.70	1,027,497.90
IHS MARKIT LTD	19,584	78.03	1,528,139.52
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	14.86	267,866.36
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	95.16	1,086,251.40
ROBERT HALF INTL INC	5,555	52.41	291,137.55
ROLLINS INC	9,164	55.51	508,693.64
TRANSUNION	9,497	86.10	817,691.70



VERISK ANALYTICS INC	7,929	182.96	1,450,689.84
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	100.10	1,356,955.60
WASTE MANAGEMENT INC	22,016	112.56	2,478,120.96
AMERCO	390	377.62	147,271.80
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	99.01	685,644.25
CSX CORPORATION	41,427	76.66	3,175,793.82
DELTA AIR LINES INC	8,299	31.76	263,576.24
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	89.55	778,099.95
FEDEX CORP	12,743	225.75	2,876,732.25
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	138.05	608,938.55
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	185.47	945,897.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	46.52	369,368.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,862	212.30	2,942,902.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	199.04	980,471.04
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	39.22	247,713.52
UBER TECHNOLOGIES INC	49,619	35.01	1,737,161.19
UNION PACIFIC CORP	36,164	192.86	6,974,589.04
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,301	159.80	5,960,699.80
XPO LOGISTICS INC	4,716	87.56	412,932.96
APTIV PLC	14,147	85.65	1,211,690.55
AUTOLIV INC	4,001	78.48	313,998.48
BORGWARNER INC	12,075	42.29	510,651.75
FORD MOTOR COMPANY	208,063	6.97	1,450,199.11
GENERAL MOTORS CO	67,788	31.95	2,165,826.60
LEAR CORP	2,749	120.25	330,567.25
TESLA INC	39,155	366.28	14,341,693.40
D.R.HORTON INC	17,316	70.07	1,213,332.12
GARMIN LTD	8,124	101.14	821,661.36
HASBRO INC	7,491	78.37	587,069.67
LENNAR CORP-CL A	14,494	75.79	1,098,500.26
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	323.93	2,099,390.33
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	94.09	269,379.67
NEWELL BRANDS INC	18,477	16.43	303,577.11
NIKE INC -CL B	65,399	114.90	7,514,345.10
NVR INC	173	4,012.24	694,117.52
PELOTON INTERACTIVE INC-A	11,342	91.17	1,034,050.14
PULTE GROUP INC	13,065	44.60	582,699.00
RALPH LAUREN CORPORATION	1,971	73.51	144,888.21
VF CORP	17,117	68.00	1,163,956.00
WHIRLPOOL CORP	3,212	171.82	551,885.84
ARAMARK	13,242	28.77	380,972.34
CARNIVAL CORP	22,289	17.66	393,623.74

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,381	1,321.03	1,824,342.43
DARDEN RESTAURANTS INC	7,425	88.58	657,706.50
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	382.07	810,370.47
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	90.39	1,321,230.63
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	50.84	896,512.56
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	102.01	1,501,077.15
MCDONALD'S CORPORATION	39,368	215.71	8,492,071.28
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	15,484	18.38	284,595.92
MGM MIRAGE	25,878	23.11	598,040.58
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	70.11	633,513.96
STARBUCKS CORP	61,458	85.86	5,276,783.88
VAIL RESORTS INC	2,038	218.90	446,118.20
WYNN RESORTS LTD	4,913	82.95	407,533.35
YUM! BRANDS INC	15,549	93.39	1,452,121.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,971	79.59	3,181,291.89
ALPHABET INC-CL A	15,878	1,547.23	24,566,917.94
ALPHABET INC-CL C	16,014	1,556.96	24,933,157.44
ALTICE USA INC-A	18,072	26.71	482,703.12
CABLE ONE INC	246	1,822.12	448,241.52
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,696	613.28	4,719,802.88
COMCAST CORP-CLASS A	239,482	44.60	10,680,897.20
DISCOVERY INC-A	7,075	23.06	163,149.50
DISCOVERY INC-C	18,283	20.92	382,480.36
DISH NETWORK CORP.	12,937	33.17	429,120.29
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	128.70	1,975,802.40
FACEBOOK INC-A	127,132	273.72	34,798,571.04
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	28.20	478,328.40
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	28.29	248,188.17
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	125.97	500,604.78
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	17.20	337,567.20
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	137.44	180,321.28
LIBERTY BROADBAND-C	5,418	139.48	755,702.64
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	37.10	381,684.80
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	35.26	269,668.48
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	35.36	146,425.76
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	57.24	429,986.88
MATCH GROUP INC	12,773	105.56	1,348,317.88
NETFLIX INC	23,336	500.19	11,672,433.84
NEWS CORP-CLASS A	16,662	15.12	251,929.44
OMNICOM GROUP	10,417	53.00	552,101.00
PINTEREST INC- CLASS A	23,277	35.51	826,566.27
ROKU INC	5,784	161.18	932,265.12

SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	5.71	386,315.76
SNAP INC-A	45,553	23.65	1,077,328.45
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	158.59	905,073.13
THE WALT DISNEY CO.	95,065	133.36	12,677,868.40
TWITTER INC	40,795	39.56	1,613,850.20
VIACOMCBS INC	27,523	28.71	790,185.33
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	82.32	650,821.92
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	154.35	528,803.10
AMAZON.COM INC	22,396	3,268.61	73,203,789.56
AUTOZONE INC	1,271	1,233.00	1,567,143.00
BEST BUY COMPANY INC	12,920	108.85	1,406,342.00
BOOKING HOLDINGS INC	2,150	1,871.07	4,022,800.50
BURLINGTON STORES INC	3,391	212.19	719,536.29
CARMAX INC	8,427	105.15	886,099.05
DOLLAR GENERAL CORP	13,656	197.45	2,696,377.20
DOLLAR TREE INC	12,047	91.81	1,106,035.07
EBAY INC	38,247	53.44	2,043,919.68
EXPEDIA GROUP INC	6,894	99.23	684,091.62
GENUINE PARTS CO	7,406	99.67	738,156.02
HOME DEPOT INC	56,997	277.04	15,790,448.88
LKQ CORPORATION	15,922	31.74	505,364.28
LOWE'S COMPANIES INC	40,135	159.53	6,402,736.55
MERCADOLIBRE INC	2,364	1,057.34	2,499,551.76
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,833	476.28	1,825,581.24
ROSS STORES INC	18,792	93.47	1,756,488.24
TARGET CORP	26,747	147.55	3,946,519.85
TIFFANY & CO	5,541	113.96	631,452.36
TJX COMPANIES INC	62,641	54.76	3,430,221.16
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	141.58	866,044.86
ULTA BEAUTY INC	2,765	235.40	650,881.00
WAYFAIR INC-CLASS A	3,266	258.31	843,640.46
COSTCO WHOLESALE CORP	23,321	346.43	8,079,094.03
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	3.85	51,975.00
KROGER CO	43,800	35.18	1,540,884.00
SYSCO CORP	24,725	61.42	1,518,609.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,655	35.35	1,401,804.25
WALMART INC	74,763	139.89	10,458,596.07
ALTRIA GROUP INC	99,656	43.79	4,363,936.24
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	46.05	1,308,004.20
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	81.14	1,267,406.80
BUNGE LIMITED	7,174	45.85	328,927.90
CAMPBELL SOUP CO	10,638	45.59	484,986.42

COCA-COLA CO/THE	214,821	50.19	10,781,865.99
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	10,748	44.88	482,370.24
CONAGRA BRANDS INC	24,639	35.81	882,322.59
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	189.93	1,686,768.33
GENERAL MILLS INC	33,049	59.98	1,982,279.02
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	50.67	756,959.13
INGREDION INC	3,320	81.99	272,206.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	115.76	667,703.68
KELLOGG CO	12,949	66.53	861,496.97
KEURIG DR PEPPER INC	18,339	29.52	541,367.28
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	31.65	1,076,384.85
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	61.40	455,403.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,856	202.69	1,389,642.64
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	37.52	361,280.08
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	75,033	57.50	4,314,397.50
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	21,116	82.74	1,747,137.84
PEPSICO INC	73,224	137.11	10,039,742.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	82,349	80.47	6,626,624.03
THE HERSHEY COMPANY	7,514	147.72	1,109,968.08
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	61.24	915,476.76
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	94.04	1,174,089.40
CLOROX COMPANY	6,955	220.00	1,530,100.00
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	42,627	77.57	3,306,576.39
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,176	218.51	2,660,577.76
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	151.45	2,695,810.00
PROCTER & GAMBLE CO	130,807	138.15	18,070,987.05
ABBOTT LABORATORIES	92,995	105.81	9,839,800.95
ABIOMED INC	2,288	277.93	635,903.84
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	323.92	1,248,387.68
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	96.20	768,926.60
ANTHEM INC	13,558	267.42	3,625,680.36
BAXTER INTERNATIONAL INC	27,452	82.86	2,274,672.72
BECTON DICKINSON & CO	15,315	235.57	3,607,754.55
BOSTON SCIENTIFIC CORP	77,134	41.53	3,203,375.02
CARDINAL HEALTH INC	15,114	49.54	748,747.56
CENTENE CORP	30,528	57.35	1,750,780.80
CERNER CORP	15,537	71.57	1,111,983.09
CIGNA CORPORATION	19,382	174.03	3,373,049.46
COOPER COMPANIES INC (THE)	3,037	319.20	969,410.40
CVS HEALTH CORPORATION	68,290	59.53	4,065,303.70
DANAHER CORP	33,978	201.94	6,861,517.32
DAVITA INC	5,115	87.97	449,966.55

DENTSPLY SIRONA INC	11,864	44.23	524,744.72
DEXCOM INC	4,765	401.68	1,914,005.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,166	84.84	2,728,963.44
HCA HEALTHCARE INC	14,352	133.81	1,920,441.12
HENRY SCHEIN INC	7,559	64.77	489,596.43
HOLOGIC INC	13,592	59.23	805,054.16
HUMANA INC.	6,808	408.22	2,779,161.76
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	374.16	1,631,711.76
INSULET CORP	3,770	212.44	800,898.80
INTUITIVE SURGICAL INC	6,180	719.48	4,446,386.40
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	175.72	877,721.40
MASIMO CORPORATION	2,941	221.42	651,196.22
MCKESSON CORP	8,411	152.31	1,281,079.41
MEDTRONIC PLC	70,208	106.66	7,488,385.28
MOLINA HEALTHCARE INC	3,490	175.50	612,495.00
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	107.05	729,438.70
RESMED INC	7,271	174.68	1,270,098.28
STERIS PLC	4,287	163.02	698,866.74
STRYKER CORP	17,447	205.41	3,583,788.27
TELADOC HEALTH INC	3,954	200.77	793,844.58
TELEFLEX INC	2,340	389.47	911,359.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,881	312.02	15,563,869.62
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	111.22	467,457.66
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,188	173.20	898,561.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,370	270.93	1,996,754.10
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	272.57	1,030,042.03
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	140.20	1,522,011.20
ABBVIE INC	93,112	91.63	8,531,852.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,906	97.93	1,557,674.58
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,519	108.28	1,247,277.32
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	123.06	690,735.78
AMGEN INC	31,129	245.57	7,644,348.53
AVANTOR INC	25,606	22.00	563,332.00
BEIGENE LTD-ADR	2,246	240.23	539,556.58
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	501.49	611,817.80
BIOGEN INC	8,909	272.51	2,427,791.59
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	74.49	676,369.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	119,269	59.08	7,046,412.52
CATALENT INC	8,935	84.80	757,688.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	23,464	28.47	668,020.08
ELI LILLY & CO	45,441	151.97	6,905,668.77
EXACT SCIENCES CORP	8,428	76.10	641,370.80

GILEAD SCIENCES INC	66,168	64.51	4,268,497.68
ILLUMINA INC	7,655	347.00	2,656,285.00
INCYTE CORP	9,243	91.51	845,826.93
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	53.15	359,294.00
IQVIA HOLDINGS INC	10,521	161.06	1,694,512.26
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	140.93	366,981.72
JOHNSON & JOHNSON	139,496	149.70	20,882,551.20
MERCK & CO. INC.	133,609	84.88	11,340,731.92
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	975.82	1,227,581.56
MODERNA INC	14,409	56.90	819,872.10
MYLAN NV	26,138	15.25	398,604.50
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	107.66	450,664.76
PERKINELMER INC	5,624	114.25	642,542.00
PERRIGO CO PLC	6,187	48.77	301,739.99
PFIZER INC	291,622	36.18	10,550,883.96
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,297	571.15	3,025,381.55
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	130.49	499,515.72
SEATTLE GENETICS INC	6,654	148.38	987,320.52
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	54,151	8.88	480,860.88
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,043	418.32	8,802,707.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,784	263.04	3,625,743.36
WATERS CORP	3,527	206.24	727,408.48
ZOETIS INC	24,652	158.91	3,917,449.32
BANK OF AMERICA CORP	414,049	25.51	10,562,389.99
CITIGROUP INC	110,619	51.40	5,685,816.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	27.13	564,276.87
COMERICA INC	7,691	39.70	305,332.70
EAST WEST BANCORP INC	9,201	35.38	325,531.38
FIFTH THIRD BANCORP	34,374	21.12	725,978.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	109.49	974,132.53
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	9.79	519,476.98
JPMORGAN CHASE & CO	161,637	100.87	16,304,324.19
KEYCORP	51,128	12.55	641,656.40
M & T BANK CORP	6,151	101.16	622,235.16
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	10.43	210,686.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,526	109.91	2,475,832.66
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	45,312	11.46	519,275.52
SIGNATURE BANK	2,508	95.41	239,288.28
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	256.23	676,447.20
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	72,913	37.83	2,758,298.79
US BANCORP	73,548	36.53	2,686,708.44
WELLS FARGO & COMPANY	206,508	23.84	4,923,150.72

ZIONS BANCORPORATION	8,874	32.11	284,988.51
ALLY FINANCIAL INC	20,139	24.11	485,551.29
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,757	103.78	3,710,861.46
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,412	150.10	962,441.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	45.33	351,080.85
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	35.89	1,514,809.23
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	73,716	219.63	16,190,245.08
BLACKROCK INC	8,148	560.18	4,564,346.64
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,684	51.61	1,790,041.24
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,991	70.57	1,763,614.87
CARLYLE GROUP INC/THE	9,341	25.61	239,223.01
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	89.95	509,206.95
CME GROUP INC.	19,137	168.01	3,215,207.37
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	55.04	904,032.00
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,809	52.94	572,228.46
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	20.00	456,400.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	332.67	645,047.13
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	20.40	291,679.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,508	202.22	3,540,467.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,913	101.21	2,926,284.73
INVESCO LIMITED	18,328	10.69	195,926.32
KKR & CO INC	24,824	34.96	867,847.04
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	458.67	876,977.04
MOODY'S CORP	9,041	288.41	2,607,514.81
MORGAN STANLEY	62,409	51.06	3,186,603.54
MSCI INC-A	4,383	348.69	1,528,308.27
NASDAQ INC	6,558	129.19	847,228.02
NORTHERN TRUST CORP	11,214	81.09	909,343.26
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	73.56	472,696.56
S&P GLOBAL INC	12,929	351.78	4,548,163.62
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,841	35.03	2,096,230.23
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	51.10	280,079.10
STATE STREET CORP	18,694	65.79	1,229,878.26
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	25.60	712,320.00
T ROWE PRICE GROUP INC	12,364	129.24	1,597,923.36
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	37.88	531,380.64
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	54.83	286,212.60
VOYA FINANCIAL INC	7,308	49.06	358,530.48
AFLAC INC	37,753	37.04	1,398,371.12
ALLEGHANY CORPORATION	689	540.33	372,287.37
ALLSTATE CORP	16,654	92.54	1,541,161.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	67.75	239,767.25

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	47,933	29.15	1,397,246.95
AON PLC	12,443	203.63	2,533,768.09
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	31.55	646,017.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	103.23	969,742.62
ASSURANT INC	3,114	121.35	377,883.90
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	36.40	298,443.60
BROWN & BROWN INC	14,036	45.40	637,234.40
CHUBB LTD	23,475	122.22	2,869,114.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	78.84	619,524.72
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	220.58	284,107.04
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	213.59	441,063.35
FNF GROUP	13,937	33.57	467,865.09
GLOBE LIFE INC	6,040	81.60	492,864.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	39.48	723,707.88
LINCOLN NATIONAL CORP	11,620	35.75	415,415.00
LOEWS CORPORATION	13,914	35.81	498,260.34
MARKEL CORP	702	1,049.65	736,854.30
MARSH & MCLENNAN COS	26,208	116.75	3,059,784.00
METLIFE INC	41,534	38.28	1,589,921.52
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	41.85	591,089.40
PROGRESSIVE CORP	30,367	94.67	2,874,843.89
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	68.28	1,415,307.84
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	102.22	308,908.84
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	179.05	400,892.95
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	113.63	1,491,507.38
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	63.53	471,900.84
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	209.19	1,427,303.37
CBRE GROUP INC-A	18,244	48.53	885,381.32
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	3.92	205,016.00
JONES LANG LASALLE INC	2,618	103.23	270,256.14
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	313.36	1,853,837.76
ACCENTURE PLC-CL A	33,533	238.91	8,011,369.03
ADOBE INC	25,379	479.46	12,168,215.34
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	108.94	906,489.74
ANSYS INC	4,470	320.05	1,430,623.50
AUTODESK INC	11,506	232.78	2,678,366.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,463	137.26	3,083,271.38
AVALARA INC	4,319	121.37	524,197.03
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	82.26	627,067.98
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	85.90	689,691.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	136.38	803,141.82
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	104.34	1,486,845.00



