

**【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】	2021年5月13日提出
【計算期間】	第2期(自 2020年2月19日至 2021年2月18日)
【ファンド名】	三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) 三井住友D S・年金バランス50(標準型) 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)
【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、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、当該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。
- ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	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）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および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

## 商品分類表

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

(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	<b>年1回</b>	<b>グローバル</b> (日本を含む)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )	
中小型株	年6回(隔月)	欧州			
債券	年12回(毎月)	アジア			TOPIX
一般	日々	オセアニア			
公債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	<b>なし</b>	
社債		アフリカ			
その他債券					
クレジット属性 ( )					
不動産投信		中近東(中東)			<b>その他</b> (合成指数)
<b>その他資産</b> (投資信託証券(資 産複合(株式 債 券)資産配分固定 型))					
資産複合					

( ) 資産配分固定 型 資産配分変更 型		エマージング			
-----------------------------------	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2019年6月28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。

### 運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2021年2月26日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

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

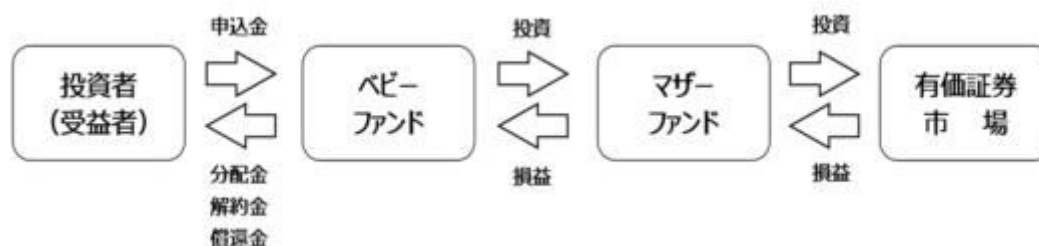
## (八) 大株主の状況

(2021年2月26日現在)

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

## 八 ファンドの運用形態（ファ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

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド

外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

## ロ 投資態度

(イ) 各ファンドにつき、マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
株 式	30%	50%	70%
国内株式	20%	35%	50%
外国株式	10%	15%	20%
債 券	65%	45%	25%
国内債券	55%	35%	15%
外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

(ロ) 各ファンドの運用は、以下の比率により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。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA - B P I (総合)	55%	35%	15%
M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)	10%	15%	20%
F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

(ハ) 実質組入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ことを基本とします。

### (二) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージN E X T 30  
制限はありません。

b. マイパッケージN E X T 50

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c. マイパッケージN E X T 70

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)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。

(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。

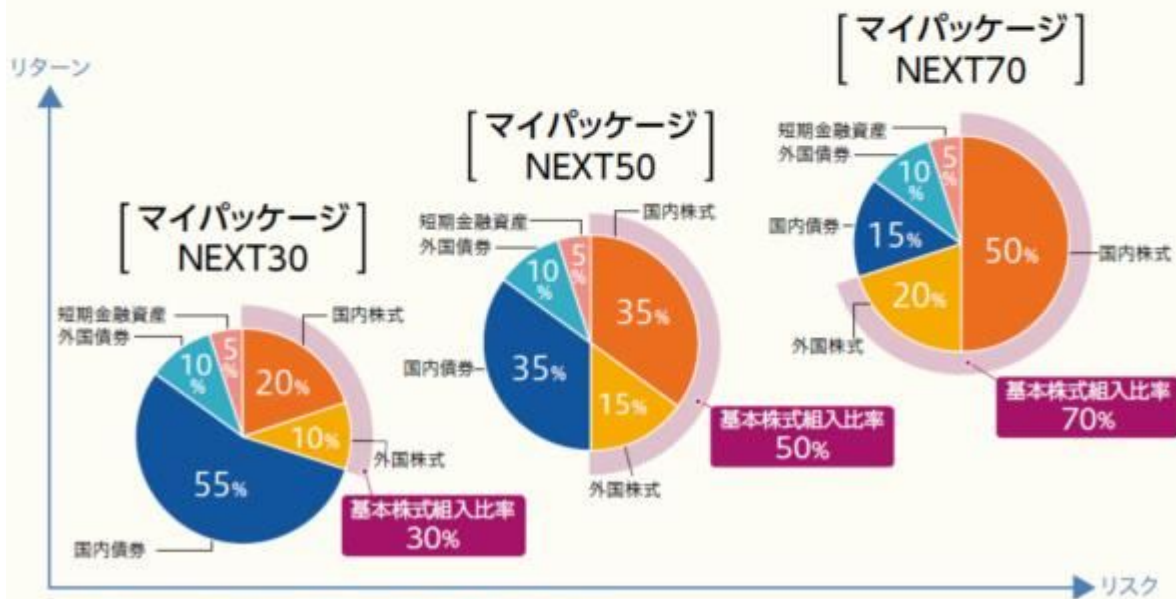
## ファンドの特色

**1** 内外の株式、公社債に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。

**2** 国内株式、外国株式、国内債券および外国債券への投資割合が異なる3つのファンドからお選びいただけます。

- 各ファンドの基本資産配分は、下記の通りとします。
- 時価変動等に伴う各資産への投資比率の変化については、一定の範囲(±3%)を超えた場合、調整します。

### [各ファンドの基本資産配分イメージ]



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

## 3

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ます。

## 〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

	投資対象資産	マイパッケージ NEXT30	マイパッケージ NEXT50	マイパッケージ NEXT70
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%



TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。  
TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の代表的な指数であり、各ファンドの合成指数を構成するものです。なお、外国株式および外国債券のベンチマークは、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により委託会社が円換算したものです。

※指数を公表する各社は各ファンドの運用と何ら関係ありません。

## 4

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

■ 基準価額は為替変動の影響を受けます。

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

## 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

### ▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

### ▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

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

### ▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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



#### 最適化法とは

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

#### 層化抽出法とは

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

※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

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

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定す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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券
11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 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
14. 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。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権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。次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（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。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 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。）
18. 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せん。）
19. 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。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 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。）
22. 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
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21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16号の証券ならびに第13号、第19号および第21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ならびに第19号および第21号の証券または証書の

うち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

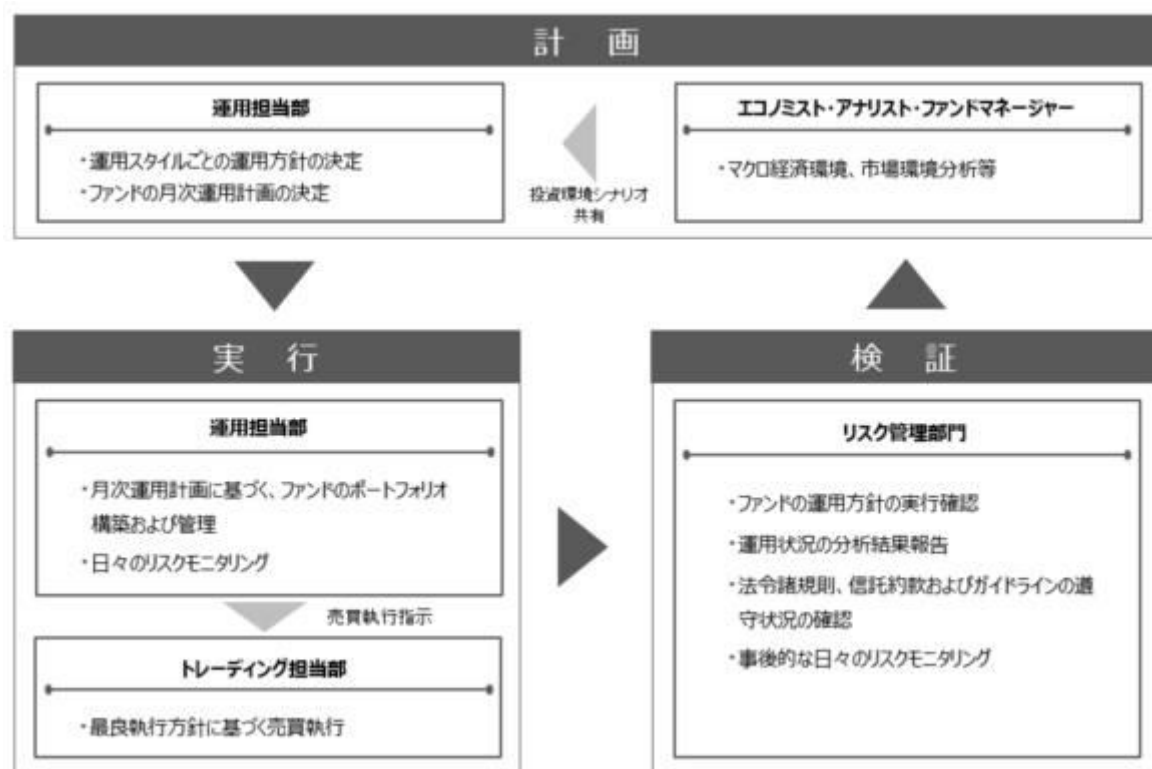
#### 八 投資対象とする金融商品

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。

#### ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

### （4）【分配方針】

年1回（原則として毎年2月18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。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、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(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