CDK GLOBAL INC	5,808	44.85	260,488.80
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,994	119.79	718,021.26
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	141.53	918,529.70
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,737	66.41	1,908,424.17
COUPA SOFTWARE INC	3,490	260.48	909,075.20
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,997	128.18	1,025,055.46
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,646	99.46	263,171.16
DATADOG INC - CLASS A	7,757	81.98	635,918.86
DOCUSIGN INC	8,890	211.79	1,882,813.10
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	20.35	215,050.57
DYNATRACE INC	11,194	40.01	447,871.94
EPAM SYSTEMS INC	3,128	318.92	997,581.76
FAIR ISAAC CORP	1,494	419.70	627,031.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,272	148.50	4,792,392.00
FISERV INC	30,144	96.42	2,906,635.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	234.96	1,027,010.16
FORTINET INC	7,360	117.11	861,929.60
GARTNER INC	4,568	131.28	599,687.04
GLOBAL PAYMENTS INC	15,685	169.15	2,653,117.75
GODADDY INC - CLASS A	8,905	77.05	686,130.25
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	111.76	528,736.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,520	122.26	5,687,535.20
INTUIT INC	13,553	328.21	4,448,230.13
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	160.71	629,179.65
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	87.17	605,569.99
MASTERCARD INC-CL A	47,066	339.64	15,985,496.24
MICROSOFT CORP	380,538	211.29	80,403,874.02
MONGODB INC	2,659	215.58	573,227.22
NORTONLIFELOCK INC	31,347	23.05	722,548.35
OKTA INC	5,912	200.49	1,185,296.88
ORACLE CORPORATION	109,370	56.95	6,228,621.50
PALO ALTO NETWORKS INC	5,221	238.40	1,244,686.40
PAYCHEX INC	17,734	75.78	1,343,882.52
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	280.17	706,588.74
PAYPAL HOLDINGS INC	58,685	194.60	11,420,101.00
PTC INC	5,462	88.60	483,933.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	259.26	1,034,965.92
SALESFORCE.COM, INC.	47,719	250.43	11,950,269.17
SERVICENOW INC	10,204	458.20	4,675,472.80
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	22,460	25.24	566,890.40
SPLUNK INC	8,697	196.55	1,709,395.35
SQUARE INC-A	19,600	144.21	2,826,516.00

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	60.17	694,722.82
SYNOPSIS INC	7,601	205.33	1,560,713.33
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	2,140	433.04	926,705.60
TWILIO INC-A	6,173	233.11	1,438,988.03
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	329.63	664,534.08
VERISIGN INC	5,227	200.33	1,047,124.91
VISA INC	89,367	204.06	18,236,230.02
VMWARE INC	4,194	140.13	587,705.22
WESTERN UNION COMPANY	21,840	22.69	495,549.60
WIX.COM LTD	2,703	262.28	708,942.84
WORKDAY INC-CLASS A	9,502	210.75	2,002,546.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,631	389.65	3,363,069.15
ZSCALER INC	4,274	134.19	573,528.06
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,698	106.78	1,676,232.44
APPLE INC	915,576	117.32	107,415,376.32
ARISTA NETWORKS INC	2,720	211.81	576,123.20
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	78.42	323,874.60
CDW CORP/DE	7,404	110.55	818,512.20
CISCO SYSTEMS INC	223,383	40.13	8,964,359.79
COGNEX CORP	8,698	62.90	547,104.20
CORNING INC	38,044	33.07	1,258,115.08
DELL TECHNOLOGIES INC-C	12,602	66.84	842,317.68
F5 NETWORKS INC	2,909	123.30	358,679.70
FLIR SYSTEMS INC	6,867	33.86	232,516.62
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	9.46	604,314.26
HP INC	73,161	19.70	1,441,271.70
IPG PHOTONICS CORP	1,776	164.89	292,844.64
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	23.23	405,595.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	92.89	886,356.38
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,241	153.57	1,419,140.37
NETAPP INC	10,919	46.57	508,497.83
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	46.23	584,069.82
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	98.05	1,708,521.25
TRIMBLE INC	12,759	50.11	639,353.49
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	36.55	543,023.35
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	255.11	698,236.07
AT&T INC	377,677	29.37	11,092,373.49
CENTURYLINK INC	49,758	10.86	540,371.88
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	21.96	185,208.88
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	21.61	455,517.19
T-MOBILE US INC	29,935	113.20	3,388,642.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	217,707	60.04	13,071,128.28

AES CORPORATION	33,656	17.54	590,326.24
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	53.78	650,791.78
AMEREN CORPORATION	12,454	78.38	976,144.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	79.91	2,055,844.57
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	143.20	1,310,852.80
ATMOS ENERGY CORP	6,965	96.65	673,167.25
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	19.53	497,311.92
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	61.69	866,127.60
CONSOLIDATED EDISON INC	18,336	72.91	1,336,877.76
DOMINION ENERGY INC	44,714	79.64	3,561,022.96
DTE ENERGY COMPANY	10,496	119.71	1,256,476.16
DUKE ENERGY CORP	39,154	82.59	3,233,728.86
EDISON INTERNATIONAL	21,278	51.54	1,096,668.12
ENERGY CORP	10,866	98.37	1,068,888.42
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,881	39.94	554,407.14
EVERGY INC	11,273	52.70	594,087.10
EVERSOURCE ENERGY	18,566	85.79	1,592,777.14
EXELON CORP	50,837	36.67	1,864,192.79
FIRSTENERGY CORP	26,948	29.14	785,264.72
NEXTERA ENERGY INC	25,604	282.37	7,229,801.48
NISOURCE INC	18,919	22.11	418,299.09
NRG ENERGY INC	13,547	32.36	438,380.92
OGE ENERGY CORP	11,870	31.08	368,919.60
P G & E CORPORATION	64,016	9.11	583,185.76
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	72.63	435,489.48
PPL CORPORATION	42,727	27.75	1,185,674.25
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,532	53.43	1,471,034.76
SEMPRA ENERGY	15,304	120.95	1,851,018.80
SOUTHERN CO	54,098	52.85	2,859,079.30
UGI CORPORATION	10,588	33.54	355,121.52
VISTRA CORP	25,777	18.42	474,812.34
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	97.77	1,607,143.26
XCEL ENERGY INC	26,959	70.59	1,903,035.81
ADVANCED MICRO DEVICES	60,996	81.91	4,996,182.36
ANALOG DEVICES INC	19,298	115.46	2,228,147.08
APPLIED MATERIALS INC	48,260	55.20	2,663,952.00
BROADCOM INC	21,108	360.03	7,599,513.24
INTEL CORP	225,010	49.62	11,164,996.20
KLA CORPORATION	8,157	174.46	1,423,070.22
LAM RESEARCH CORP	7,581	300.91	2,281,198.71
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,976	39.45	1,379,803.20
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	66.96	924,985.44

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,580	101.45	1,377,691.00
	MICRON TECHNOLOGY INC	57,501	45.15	2,596,170.15
	NVIDIA CORP	32,592	508.60	16,576,291.20
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	124.24	1,796,137.68
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	21.82	456,299.84
	QORVO INC	6,042	122.71	741,413.82
	QUALCOMM INC	59,853	114.02	6,824,439.06
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	137.61	1,205,050.77
	TERADYNE INC	8,542	76.87	656,623.54
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,916	139.68	6,832,586.88
	XILINX INC	12,876	100.39	1,292,621.64
	米ドル 小計	16,287,144		1,550,318,868.84 (164,674,870,248)
カナダドル	CAMECO CORP	26,696	14.31	382,019.76
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,870	24.25	1,573,097.50
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	5.59	301,960.62
	ENBRIDGE INC	108,044	41.76	4,511,917.44
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	19.81	257,510.19
	INTER PIPELINE LTD	19,394	13.90	269,576.60
	KEYERA CORP	11,374	23.01	261,715.74
	PARKLAND CORP	7,666	34.60	265,243.60
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	32.30	885,375.30
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	18.50	1,454,877.00
	TC ENERGY CORP	50,473	60.85	3,071,282.05
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	109.46	1,303,121.30
	B2GOLD CORP	65,650	8.77	575,750.50
	BARRICK GOLD CORP	93,098	40.11	3,734,160.78
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	47.95	314,695.85
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	12.86	407,301.92
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	198.03	2,012,974.95
	KINROSS GOLD CORP	63,501	12.05	765,187.05
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,581	71.79	1,118,559.99
	LUNDIN MINING CORP	28,209	8.39	236,673.51
	NUTRIEN LTD	29,898	50.02	1,495,497.96
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	47.11	554,154.93
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	15.44	383,128.16
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,117	72.18	1,740,765.06
	YAMANA GOLD INC	53,588	8.30	444,780.40
	CAE INC	12,891	19.62	252,921.42
	WSP GLOBAL INC	6,141	88.80	545,320.80
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	75.05	425,308.35
	THOMSON REUTERS CORP	10,069	101.26	1,019,586.94

AIR CANADA	5,737	17.82	102,233.34
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,013	137.25	5,080,034.25
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	387.66	2,758,200.90
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	63.89	917,715.96
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	26.30	238,435.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	73.40	1,065,034.00
QUEBECOR INC -CL B	9,953	32.90	327,453.70
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	24.68	672,085.76
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,570	134.84	481,378.80
DOLLARAMA INC	17,025	49.11	836,097.75
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	45,924	46.36	2,129,036.64
EMPIRE CO LTD A	7,235	34.05	246,351.75
LOBLAW COMPANIES LTD	10,625	68.55	728,343.75
METRO INC	13,109	60.72	795,978.48
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	96.24	412,003.44
SAPUTO INC	13,425	32.74	439,534.50
BAUSCH HEALTH COS INC	15,027	21.27	319,624.29
CANOPY GROWTH CORP	11,251	21.48	241,671.48
CRONOS GROUP INC	8,026	6.96	55,860.96
BANK OF MONTREAL	33,057	80.72	2,668,361.04
BANK OF NOVA SCOTIA	63,154	55.44	3,501,257.76
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	103.90	2,443,000.70
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	72.57	1,233,182.01
ROYAL BANK OF CANADA	75,485	97.50	7,359,787.50
TORONTO-DOMINION BANK	96,281	63.68	6,131,174.08
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	72,543	43.28	3,139,661.04
CI FINANCIAL CORP	11,041	18.09	199,731.69
IGM FINANCIAL INC	6,433	32.01	205,920.33
ONEX CORPORATION	4,217	63.56	268,032.52
TMX GROUP LTD	3,142	135.10	424,484.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	397.47	553,675.71
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	26.62	378,004.00
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	46.99	227,948.49
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	138.55	977,885.90
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	19.44	1,940,306.40
POWER CORP OF CANADA	26,261	26.40	693,290.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,494	55.31	1,797,243.14
BLACKBERRY LIMITED	25,993	6.47	168,174.71
CGI INC-CL A	12,882	93.14	1,199,829.48
CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,516.79	1,556,226.54
OPEN TEXT CORPORATION	13,665	56.95	778,221.75
SHOPIFY INC-CLASS A	5,707	1,250.26	7,135,233.82

	BCE INC	8,379	56.99	477,519.21
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	20,136	55.38	1,115,131.68
	TELUS CORPORATION	15,222	23.85	363,044.70
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,712	18.45	492,836.40
	ALTAGAS LTD	17,347	16.91	293,337.77
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	40.46	122,593.80
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	33.03	242,572.32
	EMERA INC	14,279	54.92	784,202.68
	FORTIS INC	24,171	53.96	1,304,267.16
	HYDRO ONE LTD	15,052	27.86	419,348.72
	カナダドル 小計	2,044,238		99,007,028.87 (7,989,867,229)
ユーロ	ENI SPA	133,196	7.62	1,016,019.08
	GALP ENERGIA SGPS S.A	32,690	9.05	296,106.02
	NESTE OYJ	22,533	45.73	1,030,434.09
	OMV AG	6,881	27.48	189,089.88
	REPSOL SA	79,125	6.39	505,608.75
	TENARIS S.A.	25,963	4.63	120,416.39
	TOTAL SE	130,614	32.74	4,276,302.36
	VOPAK	3,130	47.12	147,485.60
	AIR LIQUIDE SA	25,186	142.25	3,582,708.50
	AKZO NOBEL	10,399	84.14	874,971.86
	ARCELORMITTAL	36,689	10.92	400,790.63
	ARKEMA	3,250	95.00	308,750.00
	BASF SE	48,271	54.73	2,641,871.83
	COVESTRO AG	8,053	43.49	350,224.97
	CRH PLC	43,055	31.55	1,358,385.25
	EVONIK INDUSTRIES AG	13,312	24.10	320,819.20
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	39.68	133,721.60
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,440	54.08	456,435.20
	KONINKLIJKE DSM NV	9,362	136.25	1,275,572.50
	LANXESS	4,409	50.40	222,213.60
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	31.14	356,272.74
	SOLVAY SA	3,758	79.60	299,136.80
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	13.35	403,623.90
	SYMRISE AG	6,524	116.60	760,698.40
	THYSSENKRUPP AG	19,367	6.15	119,223.25
	UMICORE	10,560	39.54	417,542.40
	UPM-KYMMENE OYJ	27,288	26.32	718,220.16
	VOESTALPINE AG	7,001	21.87	153,111.87
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,716	20.94	329,093.04
	AIRBUS SE	30,303	69.39	2,102,725.17

ALSTOM RGPT	9,668	46.54	449,948.72
ANDRITZ AG	5,711	28.10	160,479.10
BOUYGUES SA	11,049	32.59	360,086.91
BRENTAG AG	7,392	54.24	400,942.08
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	7.12	390,217.10
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	35.68	912,801.44
DASSAULT AVIATION SA	172	780.00	134,160.00
EIFFAGE SA	4,989	80.20	400,117.80
FERROVIAL SA	23,810	22.50	535,725.00
GEA GROUP AG	8,178	31.72	259,406.16
HOCHTIEF AG	1,931	74.65	144,149.15
KINGSPAN GROUP PLC	8,021	68.20	547,032.20
KION GROUP AG	3,179	73.98	235,182.42
KNORR-BREMSE AG	2,328	108.02	251,470.56
KONE OYJ-B	17,396	73.28	1,274,778.88
LEGRAND SA	14,888	71.22	1,060,323.36
LEONARDO SPA	29,118	5.51	160,614.88
MTU AERO ENGINES AG	2,957	157.15	464,692.55
PRYSMIAN SPA	11,926	23.64	281,930.64
SAFRAN SA	17,398	97.44	1,695,261.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,687	107.15	3,073,812.05
SIEMENS AG-REG	40,572	118.14	4,793,176.08
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	22.22	255,130.04
THALES SA	5,403	66.16	357,462.48
VINCI S.A.	27,668	80.18	2,218,420.24
WARTSILA OYJ-B SHARES	30,950	6.89	213,431.20
BUREAU VERITAS SA	17,817	19.19	341,997.31
RANDSTAD NV	7,279	45.12	328,428.48
TELEPERFORMANCE	2,970	262.00	778,140.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	71.62	1,044,076.36
AENA SME SA	3,556	124.00	440,944.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	86.80	116,832.80
ATLANTIA SPA	26,501	14.94	395,924.94
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	8.71	144,392.68
DEUTSCHE POST AG-REG	50,830	38.97	1,980,845.10
FRAPORT AG	1,856	36.10	67,001.60
GETLINK	22,311	12.53	279,556.83
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	63.74	1,139,225.02
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	49.68	124,597.44
CONTINENTAL AG	5,578	93.40	520,985.20
DAIMLER AG	44,402	46.39	2,059,808.78
FAURECIA	3,127	40.70	127,268.90

FERRARI NV	6,452	160.90	1,038,126.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	63,572	9.61	611,054.06
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	95.76	837,516.96
PIRELLI & C SPA	17,484	3.85	67,348.36
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,765	54.40	422,416.00
PSA PEUGEOT CITROEN	28,139	15.47	435,451.02
RENAULT SA	8,830	25.27	223,134.10
VALEO SA	14,048	28.31	397,698.88
VOLKSWAGEN AG	1,984	161.90	321,209.60
VOLKSWAGEN AG PFD	9,869	151.32	1,493,377.08
ADIDAS AG	10,200	266.90	2,722,380.00
ESSILORLUXOTTICA	15,358	111.65	1,714,720.70
HERMES INTERNATIONAL	1,676	735.80	1,233,200.80
KERING	4,109	552.60	2,270,633.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,681	404.05	5,931,858.05
MONCLER SPA	10,437	34.47	359,763.39
PUMA SE	5,186	70.28	364,472.08
SEB SA	1,025	140.20	143,705.00
ACCOR SA	10,451	25.84	270,053.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,237	124.60	1,026,330.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	30.72	177,715.20
SODEXO	3,900	64.62	252,018.00
BOLLORE	39,433	3.21	126,816.52
JC DECAUX SA	2,828	16.30	46,096.40
PUBLICIS GROUPE	10,736	29.37	315,316.32
SCOUT24 AG	5,610	77.75	436,177.50
SES	17,687	5.80	102,619.97
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	33.04	72,060.24
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,382	69.04	371,573.28
VIVENDI SA	44,196	24.44	1,080,150.24
DELIVERY HERO SE	6,675	90.66	605,155.50
INDITEX	56,754	22.83	1,295,693.82
JUST EAT TAKEAWAY	6,355	91.30	580,211.50
PROSUS NV	25,434	81.30	2,067,784.20
ZALANDO SE	7,911	72.72	575,287.92
CARREFOUR SA	35,827	14.76	528,806.52
COLRUYT NV	2,870	53.62	153,889.40
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	14.21	175,877.17
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	25.58	1,520,782.16
METRO AG	9,368	8.50	79,628.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,898	48.31	1,927,671.87
DANONE	32,081	57.58	1,847,223.98



DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	9.06	254,038.38
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	68.35	421,582.80
HEINEKEN NV	13,143	76.98	1,011,748.14
KERRY GROUP PLC-A	8,005	116.50	932,582.50
PERNOD-RICARD SA	11,112	142.00	1,577,904.00
REMY COINTREAU	1,273	146.50	186,494.50
BEIERSDORF AG	5,138	99.26	509,997.88
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	76.90	459,400.60
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	87.76	793,613.68
L'OREAL	13,383	282.60	3,782,035.80
UNILEVER NV	77,207	51.48	3,974,616.36
BIOMERIEUX	2,591	119.90	310,660.90
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	95.30	216,235.70
DIASORIN SPA	1,313	152.30	199,969.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	71.90	799,384.20
FRESENIUS SE & CO KGAA	22,174	38.46	852,812.04
KONINKLIJKE PHILIPS NV	48,002	40.45	1,941,920.91
ORPEA	2,695	100.20	270,039.00
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	331.60	598,206.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	38.41	544,801.53
ARGENX SE	2,617	193.20	505,604.40
BAYER AG	52,305	55.60	2,908,158.00
EUROFINS SCIENTIFIC	701	679.00	475,979.00
GALAPAGOS NV	2,318	108.65	251,850.70
GRIFOLS S.A.	15,169	23.30	353,437.70
IPSEN	1,498	90.15	135,044.70
MERCK KGAA	6,553	120.45	789,308.85
ORION OYJ	6,379	38.39	244,889.81
QIAGEN N.V.	12,543	41.79	524,171.97
RECORDATI SPA	4,578	45.18	206,834.04
SANOFI	59,702	88.12	5,260,940.24
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	284.20	441,931.00
UCB SA	6,623	98.70	653,690.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	8.11	153,522.25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	2.51	888,221.61
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	893,341	1.88	1,683,769.11
BANKINTER,S.A.	36,405	4.63	168,555.15
BNP PARIBAS	60,436	36.79	2,223,440.44
CAIXABANK	181,981	2.05	373,970.95
COMMERZBANK AG	46,644	4.91	229,115.32
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	8.65	503,376.12

ERSTE GROUP BANK AG	14,968	20.35	304,598.80
FINECOBANK SPA	32,034	12.48	399,944.49
ING GROEP NV-CVA	205,237	7.05	1,447,741.79
INTESA SANPAOLO	878,570	1.79	1,572,816.01
KBC GROUPE SA	12,787	47.43	606,487.41
MEDIOBANCA SPA	40,820	7.10	289,822.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,862	15.18	119,345.16
SOCIETE GENERALE	41,025	13.18	540,791.55
UNICREDIT SPA	107,010	8.12	868,921.20
AMUNDI SA	3,955	63.30	250,351.50
DEUTSCHE BANK AG -REG	97,135	8.01	778,245.62
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	151.60	1,520,699.60
EURAZEO	1,792	46.36	83,077.12
EXOR NV	6,204	50.42	312,805.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	79.90	472,528.60
NATIXIS	45,362	2.26	102,608.84
SOFINA	804	230.50	185,322.00
WENDEL	1,082	84.90	91,861.80
AEGON NV	91,609	2.36	216,380.45
AGEAS	8,765	37.71	330,528.15
ALLIANZ SE-REG	22,145	183.90	4,072,465.50
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	12.95	742,073.85
AXA SA	105,344	17.43	1,836,988.67
CNP ASSURANCES	8,978	11.47	102,977.66
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	146.80	448,914.40
MAPFRE SA	46,367	1.59	73,769.89
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,629	253.60	1,934,714.40
NN GROUP NV	15,922	33.37	531,317.14
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.94	210,902.28
SAMPO OYJ-A SHS	24,563	34.71	852,581.73
SCOR SE	7,099	24.78	175,913.22
AROUNDTOWN SA	63,402	4.91	311,367.22
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	45.50	825,552.00
LEG IMMOBILIEN AG	3,680	123.44	454,259.20
VONOVIA SE	27,122	60.28	1,634,914.16
ADYEN NV	942	1,344.00	1,266,048.00
AMADEUS IT GROUP SA	23,777	49.52	1,177,437.04
ATOS SE	4,547	70.92	322,473.24
CAPGEMINI SA	8,059	117.05	943,305.95
DASSAULT SYSTEMES SA	7,023	156.25	1,097,343.75
EDENRED	12,139	43.15	523,797.85
NEMETSCHKE SE	3,011	63.55	191,349.05

NEXI SPA	20,018	15.33	306,976.03
SAP SE	55,065	137.52	7,572,538.80
TEAMVIEWER AG	6,778	41.48	281,151.44
WORLDLINE SA	6,842	75.74	518,213.08
INGENICO S.A.	3,603	140.60	506,581.80
NOKIA OYJ	296,840	3.57	1,061,203.00
ALTICE NV -A W/I	37,625	3.37	126,833.87
CELLNEX TELECOM SA	17,027	51.40	875,187.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	175,876	15.40	2,709,369.78
ELISA OYJ	6,988	50.76	354,710.88
ILIAD SA	1,016	171.30	174,040.80
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	8.83	139,549.32
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.21	384,877.85
ORANGE S.A.	106,132	9.60	1,019,291.72
PROXIMUS SA	7,349	16.82	123,646.92
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.38	190,397.03
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.38	97,057.04
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	77,817	2.40	186,994.25
TELEFONICA S.A.	251,337	3.34	839,968.25
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	40.93	215,660.17
E.ON SE	116,681	10.05	1,172,644.05
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	135,964	4.31	586,412.73
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	8.52	244,110.31
ELIA GROUP SA/NV	1,957	85.60	167,519.20
ENAGAS	14,471	20.44	295,787.24
ENDESA S.A.	14,104	23.41	330,174.64
ENEL SPA	432,766	7.65	3,311,092.66
ENGIE	100,694	11.92	1,200,775.95
FORTUM OYJ	24,312	17.21	418,531.08
IBERDROLA SA	320,996	10.62	3,410,582.50
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	17.00	262,463.00
RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	16.44	388,510.08
RWE AG	34,739	32.17	1,117,553.63
SNAM SPA	106,707	4.45	474,846.15
SUEZ	18,986	15.10	286,688.60
TERNA SPA	65,580	6.03	395,840.88
UNIPER SE	11,709	26.56	310,991.04
VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	19.98	570,648.78
VERBUND AG	2,458	44.74	109,970.92
ASML HOLDING NV	22,565	304.85	6,878,940.25
INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,083	23.96	1,559,388.68
STMICROELECTRONICS NV	35,518	24.97	886,884.46

	ユーロ 小計	10,168,951		203,217,045.04 (25,483,417,448)
英債券	BP PLC	1,053,738	2.62	2,763,427.90
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	219,492	10.87	2,386,317.02
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	191,963	10.41	1,999,486.60
	ANGLO AMERICAN PLC	66,908	18.73	1,253,454.47
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	10.97	213,245.83
	BHP GROUP PLC	110,160	17.19	1,894,311.36
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,626	60.50	400,873.00
	EVRAZ PLC	28,275	3.28	92,855.10
	GLENORE PLC	538,015	1.74	941,418.64
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	26.08	262,729.92
	MONDI PLC	25,128	14.93	375,161.04
	RIO TINTO PLC	59,973	47.90	2,872,706.70
	ASHTREAD GROUP PLC	23,686	28.44	673,629.84
	BAE SYSTEMS PLC	178,101	5.14	916,507.74
	BUNZL PLC	17,064	23.98	409,194.72
	DCC PLC	4,734	64.08	303,354.72
	FERGUSON PLC	12,513	73.68	921,957.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	1.19	294,387.05
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	87,683	2.10	184,748.08
	SMITHS GROUP PLC	24,168	14.22	343,668.96
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	104.35	384,529.75
	EXPERIAN PLC	49,312	29.83	1,470,976.96
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	60.76	497,259.84
	RELX PLC	100,974	17.90	1,807,434.60
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.46	494,957.23
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	5.00	233,750.16
	BURBERRY GROUP PLC	23,066	14.81	341,722.79
	PERSIMMON PLC	16,916	24.71	417,994.36
	TAYLOR WIMPEY PLC	224,882	1.12	253,779.33
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	44.46	319,534.02
	COMPASS GROUP PLC	93,018	12.52	1,165,050.45
	GVC HOLDINGS PLC	24,024	8.39	201,657.45
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,334	43.56	450,149.04	
WHITBREAD PLC	11,282	23.64	266,706.48	
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.52	232,216.66	
INFORMA PLC	78,152	3.96	309,950.83	
PEARSON PLC	39,623	5.46	216,579.31	
WPP PLC	63,987	6.31	404,013.91	
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	8.17	236,017.08	
KINGFISHER PLC	109,678	2.75	302,601.60	

NEXT PLC	6,860	58.48	401,172.80
OCADO GROUP PLC	22,177	23.02	510,514.54
SAINSBURY (J) PLC	112,814	1.91	216,377.25
TESCO PLC	535,913	2.23	1,198,301.46
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.95	285,158.25
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	19.33	324,183.43
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	121,789	26.68	3,249,939.46
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	20.73	180,433.92
DIAGEO PLC	122,234	26.46	3,234,311.64
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	13.60	680,290.81
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,811	75.04	2,837,337.44
UNILEVER PLC	61,673	47.43	2,925,150.39
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	15.65	694,377.52
ASTRAZENECA PLC	69,286	83.86	5,810,323.96
GLAXOSMITHKLINE PLC	265,743	15.32	4,072,777.21
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	26.41	200,214.21
BARCLAYS PLC	870,632	1.04	913,118.84
HSBC HOLDINGS PLC	1,076,778	3.27	3,528,601.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.26	994,540.25
NATWEST GROUP PLC	245,244	1.03	254,685.89
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	3.86	566,751.38
3I GROUP PLC	49,338	9.25	456,771.20
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	16.45	321,959.40
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,271	89.28	1,541,954.88
M&G PLC	133,064	1.57	208,910.48
SCHRODERS PLC	6,213	28.16	174,958.08
ST JAMES' S PLACE PLC	23,417	9.71	227,519.57
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	2.38	293,735.72
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	26.61	306,946.35
AVIVA PLC	198,601	2.87	571,772.27
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.94	186,639.26
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	1.98	599,538.66
PRUDENTIAL PLC	140,178	11.59	1,625,363.91
RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	4.62	241,707.49
AVEVA GROUP PLC	3,527	48.96	172,681.92
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.26	406,913.51
HALMA PLC	19,839	22.70	450,345.30
BT GROUP PLC	469,907	1.10	516,897.70
VODAFONE GROUP PLC	1,440,841	1.09	1,577,720.89
NATIONAL GRID PLC	182,720	8.59	1,569,930.24
SEVERN TRENT PLC	14,743	24.10	355,306.30

	SSE PLC	55,879	12.25	684,517.75
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.58	285,115.30
	英債券 小計	15,143,131		75,366,126.11 (10,398,264,419)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	19.21	194,090.71
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	392	829.50	325,164.00
	GIVAUDAN-REG	484	3,955.00	1,914,220.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	43.45	1,183,534.55
	SIKA AG	7,734	217.30	1,680,598.20
	ABB LTD	97,696	24.04	2,348,611.84
	GEBERIT AG-REG	1,986	526.20	1,045,033.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	247.20	232,615.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	249.40	531,720.80
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	48.61	341,193.59
	SGS SA	308	2,410.00	742,280.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,030	176.15	533,734.50
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	26,223	61.44	1,611,141.12
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,692	203.50	344,322.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	38.94	97,973.04
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	2,060.00	296,640.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	7,725.00	455,775.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	80,600.00	403,000.00
	NESTLE SA-REGISTERED	157,414	110.02	17,318,688.28
	ALCON INC	26,585	51.16	1,360,088.60
	SONOVA HOLDING AG	2,660	210.70	560,462.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	602	885.80	533,251.60
	LONZA GROUP AG-REG	3,812	548.60	2,091,263.20
	NOVARTIS AG-REG SHS	117,971	81.12	9,569,807.52
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	37,080	329.10	12,203,028.00
	VIFOR PHARMA AG	2,638	125.60	331,332.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	96.10	150,877.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	133,144	9.91	1,319,457.04
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,400	41.18	510,632.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	883.60	859,742.80
	UBS GROUP AG	191,189	11.30	2,160,435.70
	BALOISE HOLDING AG	2,475	144.30	357,142.50
SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	380.50	660,167.50	
SWISS RE AG	15,168	78.40	1,189,171.20	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,032	341.40	2,742,124.80	
SWISS PRIME SITE-REG	3,906	84.80	331,228.80	
TEMENOS GROUP AG-REG	3,131	143.90	450,550.90	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,624	63.62	612,278.88	

	SWISSCOM AG-REG	1,399	509.40	712,650.60	
	スイスフラン 小計	923,209		70,306,029.47 (8,189,246,312)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	198.65	1,704,615.65	
	BOLIDEN AB	13,086	271.00	3,546,306.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	34,370	115.95	3,985,201.50	
	ALFA LAVAL AB	13,939	210.80	2,938,341.20	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	202.70	10,564,521.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	410.40	14,131,713.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	362.30	7,168,830.10	
	EPIROC AB-A	29,626	132.00	3,910,632.00	
	EPIROC AB-B	25,132	127.45	3,203,073.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	11,078	196.30	2,174,611.40	
	NIBE INDUSTRIER-B	18,441	223.90	4,128,939.90	
	SANDVIK AB	61,070	186.10	11,365,127.00	
	SKANSKA AB-B SHS	20,821	184.40	3,839,392.40	
	SKF AB-B SHARES	20,607	190.50	3,925,633.50	
	VOLVO AB-B SHS	75,703	171.70	12,998,205.10	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	126.45	2,038,753.35	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,098	181.90	2,746,326.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	92.24	1,715,018.32	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,629	570.00	3,778,530.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	42,837	141.20	6,048,584.40	
	ICA GRUPPEN AB	5,614	440.40	2,472,405.60	
	SWEDISH MATCH AB	9,284	706.20	6,556,360.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,351	303.40	8,905,093.40	
	NORDEA BANK ABP	167,942	70.20	11,789,528.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	85.16	7,521,075.72	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	86.28	6,701,195.04	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	151.68	6,965,297.28	
	EQT AB	15,614	166.30	2,596,608.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,879	239.90	2,609,872.10	
	INVESTOR AB-B SHS	23,614	572.60	13,521,376.40	
KINNEVIK AB-B SHS	13,678	321.50	4,397,477.00		
LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	431.00	1,451,608.00		
ERICSSON LM-B SHS	157,283	98.00	15,413,734.00		
HEXAGON AB-B SHS	14,730	657.80	9,689,394.00		
TELE2 AB-B SHS	25,537	126.05	3,218,938.85		
TELIA CO AB	128,045	34.99	4,480,294.55		
	スウェーデンクローナ 小計	1,354,919		214,202,615.66 (2,600,419,754)	
	EQUINOR ASA	56,499	140.50	7,938,109.50	