マイパッケージNEXT30	50%未満
マイパッケージNEXT50	25%以上
マイパッケージNEXT70	50%以上

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は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。

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、取引所に上場され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され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。

- (八) 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。
- (二) 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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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(以下本項において「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。
- (二) 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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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るものとします。

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

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

#### 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するものとします。

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

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

(ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### 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、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

#### ロ 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みま

す。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(ニ)借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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



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

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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、かつ本邦通貨表示のものに限り、)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. 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、)

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## (国内債券パッシブ・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(八) 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

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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、有価証券に係るものに限りません。)
17. 預託証券(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券
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せん。)
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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

## (2) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 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。)

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ンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

#### (外国債券パッシブ・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

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

(ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

## （２）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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ません。）
- 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せん。）
- 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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## （３）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

#### (イ) 株式市場リスク

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

#### (ロ) 債券市場リスク

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

#### (ハ) 信用リスク

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

#### (ニ) 為替変動リスク

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

#### (ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になる

ことや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 合成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が、以下の要因等により、合成指数の動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物とインデックスの動きに不一致が生じること

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「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。

(リ) 換金制限等に関する留意点

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

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ■マイパッケージNEXT30



### 「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。



#### ■マイパッケージNEXT50



※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。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

### ■マイパッケージNEXT70



※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0.154%（税抜き0.14%）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0.06%	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0.06%	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。

### （４）【その他の手数料等】

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

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

上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、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。

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

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。

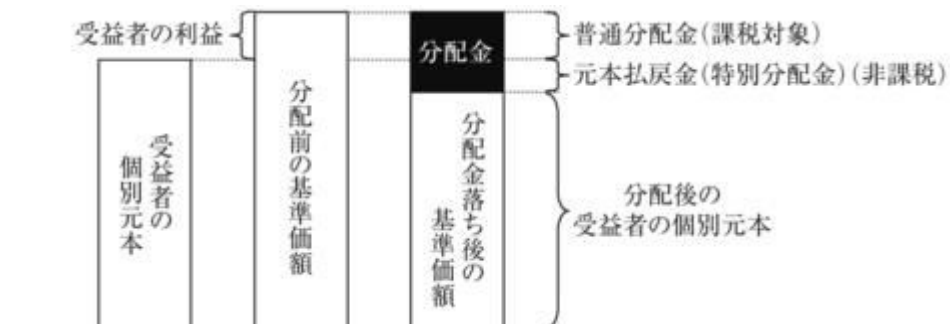
ハ 収益分配金の課税について

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、上場株式等(上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択したものに限り、)および利子所得の金額との損益通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

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

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

< 配当控除および益金不算入制度の適用の可否 >

- a. マイパッケージNEXT30  
配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
- b. マイパッケージNEXT50  
配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。
- c. マイパッケージNEXT70  
配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

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、2021年2月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

2021年2月26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	131,703,158	95.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,877,748	4.96
合計(純資産総額)		138,580,906	100.00

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

## 三井住友DS・年金バランス50(標準型)

2021年2月26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	327,242,422	94.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,579,917	5.10
合計(純資産総額)		344,822,339	100.00

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

## 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

2021年2月26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	208,901,949	94.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,289,294	5.13
合計(純資産総額)		220,191,243	100.00

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

## イ 主要投資銘柄

2021年 2月26日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	60,608,850	1.2737	77,201,560	1.2667	76,773,230	55.40
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	8,841,097	3.1778	28,095,634	3.0556	27,014,855	19.49
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	7,408,858	1.9101	14,151,773	1.8992	14,070,903	10.15
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	2,993,852	4.7013	14,075,258	4.6242	13,844,170	9.99

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

2021年 2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.04
合計	95.04

### 三井住友D S ・年金バランス50(標準型)

#### イ 主要投資銘柄

2021年 2月26日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	96,503,938	1.2738	122,935,179	1.2667	122,241,538	35.45
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)	38,675,793	3.1795	122,972,598	3.0556	118,177,753	34.27
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	11,225,231	4.7026	52,788,682	4.6242	51,907,713	15.05
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	18,384,277	1.9104	35,122,237	1.8992	34,915,418	10.13