ノルウェークローネ	NORSK HYDRO ASA	64,344	27.57	1,773,964.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	365.50	3,291,327.50	
	ADEVINTA ASA-B	14,186	150.20	2,130,737.20	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	342.00	1,874,160.00	
	MOWI ASA	22,242	178.10	3,961,300.20	
	ORKLA ASA	43,456	92.20	4,006,643.20	
	DNB ASA	49,048	136.00	6,670,528.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,840	193.00	1,513,120.00	
	TELENOR ASA	37,498	150.75	5,652,823.50	
ノルウェークローネ 小計		309,598		38,812,713.18 (457,601,888)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	697.60	3,843,078.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	394.60	4,542,635.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,657	955.00	10,177,435.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	9,205.00	1,546,440.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	349	9,932.00	3,466,268.00	
	DSV PANALPINA A S	10,873	988.60	10,749,047.80	
	PANDORA A/S	4,763	497.70	2,370,545.10	
	CARLSBERG AS-B	5,585	862.00	4,814,270.00	
	AMBU A/S-B	8,356	171.35	1,431,800.60	
	COLOPLAST-B	6,052	1,011.00	6,118,572.00	
	DEMANT A/S	4,455	187.95	837,317.25	
	GN STORE NORD A/S	7,299	452.80	3,304,987.20	
	GENMAB A/S	3,317	2,268.00	7,522,956.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	206.20	597,155.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	92,215	419.70	38,702,635.50	
	DANSKE BANK A/S	40,189	90.10	3,621,028.90	
	TRYG A/S	5,752	193.60	1,113,587.20	
ORSTED A/S	9,592	868.00	8,325,856.00		
デンマーククローネ 小計		229,539		113,085,615.35 (1,906,623,474)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	13,386	24.19	323,807.34	
	OIL SEARCH LTD	86,385	2.96	255,699.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	4.82	430,454.92	
	SANTOS LTD	104,239	5.06	527,449.34	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	20.87	110,485.78	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	18.36	924,499.44	
	BHP GROUP LTD	154,814	36.78	5,694,058.92	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	13.00	300,157.00	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	5.60	472,752.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	92,105	18.00	1,657,890.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	24,713	30.12	744,355.56	



NEWCREST MINING LIMITED	42,131	31.24	1,316,172.44
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	38,584	13.03	502,749.52
ORICA LIMITED	17,981	16.98	305,317.38
RIO TINTO LIMITED	19,336	99.08	1,915,810.88
SOUTH32 LTD	299,698	2.15	644,350.70
CIMIC GROUP LTD	4,062	19.95	81,036.90
BRAMBLES LIMITED	88,222	10.40	917,508.80
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	4.27	403,258.80
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	3.92	179,657.52
ARISTOCRAT LEISURE LTD	28,427	28.61	813,296.47
CROWN RESORTS LTD	21,863	9.22	201,576.86
TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	3.56	370,382.40
REA GROUP LTD	2,833	109.91	311,375.03
SEEK LIMITED	18,186	19.12	347,716.32
WESFARMERS LIMITED	59,674	45.08	2,690,103.92
COLES GROUP LIMITED	66,443	16.88	1,121,557.84
WOOLWORTHS GROUP LTD	67,797	36.81	2,495,607.57
COCA-COLA AMATIL LIMITED	34,339	9.10	312,484.90
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	9.09	331,457.76
COCHLEAR LIMITED	3,798	189.23	718,695.54
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	64.18	606,244.28
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	31.66	667,424.46
CSL LIMITED	23,890	281.00	6,713,090.00
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	154,821	17.81	2,757,362.01
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	92,695	66.79	6,191,099.05
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	166,695	17.44	2,907,160.80
WESTPAC BANKING CORPORATION	186,708	17.07	3,187,105.56
AMP LIMITED	223,504	1.52	339,726.08
ASX LTD	11,180	82.47	922,014.60
MACQUARIE GROUP LTD	17,336	126.00	2,184,336.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	56.98	329,515.34
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	4.76	557,810.12
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.50	321,810.00
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	85,523	9.48	810,758.04
SUNCORP GROUP LTD	63,933	9.06	579,232.98
AFTERPAY LTD	11,135	74.05	824,546.75
COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	12.36	345,672.12
WISETECH GLOBAL LTD	7,909	28.08	222,084.72
TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	2.86	620,456.98
TPG TELECOM LTD	17,758	7.54	133,895.32
AGL ENERGY LIMITED	32,492	14.90	484,130.80
AUSNET SERVICES	85,220	1.84	156,804.80

	オーストラリアドル 小計	3,530,184		59,284,008.26 (4,575,539,757)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	57,169	7.01	400,754.69
	A2 MILK CO LTD	37,422	17.84	667,608.48
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	28,678	33.60	963,580.80
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	24,038	13.32	320,186.16
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	108,326	4.78	517,798.28
	MERCURY NZ LTD	46,429	5.04	234,002.16
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,701	4.90	331,734.90
	ニュージーランドドル 小計	369,763		3,435,665.47 (243,623,038)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	150,924	48.75	7,357,545.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	94.90	6,690,450.00
	MTR CORPORATION	84,500	39.95	3,375,775.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	57.55	6,790,900.00
	SANDS CHINA LTD	116,000	32.65	3,787,400.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	10.06	804,800.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	13.72	971,376.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	25.15	2,253,440.00
	WH GROUP LIMITED	534,500	6.53	3,490,285.00
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	46,000	31.30	1,439,800.00
	BANK OF EAST ASIA	87,220	17.02	1,484,484.40
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	22.35	4,190,625.00
	HANG SENG BANK LTD	38,800	121.80	4,725,840.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	64,800	367.60	23,820,480.00
	AIA GROUP LTD	639,400	81.05	51,823,370.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,924	41.20	5,764,868.80
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	20.30	1,989,400.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	29.20	2,434,812.80
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	20.50	563,750.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	39.30	3,333,936.90
	PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVE(NEW)	19,116	1.90	36,320.40
	SINO LAND CO	118,200	9.58	1,132,356.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	100.10	6,806,800.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	40.65	1,097,550.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	20.95	1,110,350.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	31.75	3,238,500.00
	PCCW LIMITED	177,000	4.60	814,200.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	38.30	1,149,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	85,100	75.60	6,433,560.00	
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	8.00	888,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS	577,514	11.46	6,618,310.44	

	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	42.25	3,020,875.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	78.95	971,085.00	
	香港ドル 小計	4,263,915		170,410,245.74	(2,336,324,469)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	4.23	295,677.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	3.44	340,904.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	66,300	0.95	62,985.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	3.58	279,118.28	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.69	225,975.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,200	18.43	151,126.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.33	446,856.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	95,000	20.52	1,949,400.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	169,500	8.57	1,452,615.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,500	19.28	1,243,560.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	8.60	306,160.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	2.73	372,918.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.92	204,336.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.65	144,305.00	
	VENTURE CORP LTD	15,200	19.45	295,640.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	417,915	2.22	927,771.30		
	シンガポールドル 小計	1,733,981		8,699,346.58	(675,939,229)
イスラエルシェケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	12.27	352,283.97	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	430.10	597,408.90	
	BANK HAPOLIM BM	66,403	19.07	1,266,305.21	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	16.25	1,139,937.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	9.96	544,881.08	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	64.80	599,335.20	
	AZRIELI GROUP	2,140	162.10	346,894.00	
	NICE LTD	3,251	739.80	2,405,089.80	
	イスラエルシェケル 小計	235,967		7,252,135.66	(226,774,282)
	合 計	56,594,539		229,758,511,547	(229,758,511,547)

(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 592銘柄	68.6%	71.7%
カナダドル	株式 81銘柄	3.3%	3.5%
ユーロ	株式 240銘柄	10.6%	11.1%
英ポンド	株式 84銘柄	4.3%	4.5%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.4%	3.6%

スウェーデンクローナ	株式	36銘柄	1.1%	1.1%
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	18銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式	53銘柄	1.9%	2.0%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	33銘柄	1.0%	1.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	0.3%	0.3%
イスラエルシケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	361,134.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,496	1,058,068.48	
		AMERICAN TOWER CORP	23,424	5,912,686.08	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,789	497,578.05	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,198	1,125,335.32	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	669,970.85	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	448,238.88	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,825	3,520,154.25	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,603	2,155,110.74	
		DUKE REALTY CORP	21,002	796,395.84	
		EQUINIX INC	4,744	3,574,224.48	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	558,914.64	
		EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,118,099.64	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	728,075.32	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	716,229.66	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,613	286,836.07	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	808,043.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	437,678.85	
		INVITATION HOMES INC	27,735	805,701.75	
		IRON MOUNTAIN INC	14,204	427,114.28	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,595	468,900.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	673,023.20	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	309,832.44	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,454	342,473.04	
PROLOGIS INC	39,654	4,004,260.92			
PUBLIC STORAGE	8,249	1,787,723.28			
REALTY INCOME CORPORATION	17,798	1,150,284.74			
REGENCY CENTERS CORP	8,289	338,771.43			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	15,706	1,081,515.16
	SUN COMMUNITIES INC	5,650	812,131.00
	UDR INC	16,633	573,006.85
	VENTAS INC	21,317	943,064.08
	VEREIT INC	54,273	377,740.08
	VICI PROPERTIES INC	23,498	558,547.46
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	302,098.20
	WELLTOWER INC	22,737	1,384,455.93
	WEYERHAEUSER CO	41,699	1,196,344.31
	WP CAREY INC	8,640	598,838.40
	米ドル 小計	697,184	42,908,602.10 (4,557,751,715)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	174,962.26
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	90,138.42
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	110,573.26
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	75,500.10
	カナダドル 小計	21,543	451,174.04 (36,409,745)
ユーロ	COVIVIO	2,388	146,503.80
	GECINA SA	2,189	246,481.40
	ICADE	2,061	109,336.05
	KLEPIERRE	9,305	127,059.77
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	6,813	269,794.80
	ユーロ 小計	22,756	899,175.82 (112,756,647)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	159,120.51
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	217,720.78
	SEGRO PLC	67,125	634,197.00
	英ポンド 小計	151,948	1,011,038.29 (139,492,952)
オーストラリアドル	APA GROUP	68,344	697,792.24
	DEXUS	54,256	483,963.52
	GOODMAN GROUP	86,301	1,540,472.85
	GPT GROUP	97,296	375,562.56
	LENDLEASE GROUP	40,248	511,954.56
	MIRVAC GROUP	200,053	416,110.24
	SCENTRE GROUP	275,200	599,936.00
	STOCKLAND	127,393	463,710.52
	SYDNEY AIRPORT	73,899	405,705.51
	TRANSURBAN GROUP	145,680	2,001,643.20
	VICINITY CENTRES	250,037	343,800.87

オーストラリアドル 小計		1,418,707	7,840,652.07 (605,141,526)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,111,840.00
	LINK REIT	110,100	6,936,300.00
香港ドル 小計		307,100	9,048,140.00 (124,049,999)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	187,000	617,100.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	219,072.00
	CAPITALAND MALL TRUST	120,700	235,365.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	207,702.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	280,343.00
	SUNTEC REIT	102,700	149,942.00
シンガポールドル 小計		783,800	1,709,524.00 (132,830,014)
合計			5,708,432,598 (5,708,432,598)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 38銘柄	1.9%	79.8%
カナダドル	投資証券 4銘柄	0.0%	0.6%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	2.0%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.4%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.3%	10.6%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 6銘柄	0.1%	2.3%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 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)

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	140,143,911	370,718,639
コール・ローン	2,749,843,134	1,860,156,953
株式	3,398,000,779	6,087,382,618
投資信託受益証券	318,320,512	657,870,238

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
投資証券	116,455,570	205,834,910
派生商品評価勘定	50,715,518	214,083,566
未収入金	44,714	2,257,991
未収配当金	4,472,117	6,842,765
差入委託証拠金	582,977,998	922,777,044
流動資産合計	7,360,974,253	10,327,924,724
資産合計	7,360,974,253	10,327,924,724
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	47,989,704	1,153,550
前受金	33,904,773	208,499,237
未払金	39,177	25,322,599
未払解約金	3,384,498	210,115
未払利息	5,701	5,439
その他未払費用	40,250	35,221
流動負債合計	85,364,103	235,226,161
負債合計	85,364,103	235,226,161
純資産の部		
元本等		
元本	5,738,111,812	7,337,581,576
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,537,498,338	2,755,116,987
元本等合計	7,275,610,150	10,092,698,563
純資産合計	7,275,610,150	10,092,698,563
負債純資産合計	7,360,974,253	10,327,924,724

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,738,111,812口	7,337,581,576口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.2679円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 12,679円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.3755円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 13,755円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,410,757,950	-	3,444,662,723	33,904,773
	MSCIE 1909	3,410,757,950	-	3,444,662,723	33,904,773
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,838,700,000	-	4,827,029,149	11,670,851
	米ドル	4,838,700,000	-	4,827,029,149	11,670,851
	売建	2,106,000,000	-	2,125,508,108	19,508,108
	米ドル	2,106,000,000	-	2,125,508,108	19,508,108
合計		10,355,457,950	-	10,397,199,980	2,725,814

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,947,067,527	-	3,155,566,764	208,499,237
	MSCIE 2009	2,947,067,527	-	3,155,566,764	208,499,237
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,838,600,000	-	1,843,030,779	4,430,779
	米ドル	1,838,600,000	-	1,843,030,779	4,430,779
合計		4,785,667,527	-	4,998,597,543	212,930,016

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2019年 9月10日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,097,381,640円
同期中における追加設定元本額	4,419,235,844円
同期中における一部解約元本額	1,778,505,672円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,604,964,932円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,589,415,686円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	758,605,964円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	762,934,126円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	713,992,914円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,921,629円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	22,116,255円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,881,004円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	64,006,148円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,165,084円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	102,147,560円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,577,205円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	22,383,305円
合計	5,738,111,812円

(2020年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,738,111,812円
同期中における追加設定元本額	4,444,455,197円
同期中における一部解約元本額	2,844,985,433円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,039,160,366円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,948,250,549円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	579,399,262円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	655,141,612円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	465,717,542円
イオン・バランス戦略ファンド	89,568,121円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,281,717円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	44,559,943円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	29,508,476円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	139,550,784円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	98,715,265円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	164,049,308円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,808,915円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,609,064円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	27,260,652円
合計	7,337,581,576円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	6,800	0.67	4,576.40	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,387	5.41	7,503.67	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	2,217	13.14	29,131.38	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	876	46.87	41,058.12	
	51JOB INC-ADR	228	66.10	15,070.80	
	BEST INC-ADR	1,816	3.92	7,118.72	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,840	32.60	125,184.00	
	NIO INC-ADR	9,243	18.09	167,205.87	
	GSX TECHEDU INC- ADR	790	78.59	62,086.10	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,366	44.55	60,855.30	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,459	148.98	217,361.82	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,876	74.28	287,909.28	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	3,657	53.20	194,552.40	

	58.COM INC-ADR	976	55.70	54,363.20
	AUTOHOME INC-ADR	609	85.95	52,343.55
	BAIDU INC - SPON ADR	2,788	119.40	332,887.20
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,206	45.10	54,390.60
	HUYA INC-ADR	661	27.05	17,880.05
	IQIYI INC-ADR	2,310	21.08	48,694.80
	JOYY INC	591	77.16	45,601.56
	MOMO INC-SPON ADR	1,551	14.63	22,691.13
	NETEASE.COM INC -ADR	842	472.01	397,432.42
	SINA CORP	556	39.94	22,206.64
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,772	16.35	61,672.20
	WEIBO CORP-SPON ADR	488	34.13	16,655.44
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	19,221	273.15	5,250,216.15
	BAOZUN INC-SPN-ADR	454	37.87	17,192.98
	JD.COM INC-ADR	8,747	77.19	675,180.93
	PINDUODUO INC-ADR	2,788	84.65	236,004.20
	TRIP.COM GROUP-ADR	4,852	29.64	143,813.28
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	4,524	16.70	75,550.80
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	706	33.37	23,559.22
	ZAI LAB LTD-ADR	535	78.50	41,997.50
	CREDICORP LTD	702	130.84	91,849.68
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	231	28.17	6,507.27
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	0.82	5,841.00
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	808	75.26	60,810.08
	GLOBANT SA	379	173.63	65,805.77
	KE HOLDINGS INC-ADR	936	45.79	42,859.44
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	892	6.96	6,208.32
	米ドル 小計	106,760		9,089,829.27 (965,521,665)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	164,400	6.92	1,137,648.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	33,100	58.54	1,937,674.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,195	362.57	433,271.15
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	8,600	36.76	316,136.00
	ALFA S.A.B. -A	35,300	14.27	503,731.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	42.68	153,648.00
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,985	240.29	476,975.65
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	4,300	162.39	698,277.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,750	158.05	276,587.50
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	27,300	28.00	764,400.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184	65.97	276,018.48
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	54,900	51.04	2,802,096.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	96.33	414,219.00

	BECLE SAB DE CV	6,000	40.83	244,980.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	4,500	86.35	388,575.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,900	120.87	2,405,313.00	
	GRUMA S.A.B. -B	1,920	253.99	487,660.80	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	15,100	40.96	618,496.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	17,600	35.50	624,800.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	26,500	74.15	1,964,975.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	20,200	15.40	311,080.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	346,800	13.20	4,577,760.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	4,300	60.25	259,075.00	
	メキシコペソ 小計	807,734		22,073,396.58	(109,484,047)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,600	78.31	125,296.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	38,100	23.02	877,062.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	48,700	22.73	1,106,951.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,500	21.88	164,100.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,800	22.17	39,906.00	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. -CSN	7,100	15.81	112,251.00	
	GERDAU S.A. -PREF	11,100	20.53	227,883.00	
	SUZANO SA	5,615	47.05	264,185.75	
	VALE SA	37,800	60.00	2,268,000.00	
	WEG SA	8,830	64.93	573,331.90	
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	13,800	14.80	204,240.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	6,600	54.87	362,142.00	
	RUMO SA	11,800	22.08	260,544.00	
	COGNA EDUCACAO	14,100	5.90	83,190.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,261	102.80	232,430.80	
	LOJAS AMERICANAS SA	9,900	30.91	306,009.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,180	46.11	377,179.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,700	91.20	702,240.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,600	23.09	198,574.00	
	VIA VAREJO SA	14,000	18.51	259,140.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	3,100	20.87	64,697.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	1,300	62.15	80,795.00	
	RAIA DROGASIL SA	2,200	113.42	249,524.00	
	AMBEV SA	48,300	12.35	596,505.00	
	BRF-BRASIL FOODS SA	5,900	19.88	117,292.00	
	JBS SA	11,200	22.00	246,400.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,700	50.72	390,544.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,300	68.29	157,067.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	4,900	75.17	368,333.00	
	HYPERMARCAS SA	3,900	31.62	123,318.00	

	BANCO BRADESCO S.A. -PREF	45,342	21.56	977,573.52	
	BANCO BRADESCO SA	13,608	19.98	271,887.84	
	BANCO DO BRASIL S.A.	8,800	33.22	292,336.00	
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	49,600	24.43	1,211,728.00	
	ITAUSA SA	45,180	9.68	437,342.40	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,300	81.51	187,473.00	
	BM&F BOVESPA SA	21,100	58.26	1,229,286.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	6,400	26.60	170,240.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	9,800	6.51	63,798.00	
	PORTO SEGURO SA	600	52.75	31,650.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	2,400	22.80	54,720.00	
	CIELO SA	9,300	4.69	43,617.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	4,100	50.30	206,230.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	7,200	15.28	110,016.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	3,800	36.38	138,244.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	3,100	36.82	114,142.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,808	11.19	87,371.52	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	66.29	72,919.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	3,900	50.10	195,390.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,400	30.44	73,056.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,800	44.81	80,658.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	45.30	115,515.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,400	24.12	202,608.00	
	ブラジルリアル 小計	616,474		17,506,932.53 (350,313,719)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,447	5,751.00	25,574,697.00	
	EMPRESAS CMPC SA	13,085	1,591.10	20,819,543.50	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	1,273	24,895.00	31,691,335.00	
	FALABELLA SA	7,291	2,440.00	17,790,040.00	
	CENCOSUD SA	12,537	1,195.00	14,981,715.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,243.50	8,316,191.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	3,386	1,798.00	6,088,028.00	
	BANCO DE CHILE	504,308	64.02	32,285,798.16	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	640	24,615.00	15,753,600.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	567,731	29.84	16,941,093.04	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,523	1,250.00	6,903,750.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,200	5,039.00	6,046,800.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	20,335	233.50	4,748,222.50	
	COLBUN SA	61,705	130.40	8,046,332.00	
	ENEL AMERICAS SA	372,802	111.55	41,586,063.10	
	ENEL CHILE SA	227,542	56.71	12,903,906.82	
		1,805,391		270,477,115.12	

	チリペソ 小計			(37,434,032)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	52,363	2,080.00	108,915,040.00
	BANCOLOMBIA SA	2,212	27,140.00	60,033,680.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,623	27,400.00	126,670,200.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	23,760.00	70,947,360.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,229	20,800.00	87,963,200.00
	コロンビアペソ 小計	66,413		454,529,480.00 (12,999,543)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	599	11.29	6,762.71
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.39	539.97
	OPAP SA	1,968	8.10	15,950.64
	JUMBO S.A.	1,055	14.62	15,424.10
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,584	13.08	33,798.72
	ユーロ 小計	6,329		72,476.14 (9,088,507)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,004	84.85	85,189.40
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	12,606	9.03	113,832.18
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	16.56	139,965.12
	KOC HOLDING AS	6,107	14.84	90,627.88
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	10.85	48,532.05
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	734	86.30	63,344.20
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,002	68.20	341,136.40
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	2,205	19.91	43,901.55
	AKBANK T.A.S.	29,334	4.89	143,443.26
	TURKIYE GARANTI BANKASI	27,208	6.76	183,926.08
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	5.02	48,598.62
	YAPI VE KREDI BANKASI	32,206	2.05	66,022.30
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,157	7.89	56,468.73
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	8,901	14.43	128,441.43
	トルコリラ 小計	155,070		1,553,429.20 (22,043,160)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	707	520.00	367,640.00
	MONETA MONEY BANK AS	6,590	53.50	352,565.00
	CEZ AS	1,650	448.00	739,200.00
	チェココルナ 小計	8,947		1,459,405.00 (6,902,985)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,501	1,664.00	5,825,664.00
	RICHTER GEDEON NYRT	1,084	7,215.00	7,821,060.00
	OTP BANK PLC	1,972	10,460.00	20,627,120.00
	ハンガリーフォリント 小計	6,557		34,273,844.00 (12,040,401)
	GRUPA LOTOS SA	941	39.51	37,178.91



ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	3,061	49.44	151,335.84
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	17,726	5.32	94,408.67
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,523	137.40	209,260.20
	LPP SA	12	7,290.00	87,480.00
	CD PROJEKT SA	708	432.00	305,856.00
	CYFROWY POLSAT SA	3,380	26.86	90,786.80
	DINO POLSKA SA	501	221.80	111,121.80
	BANK PEKAO SA	1,879	50.86	95,565.94
	MBANK SA	79	180.00	14,220.00
	PKO BANK POLSKI SA	8,947	21.24	190,034.28
	SANTANDER BANK POLSKA SA	360	146.00	52,560.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	6,181	27.48	169,853.88
	ORANGE POLSKA SA	6,710	7.19	48,244.90
	PGE SA	7,070	5.80	41,034.28
	ポーランドズロチ 小計	59,078		1,698,941.50 (47,961,118)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	14,000	5.55	77,700.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	248,000	3.42	848,160.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	35,000	13.24	463,400.00
	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	3.42	27,360.00
	CNOOC LTD	183,000	8.15	1,491,450.00
	PETROCHINA CO LTD	216,000	2.53	546,480.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	16,000	5.86	93,760.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	40,000	1.87	74,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	12,500	55.75	696,875.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	4.83	55,545.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	36,000	2.99	107,640.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	40,000	10.52	420,800.00
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	26,000	11.64	302,640.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	12,000	9.68	116,160.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	13,000	4.57	59,410.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	14,000	9.24	129,360.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	1.57	28,260.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	10,000	8.45	84,500.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	5.22	302,760.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	26,000	4.62	120,120.00
	BOC AVIATION LTD	1,900	59.45	112,955.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	41,000	4.11	168,510.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	5.04	100,800.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	17,000	34.65	589,050.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	10,000	14.02	140,200.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	45,000	3.84	172,800.00

CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	24,500	5.76	141,120.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	18,000	6.22	111,960.00
CITIC LIMITED	63,000	6.82	429,660.00
CRRC CORP LTD-H	42,000	3.23	135,660.00
FOSUN INTERNATIONAL	23,500	8.52	200,220.00
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	7,000	18.96	132,720.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	26,000	2.16	56,160.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	5,000	11.36	56,800.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	7,500	3.45	25,875.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,500	21.20	137,800.00
WEICHAJ POWER CO	18,000	14.90	268,200.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	6.21	41,097.78
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	6,600	25.35	167,310.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	7.51	97,630.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	5,000	35.70	178,500.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	43,000	4.42	190,060.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	14,000	50.45	706,300.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	18,000	9.34	168,120.00
AIR CHINA/HONG KONG	16,000	5.87	93,920.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	20,000	5.02	100,400.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	22,000	4.43	97,460.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	18,000	3.71	66,780.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	16,140	8.73	140,902.20
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.80	115,200.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	24,000	4.74	113,760.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	8.01	80,100.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	6,000	7.19	43,140.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	13,000	12.36	160,680.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	5.36	64,320.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	15,500	3.33	51,615.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	6.71	201,300.00
BYD CO LTD-H	6,500	79.15	514,475.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	32,000	5.25	168,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	4,800	25.40	121,920.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	60,000	15.94	956,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	35,000	9.27	324,450.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	33,200	6.73	223,436.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	11,000	74.00	814,000.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	26,000	2.07	53,820.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	12,000	25.45	305,400.00
LI NING COMPANY LIMITED	21,500	31.65	680,475.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,700	124.40	1,082,280.00

CHINA EAST EDUCATION HOLDING	4,000	17.16	68,640.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	6,000	14.14	84,840.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	6.81	81,720.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	9,000	52.15	469,350.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	33.55	83,875.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	1.13	124,300.00
CHINA LITERATURE LTD	3,000	53.60	160,800.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	58,600	504.00	29,534,400.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	99,000	1.00	99,000.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	36,500	232.00	8,468,000.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	13.66	114,744.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	11,000	9.22	101,420.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	46.70	280,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	9.23	226,135.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	87.28	96,008.00
CHINA FEIHE LTD	12,000	16.34	196,080.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	28,000	36.05	1,009,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	14,000	48.50	679,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.71	91,845.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	20,000	14.60	292,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	63.95	255,800.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	13,000	7.15	92,950.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	51,000	5.44	277,440.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	5,000	105.50	527,500.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	6,500	58.65	381,225.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	25.10	100,400.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	18.38	73,520.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	34,000	17.40	591,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	3,800	109.90	417,620.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	17.32	415,680.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	13.34	102,718.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	13,600	18.14	246,704.00
3SBIO INC	10,500	8.45	88,725.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	182.30	109,380.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	17,000	8.90	151,300.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	58,000	15.58	903,640.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	4.13	49,560.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	22,000	3.21	70,620.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	13.98	139,800.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	12,000	35.00	420,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	9,500	57.10	542,450.00
LUYE PHARMA GROUP	18,500	4.62	85,470.00

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	5,000	31.00	155,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	106,000	8.78	930,680.00
SSY GROUP LIMITED	10,000	4.65	46,500.00
WUXI APPTec CO LTD	2,776	106.10	294,533.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	10,500	178.60	1,875,300.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	283,000	2.57	727,310.00
BANK OF CHINA LTD	812,000	2.57	2,086,840.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	90,000	3.99	359,100.00
CHINA CITIC BANK	91,000	3.22	293,020.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	983,000	5.50	5,406,500.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	34,000	2.71	92,140.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	40,000	38.55	1,542,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	59,600	4.64	276,544.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	24,000	3.17	76,080.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	621,000	4.39	2,726,190.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	102,000	3.53	360,060.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	90,000	1.48	133,200.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	11.40	91,200.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	36,000	4.22	151,920.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	92,000	0.82	75,440.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	13,600	17.20	233,920.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	22,000	17.62	387,640.00
FAR EAST HORIZON LTD	18,000	6.93	124,740.00
GF SECURITIES CO LTD-H	10,600	9.44	100,064.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	5,000	11.34	56,700.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	28,000	6.73	188,440.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	14,000	12.68	177,520.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	76,000	18.36	1,395,360.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	28,400	22.10	627,640.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	0.80	24,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	16,600	12.28	203,848.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	8,500	30.30	257,550.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	85,000	2.46	209,100.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	70,000	6.01	420,700.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	61,000	81.00	4,941,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,800	43.70	166,060.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	12,000	10.24	122,880.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	8.38	75,420.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	20,000	16.30	326,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	62,000	4.79	296,980.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	40,500	21.35	864,675.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	6.61	99,150.00

CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	35.35	1,131,200.00
CHINA VANKE CO LTD -H	18,500	24.75	457,875.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	30,000	6.08	182,400.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	79,000	9.55	754,450.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	10.02	116,232.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	4.09	85,890.00
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	12,500	13.98	174,750.00
LOGAN GROUP COMPANY LIMITED	16,000	13.04	208,640.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	19,000	41.35	785,650.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	1,200	65.00	78,000.00
SEAZEN GROUP LTD	20,000	6.50	130,000.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	42,000	2.42	101,640.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	13,500	32.80	442,800.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	1.77	33,630.00
SOHO CHINA LTD	24,500	2.33	57,085.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	26,000	31.50	819,000.00
WHARF HOLDINGS LTD	17,000	14.26	242,420.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	88,000	1.47	129,360.00
YUZHOU GROUP HOLDINS CO LTD	17,000	3.47	58,990.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	4.56	63,840.00
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	24,000	17.34	416,160.00
KINGSOFT CORPORATION LTD.	8,000	37.20	297,600.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	8,000	16.74	133,920.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	7,500	47.30	354,750.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	7,000	37.30	261,100.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	2.98	29,800.00
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	7,000	26.05	182,350.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	10.44	73,080.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	4,900	10.14	49,686.00
LENOVO GROUP LTD	74,000	5.06	374,440.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	7,300	117.40	857,020.00
XIAOMI CORP-CLASS B	107,600	22.10	2,377,960.00
ZTE CORPORATION	7,800	19.50	152,100.00
CHINA MOBILE LTD	63,000	53.85	3,392,550.00
CHINA TELECOM CORP LTD	134,000	2.56	343,040.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	454,000	1.50	681,000.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	62,000	5.42	336,040.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	6,000	24.55	147,300.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	60,000	3.13	187,800.00
CGN POWER CO LTD-H	93,000	1.63	151,590.00
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	27,800	22.30	619,940.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	27,000	4.83	130,410.00

	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.47	54,390.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	10,000	36.55	365,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	22,000	8.86	194,920.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,400	85.85	721,140.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	32,000	12.68	405,760.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	44,000	3.06	134,640.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	44,000	5.16	227,040.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	5,000	24.60	123,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	36,000	18.42	663,120.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	42,000	9.11	382,620.00	
	香港ドル 小計	8,980,234		115,331,342.58 (1,581,192,706)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	36,200	3.64	131,768.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,000	21.18	63,540.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	27,000	5.60	151,200.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	13,100	5.20	68,120.00	
	GAMUDA BHD	13,300	3.50	46,550.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	7.45	60,345.00	
	SIME DARBY BERHAD	23,500	2.30	54,050.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	8,300	5.08	42,164.00	
	MISC BHD	11,800	7.52	88,736.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	3.90	39,000.00	
	GENTING BHD	25,800	3.57	92,106.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	26,600	2.32	61,712.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,200	19.60	23,520.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	32.00	38,400.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	2,500	10.00	25,000.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	22,800	4.43	101,004.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	5,000	22.32	111,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	140.80	84,480.00	
	PPB GROUP BERHAD	6,040	18.56	112,102.40	
	QL RESOURCES BHD	8,700	9.54	82,998.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,900	5.12	122,368.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	18,100	13.00	235,300.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	20,500	5.35	109,675.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	7,500	10.96	82,200.00	
	SUPERMAX CORP BHD	16,600	7.48	124,168.00	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	49,500	7.15	353,925.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	17,000	3.00	51,000.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	66,000	3.20	211,200.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,600	14.78	97,548.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	13.90	26,410.00	