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

2021年 2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.90
合計	94.90

### 三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)

#### イ 主要投資銘柄

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)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	35,457,752	3.1783	112,698,745	3.0556	108,344,707	49.20
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9,616,116	4.7020	45,215,062	4.6242	44,466,843	20.19
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	26,559,021	1.2738	33,832,176	1.2667	33,642,311	15.28
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	11,819,760	1.9103	22,579,904	1.8992	22,448,088	10.19

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2021年 2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.87
合計	94.87

#### 【投資不動産物件】

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友D S・年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)

該当事項はありません。

三井住友D S・年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
第2期 (2021年 2月18日)	129,349,680	129,349,680	10,869	10,869
2020年 2月末日	1,011,940		10,119	
3月末日	997,240		9,793	
4月末日	5,530,891		9,963	
5月末日	26,731,240		10,123	
6月末日	45,407,143		10,131	
7月末日	51,685,178		10,111	
8月末日	64,683,992		10,320	
9月末日	65,062,883		10,326	
10月末日	79,358,285		10,212	
11月末日	90,614,242		10,568	
12月末日	110,891,257		10,668	
2021年 1月末日	121,602,046		10,679	
2月末日	138,580,906		10,723	

## 三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
第2期 (2021年 2月18日)	335,342,429	335,342,429	11,511	11,511
2020年 2月末日	2,177,658		10,098	
3月末日	2,079,764		9,644	
4月末日	19,954,418		9,911	
5月末日	88,543,039		10,197	
6月末日	145,293,000		10,222	
7月末日	159,673,296		10,151	
8月末日	204,837,137		10,532	
9月末日	214,036,548		10,532	
10月末日	229,195,303		10,362	



11月末日	262,681,137		10,951	
12月末日	291,074,689		11,120	
2021年 1月末日	317,245,633		11,153	
2月末日	344,822,339		11,291	

## 三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
第2期 (2021年 2月18日)	212,907,677	212,907,677	12,154	12,154
2020年 2月末日	1,007,443		10,074	
3月末日	948,378		9,484	
4月末日	9,327,972		9,846	
5月末日	43,402,332		10,259	
6月末日	60,403,664		10,302	
7月末日	71,943,990		10,175	
8月末日	102,433,193		10,730	
9月末日	113,548,037		10,723	
10月末日	133,182,976		10,492	
11月末日	156,662,046		11,323	
12月末日	178,222,888		11,564	
2021年 1月末日	193,050,975		11,619	
2月末日	220,191,243		11,853	

## 【分配の推移】

## 三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0

## 三井住友D S ・年金バランス50(標準型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0

## 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

	収益率（％）
第1期	3.7
第2期	4.9

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

## 三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

	収益率（％）
第1期	5.7
第2期	8.9

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

## 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

	収益率（％）
第1期	7.9
第2期	12.7

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

## （4）【設定及び解約の実績】

## 三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	129,718,508	11,715,048

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

### 三井住友D S・年金バランス50(標準型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,156,528	0
第2期	322,790,706	33,614,202

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

### 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,000,000	0
第2期	190,606,278	16,430,623

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

#### (1) 投資状況

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2021年 2月26日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	182,578,387,010	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,120,781,678	1.15
合計(純資産総額)		184,699,168,688	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	2,138,070,000	1.15
合計	買建		2,138,070,000	1.15

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年 2月26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	102,545,659,850	80.32
地方債証券	日本	8,519,246,340	6.67
特殊債券	日本	11,818,467,965	9.26
社債券	日本	3,829,218,000	3.00
	フランス	200,536,000	0.16
	小計	4,029,754,000	3.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		757,341,141	0.59
合計(純資産総額)		127,670,469,296	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2021年 2月26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	179,785,813,051	66.38
	イギリス	12,236,458,921	4.52
	カナダ	9,488,560,563	3.50
	フランス	9,106,137,804	3.36
	スイス	8,967,458,811	3.31
	ドイツ	8,225,281,372	3.04
	オーストラリア	5,747,359,964	2.12
	オランダ	5,172,099,743	1.91
	アイルランド	4,881,070,125	1.80
	スウェーデン	2,990,273,932	1.10
	香港	2,321,570,118	0.86
	スペイン	2,181,462,614	0.81
	デンマーク	2,159,251,177	0.80
	イタリア	1,675,462,091	0.62
	フィンランド	1,113,895,709	0.41
	ジャージー	1,043,791,431	0.39
	バミューダ	894,912,845	0.33
	シンガポール	820,522,566	0.30
	ベルギー	774,442,658	0.29
イスラエル	544,376,349	0.20	