	MALAYAN BANKING BERHAD	40,200	7.45	299,490.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	29,800	16.10	479,780.00	
	RHB BANK BHD	16,400	4.66	76,424.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,600	3.11	101,386.00	
	DIGI.COM BHD	28,700	4.07	116,809.00	
	MAXIS BERHAD	26,800	5.04	135,072.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,200	4.15	34,030.00	
	PETRONAS GAS BHD	8,900	16.60	147,740.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	24,500	11.18	273,910.00	
	YTL CORP BHD	16,000	0.65	10,400.00	
	マレーシアリングット 小計	714,440		4,567,230.40 (116,464,375)	
タイパーツ	IRPC PCL-NVDR	121,100	2.24	271,264.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	15,400	83.25	1,282,050.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	119,600	35.25	4,215,900.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	9,100	38.75	352,625.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	14,200	23.10	328,020.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	25,200	44.00	1,108,800.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	8,200	365.00	2,993,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	45,700	58.00	2,650,600.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	72,400	9.00	651,600.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	90,600	10.00	906,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	69,600	3.88	270,048.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	36,600	22.40	819,840.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,891	28.00	584,948.00	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	55,300	14.70	812,910.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	10,200	37.25	379,950.00	
	CP ALL PCL-NVDR	59,700	62.50	3,731,250.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	39,600	29.75	1,178,100.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	7,000	38.50	269,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	31,900	14.10	449,790.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	97,500	20.40	1,989,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	5,400	108.00	583,200.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	5,900	107.50	634,250.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	12,000	82.75	993,000.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	5,500	82.75	455,125.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	9.45	275,940.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	8,700	71.50	622,050.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	135,700	0.91	123,487.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,000	21.70	390,600.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,500	30.50	259,250.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	50.75	385,700.00	

	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	6,300	48.25	303,975.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	25,200	45.50	1,146,600.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	81,200	7.20	584,640.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	12,200	180.50	2,202,100.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	24,900	54.75	1,363,275.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	34.25	157,550.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	150,000	3.26	489,000.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	44.50	302,600.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	2,500	212.00	530,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	14,700	41.00	602,700.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	5,800	62.75	363,950.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT RTS NEW	2,000	3.86	7,720.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	20,000	31.75	635,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	7,900	54.25	428,575.00	
	タイパーツ 小計	1,550,391		39,085,482.00	(132,890,638)
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	16,450	48.40	796,180.00	
	AYALA CORPORATION	3,110	716.00	2,226,760.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	600	404.80	242,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	31,850	61.70	1,965,145.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,645	887.00	2,346,115.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,770	105.60	1,242,912.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	4,110	136.80	562,248.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	6,100	50.50	308,050.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,180	142.90	1,454,722.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	7,737	65.25	504,839.25	
	BDO UNIBANK INC	22,020	91.25	2,009,325.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,040	34.55	450,532.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.50	388,150.00	
	AYALA LAND INC	88,200	29.75	2,623,950.00	
	MEGAWORLD CORP	92,000	3.06	281,520.00	
	ROBINSONS LAND CO	17,200	14.60	251,120.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	108,800	28.30	3,079,040.00	
	GLOBE TELECOM INC	335	2,132.00	714,220.00	
	PLDT INC	830	1,446.00	1,200,180.00	
	ABOITIZ POWER CORP	12,000	27.00	324,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,340	265.00	620,100.00	
	フィリピン 小計	562,217		23,591,988.25	(51,430,534)
インドネシア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	1,200.00	139,080,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	19,300	22,650.00	437,145,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	208,200	800.00	166,560,000.00	



	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	29,700	8,775.00	260,617,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	11,650.00	153,780,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	28,900	10,100.00	291,890,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	216,200	4,900.00	1,059,380,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	66,900	1,580.00	105,702,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	83,400	6,000.00	500,400,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	21,200	10,275.00	217,830,000.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	45,550.00	182,200,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	79,100	1,625.00	128,537,500.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	51,300	7,575.00	388,597,500.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	79,100	8,250.00	652,575,000.00	
	KALBE FARMA PT	246,100	1,555.00	382,685,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	76,300	5,025.00	383,407,500.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	100,800	31,225.00	3,147,480,000.00	
	PT BANK MANDIRI	190,900	5,775.00	1,102,447,500.00	
	PT BANK RAKYAT	567,600	3,410.00	1,935,516,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	518,600	2,800.00	1,452,080,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	35,400	2,190.00	77,526,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	65,600	1,120.00	73,472,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,817,700		13,238,909,000.00 (95,320,144)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	421	33,150.00	13,956,150.00	
	S-OIL CORPORATION	422	56,000.00	23,632,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	592	146,000.00	86,432,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	970	48,650.00	47,190,500.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	1,044	24,700.00	25,786,800.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	97	401,000.00	38,897,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	227	103,000.00	23,381,000.00	
	LG CHEM LTD	474	699,000.00	331,326,000.00	
	LG CHEM LTD	89	347,500.00	30,927,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	161	208,500.00	33,568,500.00	
	POSCO	779	185,000.00	144,115,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	201	86,700.00	17,426,700.00	
	CJ CORP	168	82,300.00	13,826,400.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	255	94,900.00	24,199,500.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	415	22,600.00	9,379,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	664	27,100.00	17,994,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	512	25,250.00	12,928,000.00	
	HANWHA CORPORATION	575	30,200.00	17,365,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	921	32,200.00	29,656,200.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	114	223,500.00	25,479,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	596	23,250.00	13,857,000.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	361	86,500.00	31,226,500.00
LG CORP	1,017	79,500.00	80,851,500.00
LOTTE CORPORATION	301	30,000.00	9,030,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	441	13,750.00	6,063,750.00
SAMSUNG C&T CORPORATION	896	108,000.00	96,768,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,267	11,200.00	14,190,400.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	4,593	5,270.00	24,205,110.00
SK HOLDINGS CO LTD	375	210,000.00	78,750,000.00
S1 CORPORATION	219	88,100.00	19,293,900.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	158,000.00	11,692,000.00
GLOVIS CO LTD	153	135,000.00	20,655,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,030	18,400.00	18,952,000.00
PAN OCEAN CO LTD	2,212	3,315.00	7,332,780.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	611	31,250.00	19,093,750.00
HANON SYSTEMS	1,587	12,400.00	19,678,800.00
HYUNDAI MOBIS	699	223,500.00	156,226,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	1,554	167,500.00	260,295,000.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	419	82,700.00	34,651,300.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	180	82,500.00	14,850,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	2,788	42,100.00	117,374,800.00
COWAY CO LTD	538	79,100.00	42,555,800.00
FILA HOLDINGS CORP	358	38,500.00	13,783,000.00
HLB INC	405	105,000.00	42,525,000.00
LG ELECTRONICS INC	1,134	90,200.00	102,286,800.00
KANGWON LAND INC	845	21,100.00	17,829,500.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	19,000.00	10,127,000.00
KAKAO CORP	589	384,000.00	226,176,000.00
NAVER CORPORATION	1,271	304,500.00	387,019,500.00
NCSOFT CORP	173	791,000.00	136,843,000.00
NETMARBLE CORPORATION	211	189,000.00	39,879,000.00
PEARLABYSS CORP	54	196,700.00	10,621,800.00
CJ ENM CO LTD	144	125,700.00	18,100,800.00
HOTEL SHILLA CO LTD	258	72,400.00	18,679,200.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	78,100.00	4,686,000.00
SHINSEGAE CO LTD	63	207,000.00	13,041,000.00
BGF RETAIL CO LTD	61	121,000.00	7,381,000.00
E-MART INC	171	138,000.00	23,598,000.00
GS RETAIL CO LTD	290	32,700.00	9,483,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	85	375,500.00	31,917,500.00
KT&G CORPORATION	1,193	84,100.00	100,331,300.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	243	137,000.00	33,291,000.00
OTTOGI CORPORATION	4	587,000.00	2,348,000.00

AMOREPACIFIC CORP	329	167,000.00	54,943,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	60,400.00	1,993,200.00
AMOREPACIFIC GROUP	240	50,300.00	12,072,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	96	1,510,000.00	144,960,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	708,000.00	12,036,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	697	98,600.00	68,724,200.00
ALTEOGEN INC	208	200,300.00	41,662,400.00
CELLTRION INC	979	298,500.00	292,231,500.00
CELLTRION PHARM INC	170	117,200.00	19,924,000.00
HANMI PHARM CO LTD	55	294,500.00	16,197,500.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	174	759,000.00	132,066,000.00
SEEGENE INC	204	242,100.00	49,388,400.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	334	139,500.00	46,593,000.00
YUHAN CORPORATION	479	64,000.00	30,656,000.00
BS FINANCIAL GROUP INC	2,009	5,080.00	10,205,720.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	3,070	27,700.00	85,039,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,644	8,130.00	21,495,720.00
KB FINANCIAL GROUP INC	4,039	37,500.00	151,462,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	4,686	28,400.00	133,082,400.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,539	8,420.00	46,638,380.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	427	76,100.00	32,494,700.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	3,225.00	5,095,500.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,873	9,100.00	26,144,300.00
SAMSUNG CARD CO LTD	310	28,650.00	8,881,500.00
SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD.	639	31,050.00	19,840,950.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	9,190.00	6,874,120.00
DB INSURANCE CO LTD	507	44,650.00	22,637,550.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	648	22,400.00	14,515,200.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	315	186,000.00	58,590,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	656	63,200.00	41,459,200.00
DUZONBIZON CO LTD	190	115,000.00	21,850,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	356	177,000.00	63,012,000.00
KMW CO LTD	241	83,900.00	20,219,900.00
LG DISPLAY CO LTD	2,378	15,950.00	37,929,100.00
LG INNOTEK CO LTD	115	166,000.00	19,090,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	573	144,000.00	82,512,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	48,873	58,400.00	2,854,183,200.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,414	49,500.00	416,493,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	563	429,500.00	241,808,500.00
LG UPLUS CORP	1,886	11,850.00	22,349,100.00
SK TELECOM CO LTD	405	238,000.00	96,390,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	2,821	20,300.00	57,266,300.00

	KOREA GAS CORPORATION	265	23,400.00	6,201,000.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	5,633	77,300.00	435,430,900.00	
	韓国ウォン 小計	146,575		9,297,646,880.00	(834,928,689)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	11,000	81.20	893,200.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	22,000	42.60	937,200.00	
	CHINA STEEL CORP	126,000	21.00	2,646,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	37,000	69.80	2,582,600.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	40,000	79.20	3,168,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	54,000	61.00	3,294,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	50,073	42.55	2,130,606.15	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION-NEW	2,004	42.55	85,270.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	665.00	665,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	25,000	26.90	672,500.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,060	328.00	1,003,680.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP-NEW	61	328.00	20,008.00	
	EVA AIRWAYS CORP	18,897	11.80	222,984.60	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	22,740	19.00	432,060.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	17,000	32.15	546,550.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	21,000	38.45	807,450.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	2,000	373.00	746,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,200	167.00	701,400.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD NEW	440	167.00	73,480.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	8,000	30.90	247,200.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	3,000	293.00	879,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	319.00	638,000.00	
	POU CHEN	19,000	27.30	518,700.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	603.00	1,809,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	265.00	1,590,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	63.10	126,200.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	49,000	65.30	3,199,700.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	46,253	17.75	820,990.75	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK(NEW)	1,850	17.75	32,837.50	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	179,000	18.80	3,365,200.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	115,860	26.60	3,081,876.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	102,863	20.90	2,149,836.70	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO-NEW	2,545	20.90	53,190.50		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	81,359	18.00	1,464,462.00		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS NEW	3,774	18.00	67,932.00		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	111,000	28.75	3,191,250.00		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	103,760	10.90	1,130,984.00		
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	100,485	13.00	1,306,305.00		

TAIWAN BUSINESS BANK	46,502	9.90	460,369.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	93,276	19.85	1,851,528.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING-NEW	2,318	19.85	46,012.30
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	34,299	40.55	1,390,824.45
CHAILEASE HOLDING CO LTD	12,632	130.50	1,648,476.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	96,000	18.20	1,747,200.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD (NEW)	3,160	18.20	57,512.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	81,000	39.45	3,195,450.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	130,000	8.60	1,118,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	21,540	20.15	434,031.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	68,000	42.25	2,873,000.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	113,432	8.36	948,291.52
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	46.15	276,900.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	5,800	41.40	240,120.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD NEW	2,900	41.40	120,060.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	218.50	1,311,000.00
ACER INC	34,000	24.80	843,200.00
ADVANTECH CO LTD	4,299	283.00	1,216,617.00
ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	247.50	1,980,000.00
AU OPTRONICS CORP	78,000	12.40	967,200.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	188.00	1,316,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	7,010	86.20	604,262.00
COMPAL ELECTRONICS	37,000	19.00	703,000.00
DELTA ELECTRONICS INC	20,000	184.00	3,680,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	52.10	364,700.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	127,800	77.90	9,955,620.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	95,000	10.15	964,250.00
INVENTEC CORPORATION	24,000	22.60	542,400.00
LARGAN PRECISION CO LTD	1,080	3,505.00	3,785,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	24,000	46.15	1,107,600.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	6,000	135.00	810,000.00
PEGATRON CORP	22,000	63.20	1,390,400.00
QUANTA COMPUTER INC	31,000	74.40	2,306,400.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	16,000	42.90	686,400.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	161.50	484,500.00
WISTRON CORPORATION	25,293	30.45	770,171.85
WIWYNN CORP	1,000	665.00	665,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	15,520	40.30	625,456.00
YAGEO CORPORATION	4,198	350.50	1,471,399.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	7,000	121.00	847,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	39,000	108.50	4,231,500.00
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	16,000	62.10	993,600.00

	TAIWAN MOBILE CO LTD	17,000	100.00	1,700,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,000	62.00	2,108,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	392.50	785,000.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	15,000	595.00	8,925,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	54.20	542,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	6,000	237.50	1,425,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	276.50	276,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	87.50	525,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	356.00	1,780,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	1,700.00	1,700,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	252,000	427.00	107,604,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	119,000	23.70	2,820,300.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	10,000	96.20	962,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	287.50	862,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	20,000	13.60	272,000.00	
	新台湾ドル 小計	3,282,283		240,618,804.92 (871,040,073)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,256	405.95	2,945,573.20	
	COAL INDIA LTD	12,603	126.95	1,599,950.85	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,413	193.75	1,436,268.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	19,253	80.55	1,550,829.15	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	23,617	72.70	1,716,955.90	
	PETRONET LNG LTD	6,135	235.55	1,445,099.25	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	29,286	2,161.35	63,297,296.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	6,833	209.45	1,431,171.85	
	ASIAN PAINTS LTD	3,066	1,979.05	6,067,767.30	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,004	561.80	1,125,847.20	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,391	687.10	2,329,956.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	13,229	182.80	2,418,261.20	
	JSW STEEL LTD	9,521	286.85	2,731,098.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,414	1,459.05	2,063,096.70	
	SHREE CEMENT LTD	82	19,401.50	1,590,923.00	
	TATA STEEL LTD	3,137	417.40	1,309,383.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,240	3,835.60	4,756,144.00	
	UPL LTD	5,579	494.55	2,759,094.45	
	VEDANTA LTD	20,944	127.95	2,679,784.80	
	HAVELLS INDIA LTD	2,221	641.40	1,424,549.40	
	LARSEN & TOUBRO LTD	5,137	909.50	4,672,101.50	
	SIEMENS LTD	617	1,198.30	739,351.10	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,400	343.85	1,512,940.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	1,604	375.10	601,660.40	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	676	1,248.50	843,986.00	

BAJAJ AUTO LTD	657	2,910.15	1,911,968.55
BHARAT FORGE LTD	2,003	465.95	933,297.85
BOSCH LIMITED	55	12,778.10	702,795.50
EICHER MOTORS LTD	1,479	2,176.95	3,219,709.05
HERO MOTOCORP LTD	912	2,904.00	2,648,448.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	8,025	613.90	4,926,547.50
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	1,271	7,215.25	9,170,582.75
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,442	109.80	817,131.60
TATA MOTORS LTD	19,134	140.10	2,680,673.40
PAGE INDUSTRIES LTD	46	18,503.85	851,177.10
TITAN CO LTD	3,396	1,161.10	3,943,095.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	718	2,225.85	1,598,160.30
INFO EDGE INDIA LTD	626	3,279.70	2,053,092.20
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	8,839	221.55	1,958,280.45
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,590	2,222.70	3,534,093.00
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	590	3,738.30	2,205,597.00
ITC LIMITED	30,171	183.80	5,545,429.80
NESTLE INDIA LTD	237	16,312.50	3,866,062.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	4,145	534.75	2,216,538.75
UNITED SPIRITS LTD	2,972	550.45	1,635,937.40
COLGATE PALMOLIVE INDIA	573	1,365.80	782,603.40
DABUR INDIA LIMITED	5,421	492.35	2,669,029.35
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,181	672.85	2,813,185.85
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	8,409	2,132.25	17,930,090.25
MARICO LTD	4,621	364.00	1,682,044.00
AUROBINDO PHARMA LIMITED	2,683	801.85	2,151,363.55
BIOCON LTD	2,930	427.90	1,253,747.00
CIPLA LTD	3,110	727.55	2,262,680.50
DIVI'S LABORATORIES LTD	814	3,157.10	2,569,879.40
DR.REDDY'S LABORATORIES	1,225	4,429.45	5,426,076.25
LUPIN LTD	2,078	941.10	1,955,605.80
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	909	1,295.85	1,177,927.65
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	9,053	509.30	4,610,692.90
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	502	2,807.80	1,409,515.60
AXIS BANK LIMITED	23,155	431.25	9,985,593.75
BANDHAN BANK LTD	7,410	300.85	2,229,298.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	16,825	1,760.75	29,624,618.75
ICICI BANK LIMITED	52,165	367.60	19,175,854.00
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,812	286.75	806,341.00
STATE BANK OF INDIA	18,252	194.85	3,556,402.20
BAJAJ FINANCE LIMITED	1,840	3,422.85	6,298,044.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	522	2,370.75	1,237,531.50