	ノルウェー	543,835,036	0.20
	ケイマン諸島	516,036,051	0.19
	ニュージーランド	298,590,079	0.11
	ルクセンブルグ	254,705,423	0.09
	キュラソー	222,475,647	0.08
	オーストリア	164,273,785	0.06
	ポルトガル	142,737,008	0.05
	リベリア	87,971,672	0.03
	マン島	61,502,309	0.02
	パプアニューギニア	38,099,824	0.01
	小計	262,460,428,678	96.91
投資証券	アメリカ	4,888,712,479	1.81
	オーストラリア	666,365,201	0.25
	イギリス	157,937,497	0.06
	フランス	141,197,331	0.05
	香港	140,874,702	0.05
	シンガポール	138,466,470	0.05
	カナダ	28,795,359	0.01
	小計	6,162,349,039	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,207,104,608	0.81
合計(純資産総額)		270,829,882,325	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	1,687,908,750	0.62
	買建	ドイツ	366,755,004	0.13
	買建	イギリス	108,245,632	0.03
	買建	オーストラリア	84,888,724	0.03
合計	買建		2,247,798,110	0.81

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		66,684,500	0.02
	売建		322,026,200	0.11

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年 2月26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	68,789,404,307	42.49
	フランス	17,151,411,300	10.59
	イタリア	15,507,114,010	9.58
	ドイツ	12,078,183,099	7.46
	イギリス	10,688,712,908	6.60
	スペイン	9,745,586,806	6.02
	オーストラリア	4,371,849,472	2.70
	ベルギー	4,058,052,757	2.51
	カナダ	3,152,457,662	1.95
	オランダ	3,075,580,941	1.90
	オーストリア	2,593,274,529	1.60
	アイルランド	1,410,129,184	0.87
	メキシコ	1,241,960,300	0.77
	フィンランド	1,098,045,440	0.68
	ポーランド	1,016,064,841	0.63
	マレーシア	828,665,328	0.51
	デンマーク	827,450,625	0.51
	イスラエル	716,883,965	0.44
	シンガポール	693,331,295	0.43
	スウェーデン	548,941,282	0.34
ノルウェー	389,639,024	0.24	
	小計	159,982,739,075	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,919,568,839	1.19
合計(純資産総額)		161,902,307,914	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年 2月26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	723,500	6,999.00	5,063,776,500	7,873.00	5,696,115,500	3.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	556,000	7,283.64	4,049,703,840	9,895.00	5,501,620,000	2.98
日本	株式	ソニー	電気機器	447,300	9,707.90	4,342,343,670	11,120.00	4,973,976,000	2.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	70,100	53,679.48	3,762,931,548	50,560.00	3,544,256,000	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,819,900	448.83	2,163,315,717	558.00	2,689,504,200	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	40,900	59,260.00	2,423,734,000	64,750.00	2,648,275,000	1.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	488,800	4,402.45	2,151,917,560	5,281.00	2,581,352,800	1.40
日本	株式	日本電産	電気機器	171,900	13,321.00	2,289,879,900	13,520.00	2,324,088,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	818,500	2,465.00	2,017,602,500	2,758.00	2,257,423,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	129,200	17,279.46	2,232,506,232	17,350.00	2,241,620,000	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	594,100	3,744.77	2,224,767,857	3,582.00	2,128,066,200	1.15
日本	株式	村田製作所	電気機器	209,700	9,146.65	1,918,052,505	9,081.00	1,904,285,700	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	90,900	23,654.88	2,150,228,592	20,720.00	1,883,448,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	561,700	3,003.93	1,687,307,481	3,290.00	1,847,993,000	1.00
日本	株式	第一三共	医薬品	612,900	3,691.59	2,262,575,511	3,010.00	1,844,829,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	487,200	3,035.24	1,478,768,928	3,742.00	1,823,102,400	0.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	41,800	35,470.00	1,482,646,000	43,550.00	1,820,390,000	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	141,700	13,898.29	1,969,387,693	12,100.00	1,714,570,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	343,200	3,972.15	1,363,241,880	4,876.00	1,673,443,200	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	62,700	25,365.00	1,590,385,500	26,340.00	1,651,518,000	0.89
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	562,200	2,870.65	1,613,879,430	2,911.50	1,636,845,300	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	490,800	2,762.66	1,355,913,528	3,168.00	1,554,854,400	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	956,100	1,328.35	1,270,035,435	1,559.00	1,490,559,900	0.81
日本	株式	S M C	機械	20,900	66,320.00	1,386,088,000	62,900.00	1,314,610,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	72,600	17,744.23	1,288,231,098	17,840.00	1,295,184,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	570,300	1,780.00	1,015,134,000	2,263.50	1,290,874,050	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	427,400	2,433.00	1,039,864,200	3,003.00	1,283,482,200	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	233,300	5,190.00	1,210,827,000	5,253.00	1,225,524,900	0.66
日本	株式	花王	化学	171,000	7,806.31	1,334,879,010	7,144.00	1,221,624,000	0.66
日本	株式	資生堂	化学	142,000	7,354.94	1,044,401,480	7,913.00	1,123,646,000	0.61

## □ 種類別・業種別の投資比率

2021年 2月26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	0.18
		建設業	2.26

食料品	3.29
繊維製品	0.49
パルプ・紙	0.25
化学	7.22
医薬品	5.39
石油・石炭製品	0.44
ゴム製品	0.58
ガラス・土石製品	0.78
鉄鋼	0.69
非鉄金属	0.78
金属製品	0.62
機械	5.51
電気機器	17.45
輸送用機器	6.90
精密機器	2.52
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.27
陸運業	3.59
海運業	0.20
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.47
卸売業	4.65
小売業	4.68
銀行業	5.00
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	1.87
その他金融業	1.09
不動産業	1.98
サービス業	5.70
合計	98.85

## 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）

2021年 2月26日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第419回利付国債(2年)	2,280,000,000	100.46	2,290,503,000	100.38	2,288,800,800	0.100	2022/12/1	1.79
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	102.09	2,072,427,000	0.800	2023/6/20	1.62
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,910,000,000	100.70	1,923,425,100	99.52	1,900,984,800	0.100	2030/9/20	1.49



日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	1,660,000,000	100.86	1,674,365,900	100.74	1,672,383,600	0.100	2025/12/20	1.31
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	103.27	1,502,636,700	1.700	2022/12/20	1.18
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,310,000,000	101.02	1,323,389,400	100.75	1,319,877,400	0.100	2025/9/20	1.03
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	102.31	1,314,799,150	0.800	2023/9/20	1.03
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,250,000,000	101.00	1,262,500,000	100.73	1,259,162,500	0.100	2025/6/20	0.99
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	102.28	1,242,726,300	1.000	2023/3/20	0.97
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	106.73	1,088,697,000	2.100	2024/3/20	0.85
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	105.65	1,077,691,200	1.900	2023/12/20	0.84
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	105.13	1,077,664,500	1.900	2023/9/20	0.84
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	1,020,000,000	100.92	1,029,384,000	99.77	1,017,715,200	0.100	2030/3/20	0.80
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	965,000,000	101.36	978,192,200	100.16	966,544,000	0.100	2029/3/20	0.76
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	938,000,000	101.52	952,295,120	100.66	944,265,840	0.100	2026/12/20	0.74
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	111.98	951,838,500	109.87	933,929,000	2.000	2025/12/20	0.73
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	712,000,000	130.27	927,522,400	126.77	902,630,880	2.400	2034/3/20	0.71
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	890,000,000	101.43	902,727,000	100.71	896,381,300	0.100	2026/6/20	0.70
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	870,000,000	101.26	881,018,400	100.08	870,713,400	0.100	2029/6/20	0.68
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	770,000,000	114.21	879,440,000	111.63	859,581,800	1.200	2034/12/20	0.67
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	850,000,000	101.16	859,919,500	99.95	849,634,500	0.100	2029/9/20	0.67
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	110.43	861,416,400	108.25	844,357,800	2.400	2024/6/20	0.66
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	114.86	852,283,460	112.40	834,067,360	2.300	2026/6/20	0.65
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	815,000,000	102.91	838,781,700	102.14	832,457,300	0.600	2024/3/20	0.65
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	734,000,000	114.73	842,176,920	112.28	824,201,260	2.100	2026/12/20	0.65
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	805,000,000	102.61	826,074,900	101.90	820,367,450	0.400	2025/3/20	0.64
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	811,000,000	101.49	823,095,500	100.69	816,636,450	0.100	2026/9/20	0.64
日本	国債証券	第72回利付国債(20年)	753,000,000	109.76	826,492,800	107.79	811,681,290	2.100	2024/9/20	0.64
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	793,000,000	102.74	814,783,710	101.99	808,844,140	0.600	2023/12/20	0.63
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	785,000,000	102.75	806,634,600	102.02	800,927,650	0.400	2025/6/20	0.63