	REC LTD	5,374	106.45	572,062.30
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	785	638.85	501,497.25
	BAJAJ FINSERV LTD	391	6,026.80	2,356,478.80
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	7,226	585.70	4,232,268.20
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	1,878	1,217.95	2,287,310.10
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,524	434.40	1,530,825.60
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,090	830.50	3,396,745.00
	DLF LIMITED	4,986	150.10	748,398.60
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,099	721.95	8,012,923.05
	INFOSYS LIMITED	34,841	927.75	32,323,737.75
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	9,209	2,327.65	21,435,328.85
	TECH MAHINDRA LTD	4,742	753.35	3,572,385.70
	WIPRO LTD	11,685	282.85	3,305,102.25
	BHARTI AIRTEL LIMITED	12,929	504.25	6,519,448.25
	BHARTI INFRATEL LTD	3,387	210.45	712,794.15
	GAIL INDIA LIMITED	13,856	91.05	1,261,588.80
	INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	391.50	845,640.00
	NTPC LTD	26,678	90.40	2,411,691.20
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	20,048	175.25	3,513,412.00
	インドルピー 小計	633,344		392,615,472.20 (573,218,589)
エジプトボンド	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	7.05	38,457.75
	EASTERN TOBACCO	8,610	12.02	103,492.20
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	14,860	66.99	995,471.40
	エジプトボンド 小計	28,925		1,137,421.35 (7,643,471)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	1,848	134.35	248,278.80
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	597	1,262.68	753,819.96
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	4,375	475.21	2,079,043.75
	GOLD FIELDS LIMITED	9,296	218.31	2,029,409.76
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,114	102.96	629,497.44
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	8,530	156.51	1,335,030.30
	KUMBA IRON ORE LTD	490	512.00	250,880.00
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,014	165.40	663,915.60
	SASOL LTD.	6,146	136.99	841,940.54
	SIBANYE STILLWATER LTD	24,409	54.93	1,340,786.37
	BIDVEST GROUP LTD	2,459	150.13	369,169.67
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,230	90.23	381,672.90
	MR PRICE GROUP LTD	2,037	132.05	268,985.85
	NASPERS LIMITED-N SHS	4,471	2,882.49	12,887,612.79
	PEPKOR HOLDINGS LTD	7,054	10.87	76,676.98
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	7,756	34.13	264,712.28



BID CORP LTD	3,630	266.30	966,669.00
CLICKS GROUP LTD	2,773	240.66	667,350.18
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	4,662	141.94	661,724.28
SPAR GROUP LIMITED	1,720	175.82	302,410.40
TIGER BRANDS LTD	1,629	183.81	299,426.49
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	10,359	17.93	185,736.87
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	4,363	139.45	608,420.35
ABSA GROUP LTD	8,051	89.18	717,988.18
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	627	961.60	602,923.20
NEDBANK GROUP LTD	2,834	100.83	285,752.22
STANDARD BANK GROUP LIMITED	13,765	114.64	1,578,019.60
FIRSTRAND LIMITED	50,188	41.00	2,057,708.00
REINET INVESTMENTS SCA	1,681	312.96	526,085.76
REMGRO LTD	4,353	92.28	401,694.84
DISCOVERY LTD	4,482	132.19	592,475.58
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	8,911	15.81	140,882.91
OLD MUTUAL LTD	52,788	11.55	609,701.40
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	5,957	31.59	188,181.63
SANLAM LTD	16,620	56.56	940,027.20
NEPI ROCKCASTLE PLC	3,006	72.00	216,432.00
NEPI ROCKCASTLE PLC-NEW	129	72.00	9,288.00
MTN GROUP LIMITED	18,216	60.50	1,102,068.00
VODACOM GROUP LIMITED	6,997	128.11	896,385.67
南アフリカランド 小計	321,567		38,978,784.75 (249,464,222)
合計	22,676,429		6,087,382,618 (6,087,382,618)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 40銘柄	9.6%	15.9%
メキシコペソ	株式 23銘柄	1.1%	1.8%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	3.5%	5.8%
チリペソ	株式 16銘柄	0.4%	0.6%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式 5銘柄	0.1%	0.1%
トルコリラ	株式 14銘柄	0.2%	0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	0.5%	0.8%
香港ドル	株式 204銘柄	15.7%	26.0%
マレーシアリングット	株式 40銘柄	1.2%	1.9%

タイパーツ	株式	44銘柄	1.3%	2.2%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	0.5%	0.8%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	0.9%	1.6%
韓国ウォン	株式	107銘柄	8.3%	13.7%
新台湾ドル	株式	95銘柄	8.6%	14.3%
インドルピー	株式	86銘柄	5.7%	9.4%
エジプトポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
南アフリカランド	株式	39銘柄	2.5%	4.1%

## (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	605	16,516.50		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	30,028	524,889.44		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	61,449	2,046,866.19		
		ISHARES MSCI UAE ETF	35,000	381,675.00		
	米ドル 小計			127,082	2,969,947.13 (315,467,784)	
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	469,800	22,033,620.00		
中国元(オフショア) 小計			469,800	22,033,620.00 (342,402,454)		
投資信託受益証券合計				657,870,238 (657,870,238)		
投資証券	米ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	62,460	1,808,841.60		
		米ドル 小計		62,460	1,808,841.60 (192,135,154)	
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	36,300	602,217.00		
			メキシコペソ 小計		36,300	602,217.00 (2,986,996)
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,200	124,782.00		
		KLABIN SA-UNIT	7,100	176,364.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	3,000	130,470.00		
	ブラジルリアル 小計			14,300	431,616.00 (8,636,636)	
南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	25,563	324,394.47			
南アフリカランド 小計			25,563	324,394.47 (2,076,124)		
投資証券合計				205,834,910 (205,834,910)		
合計				863,705,148 (863,705,148)		

(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	3.1%	-	36.5%
	投資証券 1銘柄	-	1.9%	22.2%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.3%
ブラジルレアル	投資証券 3銘柄	-	0.1%	1.0%
南アフリカランド	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.2%
中国元(オフショア)	投資信託受益証券 1銘柄	3.4%	-	39.6%

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### Jリート・インデックス・マザーファンド

#### 貸借対照表

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,125,734	40,244,868
投資証券	7,780,854,340	6,661,603,340
未収入金	-	326,430
未収配当金	110,417,015	79,907,082
前払金	-	231,000
差入委託証拠金	-	11,430,000
流動資産合計	8,004,397,089	6,793,742,720
資産合計	8,004,397,089	6,793,742,720
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	237,600
未払解約金	93,530,000	8,000,000
未払利息	234	117
その他未払費用	5,264	2,029
流動負債合計	93,535,498	8,239,746
負債合計	93,535,498	8,239,746
純資産の部		
元本等		
元本	3,086,904,697	3,156,320,526
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4,823,956,894	3,629,182,448
元本等合計	7,910,861,591	6,785,502,974
純資産合計	7,910,861,591	6,785,502,974
負債純資産合計	8,004,397,089	6,793,742,720

#### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2019年 9月10日現在）	（2020年 9月10日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,086,904,697口	3,156,320,526口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5627円 (10,000口当たりの純資産額 25,627円)	1口当たり純資産額 2.1498円 (10,000口当たりの純資産額 21,498円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

該当事項はありません。

(2020年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	51,117,600	-	50,880,000	237,600
	東証REIT指数先物	51,117,600	-	50,880,000	237,600
合計		51,117,600	-	50,880,000	237,600

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日

至 2020年 9月10日

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

## (その他の注記)

(2019年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,035,716,920円
同期中における追加設定元本額	4,119,008,327円
同期中における一部解約元本額	6,067,820,550円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	351,305,308円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	480,918,885円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	446,263,380円
イオン・バランス戦略ファンド	57,836,864円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	909,213,703円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,042,377円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	10,585,962円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,675,091円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	20,215,989円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	11,885,680円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,475,916円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,609,434円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	412,141円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	306,297,110円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	58,642,282円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	17,158,414円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	25,811,183円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	151,500,822円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	211,054,156円
合計	3,086,904,697円

(2020年 9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,086,904,697円
同期中における追加設定元本額	2,997,144,752円
同期中における一部解約元本額	2,927,728,923円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	485,471,848円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	548,906,892円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	404,430,010円

イオン・バランス戦略ファンド	60,993,325円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,317,204,019円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,660,769円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	28,579,513円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	19,044,936円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	60,511,672円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,111,060円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	25,064,827円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,315,173円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,300,787円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	328,136円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	47,345,955円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	13,743,335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>	39,497,389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>	51,810,880円
合計	3,156,320,526円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	122	12,309,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	183	17,330,100	
	S O S i L A 物流リート投資法人	164	22,238,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	247	152,646,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	909	69,084,000	
	森ヒルズリート投資法人	875	116,200,000	
	産業ファンド投資法人	1,051	188,654,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	706	219,213,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	484	90,459,600	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	372	148,242,000	
	G L P 投資法人	2,139	347,373,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	325	100,912,500	
	日本プロロジスリート投資法人	1,124	393,962,000	



星野リゾート・リート投資法人	112	55,216,000	
Oneリート投資法人	115	28,370,500	
イオンリート投資法人	755	87,731,000	
ヒューリックリート投資法人	598	80,909,400	
日本リート投資法人	242	84,942,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,777	67,928,940	
積水ハウス・リート投資法人	2,188	161,474,400	
トーセイ・リート投資法人	164	17,351,200	
ケネディクス商業リート投資法人	274	59,211,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	156	18,844,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	141	13,775,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	2,404	318,289,600	
いちごホテルリート投資法人	130	9,087,000	
ラサールロジポート投資法人	829	143,334,100	
スターアジア不動産投資法人	765	32,665,500	
マリモ地方創生リート投資法人	71	7,242,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	213	111,186,000	
大江戸温泉リート投資法人	120	7,644,000	
投資法人みらい	801	30,357,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人	159	17,156,100	
三菱地所物流リート投資法人	167	70,140,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	202	29,431,400	
ザイマックス・リート投資法人	112	9,744,000	
タカラレーベン不動産投資法人	226	18,938,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	235	32,782,500	
日本ビルファンド投資法人	720	445,680,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	743	432,426,000	
日本リテールファンド投資法人	1,407	217,100,100	
オリックス不動産投資法人	1,480	228,068,000	
日本プライムリアルティ投資法人	463	147,234,000	
プレミア投資法人	672	80,572,800	
東急リアル・エステート投資法人	497	68,586,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	516	53,509,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,590	179,511,000	
森トラスト総合リート投資法人	531	72,003,600	
インヴィンシブル投資法人	3,109	94,513,600	
フロンティア不動産投資法人	247	86,203,000	
平和不動産リート投資法人	463	52,782,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	486	137,926,800	
福岡リート投資法人	384	51,724,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	230	141,220,000	
いちごオフィスリート投資法人	617	45,472,900	

大和証券オフィス投資法人	158	93,536,000	
阪急阪神リート投資法人	335	39,697,500	
スタートプロシード投資法人	115	22,873,500	
大和ハウスリート投資法人	1,061	281,695,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,395	115,678,500	
大和証券リビング投資法人	936	98,373,600	
ジャパンエクセレント投資法人	688	82,835,200	
合計	44,500	6,661,603,340	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### 外国リート・インデックス・マザーファンド

#### 貸借対照表

	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
預金	50,802,920	73,049,415
コール・ローン	2,395,949	9,622,071
投資証券	5,474,632,806	7,670,568,831
派生商品評価勘定	-	14,514
未収入金	173,249	82,327
未収配当金	4,597,224	10,368,904
流動資産合計	5,532,602,148	7,763,706,062
資産合計	5,532,602,148	7,763,706,062
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	146,860	450
未払金	-	35,033,622
未払解約金	23,880,338	-
未払利息	4	28
その他未払費用	740	163
流動負債合計	24,027,942	35,034,263
負債合計	24,027,942	35,034,263
純資産の部		
元本等		
元本	2,482,007,106	4,109,013,318
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	3,026,567,100	3,619,658,481
元本等合計	5,508,574,206	7,728,671,799
純資産合計	5,508,574,206	7,728,671,799
負債純資産合計	5,532,602,148	7,763,706,062

#### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 9月10日現在)	(2020年 9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,482,007,106口	4,109,013,318口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2194円 (10,000口当たりの純資産額 22,194円)	1口当たり純資産額 1.8809円 (10,000口当たりの純資産額 18,809円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 9月11日 至 2020年 9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 9月10日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(2020年 9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	16,469,472	-	16,483,206	13,734
	米ドル	11,279,900	-	11,293,556	13,656

ユーロ	3,260,322	-	3,260,400	78
オーストラリアドル	1,929,250	-	1,929,250	-
売建	3,509,300	-	3,508,970	330
英ポンド	1,379,700	-	1,379,600	100
香港ドル	342,500	-	342,500	-
シンガポールドル	1,787,100	-	1,786,870	230
合計	19,978,772	-	19,992,176	14,064

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 9月11日  
至 2020年 9月10日

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

## (その他の注記)

(2019年 9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,813,938,418円
同期中における追加設定元本額	1,932,193,735円
同期中における一部解約元本額	2,264,125,047円
2019年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	50,319,293円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	52,782,730円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	51,096,515円
イオン・バランス戦略ファンド	39,986,444円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,100,003,784円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,383,984円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,331,320円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,927,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	23,541,279円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	13,784,154円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,295,119円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	19,863,845円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	439,070円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	67,572,324円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	10,242,528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>	16,437,304円
合計	2,482,007,106円

(2020年 9月10日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,482,007,106円
同期中における追加設定元本額	2,664,028,619円
同期中における一部解約元本額	1,037,022,407円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	54,039,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	60,808,013円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	44,348,260円
イオン・バランス戦略ファンド	58,981,276円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,579,262,991円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	3,122,915円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	32,569,769円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	21,649,209円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	69,600,892円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,214,632円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	28,252,726円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	43,237,449円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	539,804円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	359,935円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	62,634,076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>	13,391,496円
合計	4,109,013,318円

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	5,392	63,949.12	
		AGREE REALTY CORP	3,530	236,545.30	
		ALEXANDER'S INC	136	35,429.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	8,030	1,307,926.40	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,856	97,556.80	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	8,331	299,582.76	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	6,262	42,926.01	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,914	493,888.80	
		AMERICOLD REALTY TRUST	12,715	480,754.15	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	9,769	352,367.83	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,834	153,235.22	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	20,000	7,000.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	601	1,496.49	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,931	1,396,272.54	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	4,428.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,501	812,430.51	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	1,505.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	9,810	106,144.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	18,757	235,587.92	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	2,361	25,911.97	
		BRT APARTMENTS CORP	500	6,565.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,896	539,130.24	
		CARETRUST REIT INC	6,670	128,731.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	1,770.45	
		CHATHAM LODGING TRUST	4,019	29,941.55	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603	36,225.61	
		CLIPPER REALTY INC	800	5,104.00	
		COLONY CAPITAL INC-CLASS A	34,696	92,985.28	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	7,180	82,857.20	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,483	72,830.13	
		CORECIVIC INC	9,461	88,933.40	
COREPOINT LODGING INC	1,000	5,710.00			