□ 種類別の投資比率

2021年 2月26日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	80.32

地方債証券	6.67
特殊債券	9.26
社債券	3.16
合計	99.41

## 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)

2021年 2月26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	893,253	12,418.31	11,092,695,302	12,855.18	11,482,934,800	4.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	375,814	22,906.36	8,608,533,710	24,330.18	9,143,625,085	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	22,260	339,574.77	7,558,934,502	324,823.25	7,230,565,545	2.67
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディ ア・娯楽	125,809	29,495.98	3,710,860,474	27,060.81	3,404,493,760	1.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	15,722	190,664.27	2,997,623,673	215,832.00	3,393,310,704	1.25
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	15,733	189,982.89	2,989,000,813	214,194.68	3,369,925,018	1.24
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	39,040	62,725.70	2,448,811,451	72,485.87	2,829,848,560	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	159,751	12,897.58	2,060,401,605	16,062.87	2,566,060,344	0.95
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	137,956	15,344.42	2,116,854,922	17,293.25	2,385,707,597	0.88
アメリカ	株式	VISA INC	ソフト ウェア・ サービス	88,435	22,389.58	1,980,023,083	22,710.93	2,008,441,758	0.74
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディ ア・娯楽	94,382	15,667.88	1,478,766,411	20,291.62	1,915,164,151	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	73,192	24,601.58	1,800,639,121	25,892.06	1,895,091,839	0.70
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	32,367	56,340.82	1,823,583,350	56,556.87	1,830,576,373	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフト ウェア・ サービス	46,656	35,997.88	1,679,517,264	37,673.06	1,757,674,404	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	130,031	14,719.03	1,913,931,409	13,449.12	1,748,803,173	0.65
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	49,857	35,906.48	1,790,189,632	34,942.43	1,742,125,106	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲 料・タバ コ	150,922	12,004.96	1,811,813,400	11,288.10	1,703,623,836	0.63
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフト ウェア・ サービス	58,574	22,506.53	1,318,297,656	26,981.12	1,580,392,416	0.58

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	409,722	3,082.65	1,263,031,624	3,817.56	1,564,139,343	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	56,492	29,327.28	1,656,757,067	27,120.31	1,532,080,694	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	222,131	5,059.77	1,123,932,761	6,417.49	1,425,525,692	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,313	47,473.00	1,059,265,152	61,339.79	1,368,674,790	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	23,034	52,304.28	1,204,776,921	58,086.87	1,337,973,079	0.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	222,493	4,281.30	952,561,496	5,924.50	1,318,159,779	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	236,457	5,498.43	1,300,144,036	5,550.50	1,312,454,579	0.48
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	216,128	6,426.10	1,388,860,264	6,003.12	1,297,443,400	0.48
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	36,790	35,517.11	1,306,674,508	34,855.84	1,282,346,611	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	25,053	50,670.75	1,269,454,487	48,785.75	1,222,229,395	0.45
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	92,474	11,452.02	1,059,014,700	12,917.87	1,194,567,573	0.44
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM, INC.	ソフトウェア・サービス	47,267	26,310.68	1,243,627,266	24,552.25	1,160,511,201	0.43

## □ 種類別・業種別の投資比率

2021年 2月26日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.45
		素材	4.56
		資本財	6.52
		商業・専門サービス	1.06
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	2.03
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.64
		メディア・娯楽	7.16
		小売	5.66
		食品・生活必需品小売り	1.32
		食品・飲料・タバコ	3.87
		家庭用品・パーソナル用品	1.80
		ヘルスケア機器・サービス	5.11
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.55
		銀行	6.23
各種金融	4.55		

	保険	3.24
	不動産	0.44
	ソフトウェア・サービス	11.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.74
	電気通信サービス	1.78
	公益事業	3.00
	半導体・半導体製造装置	4.52
投資証券		2.28
合計		99.19