CORESITE REALTY CORPORATION	2,591	302,369.70	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6,389	149,949.83	
COUSINS PROPERTIES INC	9,363	270,497.07	
CUBESMART	12,378	397,457.58	
CYRUSONE INC	7,546	574,401.52	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,330	55,782.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,014	2,510,926.12	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,696	41,286.56	
DOUGLAS EMMETT INC	10,156	275,227.60	
DUKE REALTY CORP	23,359	885,773.28	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	4,292	105,411.52	
EASTGROUP PROPERTIES INC	2,384	311,183.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,910	42,289.20	
EPR PROPERTIES	5,198	172,469.64	
EQUINIX INC	5,600	4,219,152.00	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	7,598	234,778.20	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	11,551	745,155.01	
EQUITY RESIDENTIAL	22,351	1,270,430.84	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	7,194	135,966.60	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,227	923,641.77	
EXTRA SPACE STORAGE INC	8,193	907,948.26	
FARMLAND PARTNERS INC	300	1,974.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,482	355,825.98	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	8,187	336,731.31	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,560	146,839.60	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	17,057.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	19,760.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	12,700	479,488.50	
GEO GROUP INC	9,546	106,628.82	
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	41,497.68	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	26,596.80	
GLADSTONE LAND CORP	600	9,306.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	13,550.00	
GLOBAL NET LEASE INC	6,857	120,546.06	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,813	260,512.28	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	13,482	356,329.26	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	35,186	988,726.60	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	6,362.50	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,022	251,457.82
HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,735	509,512.75
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	9,750	228,442.50
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	54,392.52
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	4,808	105,343.28
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,447	178,617.68
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,026	70,978.68
INVITATION HOMES INC	33,927	985,579.35
IRON MOUNTAIN INC	17,946	539,636.22
JBG SMITH PROPERTIES	7,477	205,318.42
KILROY REALTY CORP	6,541	368,062.07
KIMCO REALTY CORPORATION	29,106	351,891.54
KITE REALTY GROUP TRUST	7,848	91,586.16
LEXINGTON REALTY TRUST	16,148	182,149.44
LIFE STORAGE INC	2,978	324,006.40
LTC PROPERTIES INC	2,847	106,107.69
MACERICH COMPANY/THE	10,554	82,954.44
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,669	63,311.64
MANULIFE US REAL ESTATE INV	121,700	91,883.50
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,664	616,724.48
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	7,499	873,183.56
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	7,136	103,257.92
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	2,692	175,006.92
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	10,411	391,037.16
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,890	133,621.50
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	11,676.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	1,760	73,761.60
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	3,872	90,256.32
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	14,157	463,783.32
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,010	18,947.60
PARAMOUNT GROUP INC	13,680	100,274.40
PARK HOTELS AND RESORTS INC	15,978	167,289.66
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	9,393	125,020.83
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	1,929.36
PHYSICIANS REALTY TRUST	14,181	265,326.51
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,882	117,914.72
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	500	6,680.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	19,140.00
PRIME US REIT	15,000	12,000.00
PROLOGIS INC	46,994	4,745,454.12

PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,321	163,553.01	
PUBLIC STORAGE	9,601	2,080,728.72	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	3,267	213,465.78	
REALTY INCOME CORPORATION	21,878	1,413,975.14	
REGENCY CENTERS CORP	11,032	450,877.84	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	7,539	85,115.31	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,355	67,514.60	
RETAIL VALUE INC	617	7,656.97	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	8,276	387,813.36	
RLJ LODGING TRUST	12,043	113,806.35	
RPT REALTY	2,740	17,070.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,444	136,106.88	
SABRA HEALTH CARE REIT	13,356	206,617.32	
SAFEHOLD INC	600	35,634.00	
SAUL CENTERS INC	703	18,889.61	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	23,070.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	12,991	110,358.54	
SIMON PROPERTY GROUP INC	19,503	1,342,976.58	
SITE CENTERS CORP	12,677	99,894.76	
SL GREEN REALTY CORP	5,361	253,736.13	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	6,447	235,895.73	
STAG INDUSTRIAL INC	10,205	331,050.20	
STORE CAPITAL CORP	13,884	393,611.40	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	24,596.00	
SUN COMMUNITIES INC	6,189	889,606.86	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	15,464	125,722.32	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	21,407.28	
TAUBMAN CENTERS INC	4,046	154,678.58	
TERRENO REALTY CORP	3,957	228,398.04	
UDR INC	19,575	674,358.75	
UMH PROPERTIES INC	800	11,408.00	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	775	51,599.50	
URBAN EDGE PROPERTIES	6,559	71,689.87	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	29,152.92	
VENTAS INC	23,481	1,038,799.44	
VEREIT INC	69,305	482,362.80	
VICI PROPERTIES INC	29,239	695,011.03	
VORNADO REALTY TRUST	10,335	358,624.50	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	3,869.86	
	4,917	103,650.36	

	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	8,142	143,462.04	
	WELLTOWER INC	26,886	1,637,088.54	
	WHITESTONE REIT	1,000	6,170.00	
	WP CAREY INC	11,091	768,717.21	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	6,674	59,532.08	
	米ドル 小計	1,577,757	54,141,134.94 (5,750,871,353)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	3,629	137,285.07	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,233	19,829.04	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	942	27,845.52	
	CAN APARTMENT PROP	5,539	244,048.34	
	CHOICE PROPERTIES REIT	9,554	119,902.70	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	8,945	63,509.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,613	34,099.65	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	44,544.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	4,922	53,994.34	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	28,398.24	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	8,194	112,831.38	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,848	142,277.52	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,692	79,689.12	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,450	56,070.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,017	52,616.48	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	5,393.40	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	23,463.99	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,844	62,364.08	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	4,111	47,194.28	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,952	162,746.72	
	SLATE GROCERY REIT	500	5,245.00	
	SLATE OFFICE REIT	1,000	3,800.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,667	77,227.02	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,456	79,408.80	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	8,239	47,868.59	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	2,449	41,755.45	
	カナダドル 小計	109,332	1,773,408.23 (143,114,044)	
ユーロ	AEDIFICA	1,757	177,808.40	

	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	9,214	113,608.62
	ALTAREA	387	49,071.60
	BEFIMMO SCA	1,933	73,840.60
	COFINIMMO	1,391	171,927.60
	COVIVIO	2,930	179,755.50
	EUROCOMMERCIAL	2,113	21,594.86
	GECINA SA	3,352	377,435.20
	HAMBORNER REIT AG	6,085	52,373.59
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	28,150.78
	ICADE	2,132	113,102.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	10,598.88
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	17,475	121,101.75
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,302	28,839.30
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432	53,420.48
	KLEPIERRE	13,239	180,778.54
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	10,912.30
	MERCIALYS	2,280	12,859.20
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	21,605	153,287.47
	MONTEA	559	58,918.60
	NSI NV	1,579	46,264.70
	RETAIL ESTATES	678	39,052.80
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	8,585	339,966.00
	VASTNED RETAIL	925	22,801.25
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,755	260,111.05
	WERELDHAVE NV	3,304	23,970.52
	ユーロ 小計	181,310	2,721,552.19 (341,282,644)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	9,000	7,020.00
	ASSURA PLC	165,411	135,967.84
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,081	110,185.33
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210	39,822.30
	BRITISH LAND CO PLC	60,865	215,401.23
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	64,631	83,826.40
	CAPITAL & REGIONAL PLC	2,000	1,248.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,625	57,887.50
	DERWENT LONDON PLC	6,522	177,267.96
	ELITE COMMERCIAL REIT	20,000	13,100.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	13,800.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	19,544	116,208.62
	HAMMERSON PLC	7,296	20,472.57
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	285.00

	LAND SECURITIES GROUP PLC	45,983	251,159.14
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	65,725	152,087.65
	LXI REIT PLC	36,635	39,932.15
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	9,350.26
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	40,055.84
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	88,137	134,673.33
	RDI REIT PLC	8,020	7,338.30
	REGIONAL REIT LTD	45,664	32,878.08
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	12,933	102,106.03
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	4,612.50
	SEGRO PLC	72,574	685,679.15
	SHAFTESBURY PLC	11,737	63,262.43
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	10,550.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	121,677	188,842.70
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	23,765.00
	UNITE GROUP PLC	25,961	251,691.89
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	35,719.12
	英債券 小計	1,205,979	3,026,196.32 (417,524,306)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	23,209	64,985.20
	APN INDUSTRIA REIT	1,000	2,540.00
	ARENA REIT	12,763	32,928.54
	BWP TRUST	26,090	104,620.90
	CENTURIA OFFICE REIT	24,034	48,548.68
	CHARTER HALL GROUP	30,842	382,749.22
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,945	130,503.35
	CHARTER HALL RETAIL REIT	24,091	80,463.94
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	7,100	18,886.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	72,697	62,519.42
	DEXUS	69,409	619,128.28
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	18,540.00
	GOODMAN GROUP	103,671	1,850,527.35
	GPT GROUP	132,283	510,612.38
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	15,930	53,524.80
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	23,921	72,719.84
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	26,419	117,300.36
	MIRVAC GROUP	245,794	511,251.52
	NATIONAL STORAGE REIT	80,507	149,743.02
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	22,300.00
	SCENTRE GROUP	331,601	722,890.18
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	73,925	164,852.75

	STOCKLAND	151,058	549,851.12
	VICINITY CENTRES	268,793	369,590.37
	WAYPOINT REIT LTD	50,503	134,843.01
オーストラリアドル 小計		1,849,585	6,796,420.23 (524,547,713)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	84,995	116,443.15
	GOODMAN PROPERTY TRUST	52,430	118,491.80
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	86,057	89,068.99
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	76,088	127,066.96
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	57,380.00
ニュージーランドドル 小計		318,570	508,450.90 (36,054,253)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	127,000	523,240.00
	FORTUNE REIT	80,000	536,000.00
	LINK REIT	129,600	8,164,800.00
	PROSPERITY REIT	60,000	138,600.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	142,820.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	153,000	585,990.00
香港ドル 小計		586,600	10,091,450.00 (138,353,779)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	27,965.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	27,000	17,280.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	191,100	630,630.00
	ASCOTT TRUST	117,055	105,934.77
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	181,400	304,752.00
	CAPITALAND MALL TRUST	191,000	372,450.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	61,000	69,540.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	36,754.50
	ESR REIT	217,952	86,091.04
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	25,760.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	11,900.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	61,200	163,404.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	4,400.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	172,038	230,530.92
	KEPPEL DC REIT	82,500	240,900.00
	KEPPEL REIT	98,900	107,801.00
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	25,000	16,375.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	3,762.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	137,100	271,458.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	86,600	271,058.00

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	178,950	363,268.50	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	167,200	155,496.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	100,000	37,000.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	29,800	120,690.00	
		SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	11,625.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	20,000	15,200.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	12,350.00	
		SPH REIT	74,600	65,648.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	54,000	24,570.00	
		SUNTEC REIT	147,500	215,350.00	
		シンガポールドル 小計	2,653,745	4,019,943.73 (312,349,627)	
	韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	5,000	25,450,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	1,800	12,096,000.00	
		韓国ウォン 小計	6,800	37,546,000.00 (3,371,630)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	8,000	99,120.00	
		イスラエルシェケル 小計	8,000	99,120.00 (3,099,482)	
		合計		7,670,568,831 (7,670,568,831)	

(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 156銘柄	74.4%	75.0%
カナダドル	投資証券 26銘柄	1.9%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	4.4%	4.4%
英ポンド	投資証券 31銘柄	5.4%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	6.8%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	4.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券 2銘柄	0.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	0.0%	0.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2020年 9月30日現在

資産総額	559,311,766円
負債総額	186,795円
純資産総額（ - ）	559,124,971円
発行済口数	526,756,837口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0614円
（1万口当たり純資産額）	（10,614円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

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

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	2020年9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。

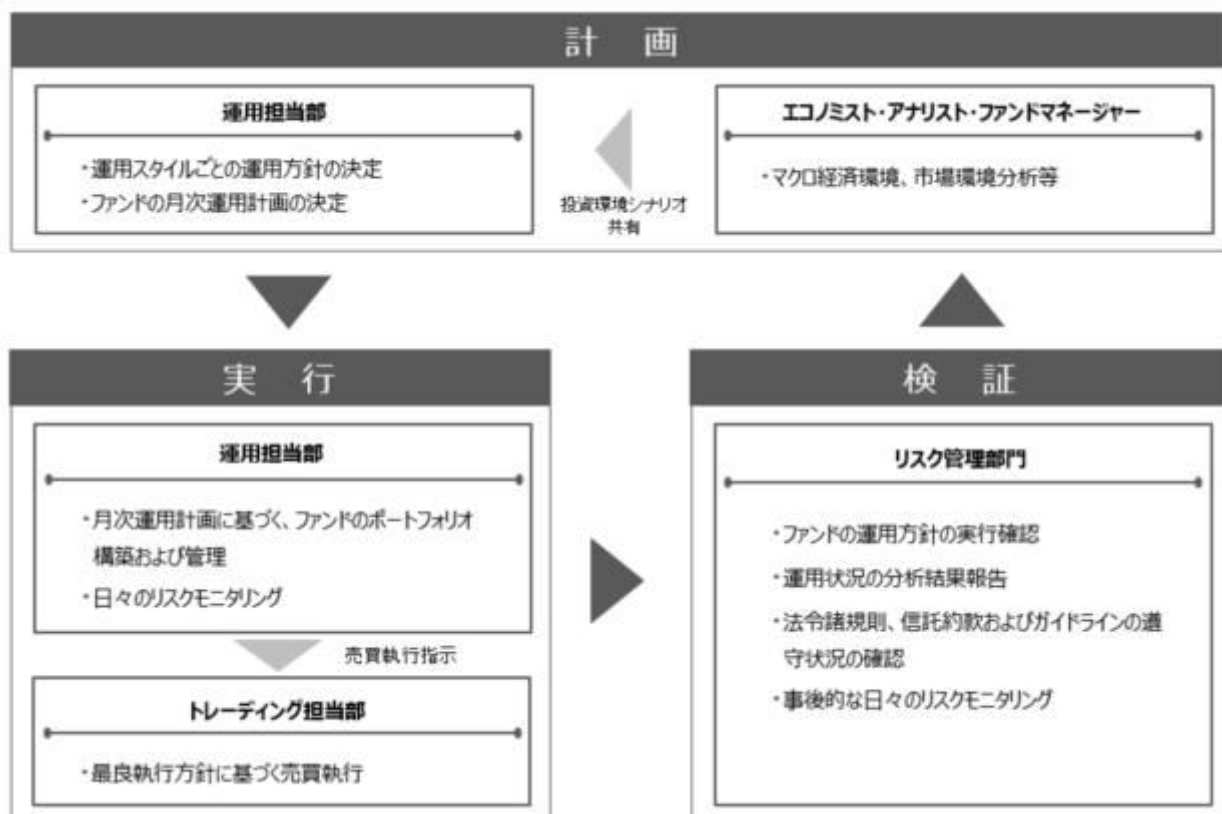
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

#### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年9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	759	7,725,640
単体型株式投資信託	122	570,119
追加型公社債投資信託	1	28,258
単体型公社債投資信託	181	469,653
合計	1,063	8,793,671

## 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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
<b>未払金</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等	
	利益剰余金			



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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

## (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「営業外費用」として、表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当事業年度から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

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

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

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	174,854千円	132,559千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

2 合併関連費用

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

当事業年度の合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

## 3 本社移転費用

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

## 4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

当社は2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019年 3月22日

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

2019年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

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

2020年6月29日開催の第35回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2019年3月31日）

(単位：千円)

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

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

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

(単位:千円)

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2019年3月31日)

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

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額

728,127	7,247	14,605
---------	-------	--------

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:千円)

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

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.000%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(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)
<b>繰延税金資産</b>		
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
<b>繰延税金負債</b>		
無形固定資産	-	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産(負債)の純額	1,426,381	2,963,538

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

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

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



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

## (セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

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

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

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

## (企業結合等関係)

### (取得による企業結合)

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

## 1. 企業結合の概要

### (1) 被取得企業の名称及び事業の内容

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

### (2) 企業結合を行った主な理由

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

### (3) 企業結合日

2019年4月1日

### (4) 企業結合の法的形式

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

### (5) 結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

### (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

## 3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

## 4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

### (1) 合併比率

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

## (2) 合併比率の算定方法

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

## (3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

## 6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

## (1) 発生したのれん

37,043,811千円

## (2) 発生原因

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

## (3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

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

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

## (参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

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

**強調事項**

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**（1）貸借対照表**

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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



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

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

## 注記事項

## (重要な会計方針)

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (表示方法の変更)

## (「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

## (追加情報)

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

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

## (貸借対照表関係)

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

## (損益計算書関係)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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

## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位：千円)

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

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

第47期（平成31年3月31日）

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

## 2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自平成30年4月1日 至平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

(単位：千円)

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



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

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

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

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

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

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

## 関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第47期(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (1株当たり情報)

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

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## (重要な後発事象)

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

## 4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常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。

## □ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円		
株式会社S B I証券	48,323百万円		
auカブコム証券株式会社	7,196百万円		
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円		
岡三にいがた証券株式会社	852百万円		
静岡東海証券株式会社	600百万円		
フィリップ証券株式会社	950百万円		
松井証券株式会社	11,945百万円		
マネックス証券株式会社	12,200百万円		
楽天証券株式会社	7,495百万円		
株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円		銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	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。	

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。

## □ 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。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年12月 5日	有価証券届出書
2019年12月 5日	有価証券報告書
2020年 6月 4日	有価証券届出書
2020年 6月 4日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

2020年10月20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 公認会計士 菅野 雅子 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志 印  
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2019年9月11日から2020年9月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2020年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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



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

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

#### 利害関係

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

以 上

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