## 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)

2021年 2月26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	11,196.92	1,321,237,018	11,094.82	1,309,189,258	1.750	2024/6/30	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	9,800,000	10,349.01	1,014,203,265	9,828.95	963,237,602	0.625	2030/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	9,100,000	10,447.36	950,710,058	10,115.33	920,495,214	0.375	2027/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	8,000,000	10,615.86	849,269,535	10,589.30	847,144,535	0.125	2023/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	7,700,000	10,649.07	819,978,569	10,626.66	818,252,832	0.250	2023/6/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	4,900,000	16,506.14	808,801,101	16,090.79	788,449,127	3.500	2030/3/1	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,500,000	10,378.46	778,385,014	9,872.11	740,408,939	0.625	2030/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	11,296.53	734,274,661	11,199.41	727,961,914	2.125	2024/3/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,450.09	721,356,152	11,306.49	712,309,133	2.250	2024/11/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,563.07	678,153,735	13,457.04	672,852,128	3.000	2022/4/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	11,307.32	684,093,114	11,049.16	668,474,783	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	13,923.73	751,881,446	12,207.95	659,229,788	3.000	2048/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	12,338.28	678,605,468	11,859.32	652,262,942	2.875	2028/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,455.07	652,939,453	11,347.16	646,788,574	2.500	2024/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	11,455.07	641,484,376	11,338.86	634,976,563	2.375	2024/8/15	0.39
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	6,100,000	10,533.71	642,556,700	10,200.47	622,229,060	4.750	2027/4/21	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000	13,714.56	617,155,545	13,514.77	608,164,767	0.500	2026/5/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	5,700,000	10,610.88	604,820,657	10,580.17	603,070,019	0.125	2023/10/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	3,850,000	15,901.48	612,207,290	15,539.58	598,274,072	2.750	2027/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,600,000	24,449.38	635,684,049	22,884.34	594,993,017	4.500	2041/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,000,000	12,308.39	615,419,922	11,849.36	592,468,264	2.875	2028/5/15	0.37

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	4,500,000	13,385.10	602,329,770	12,976.60	583,947,205	0.000	2029/11/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	14,773.59	590,943,907	14,591.49	583,659,847	4.250	2023/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,485.79	585,775,344	11,380.37	580,398,925	2.750	2024/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000	13,694.54	575,171,075	13,596.00	571,032,334	1.750	2023/5/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.5	3,850,000	15,407.07	593,172,519	14,828.74	570,906,671	1.500	2031/5/25	0.35
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 0.5	4,100,000	14,051.26	576,101,729	13,784.82	565,177,835	0.500	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	12,180.56	584,667,188	11,745.60	563,789,063	2.750	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	11,992.43	587,629,437	11,488.28	562,925,781	2.375	2029/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	11,843.55	580,334,180	11,477.49	562,397,024	2.375	2027/5/15	0.35

## □ 種類別の投資比率

2021年 2月26日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.81
合計	98.81

### 投資不動産物件

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2021年 2月26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	114	日本円	2,200,243,100	2,138,070,000	1.15

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2021年 2月26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 2103	買建	83	米ドル	15,925,549	1,692,089,581	15,886,200	1,687,908,750	0.62
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 2103	買建	77	ユーロ	2,775,884	358,505,419	2,839,760	366,755,004	0.13
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 2103	買建	6	オーストラリアドル	1,007,152	83,905,833	1,018,950	84,888,724	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 2103	買建	11	英ポンド	717,302	106,505,001	729,025	108,245,632	0.03

(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。

2021年 2月26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	460,000.00	48,870,400	48,870,400	0.01
	カナダドル	買建	10,000.00	840,850	840,800	0.00
	ユーロ	買建	70,000.00	9,040,220	9,040,500	0.00
	スイスフラン	買建	30,000.00	3,519,840	3,520,200	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	100,000.00	1,277,300	1,277,000	0.00
	ノルウェークローネ	買建	20,000.00	248,860	248,800	0.00
	デンマーククローネ	買建	40,000.00	694,720	694,800	0.00
	香港ドル	買建	160,000.00	2,192,000	2,192,000	0.00
	米ドル	売建	2,520,000.00	267,246,000	267,724,800	0.09
	カナダドル	売建	110,000.00	9,319,750	9,248,800	0.00
	ユーロ	売建	180,000.00	23,212,080	23,247,000	0.00
	スイスフラン	売建	80,000.00	9,353,840	9,387,200	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	320,000.00	4,096,960	4,086,400	0.00
	ノルウェークローネ	売建	40,000.00	505,800	497,600	0.00
	デンマーククローネ	売建	160,000.00	2,774,400	2,779,200	0.00
	香港ドル	売建	240,000.00	3,282,000	3,288,000	0.00
	シンガポールドル	売建	10,000.00	804,070	800,000	0.00
	イスラエルシェケル	売建	30,000.00	974,070	967,200	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。

## 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。

## 参考情報

基準日:2021年2月26日

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

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

### ■マイパッケージNEXT30



決算期	分配金
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

### ■マイパッケージNEXT50



決算期	分配金
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

### ■マイパッケージNEXT70



決算期	分配金
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。



## 主要な資産の状況

### ■マイパッケージNEXT30

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.96
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	55.40
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)	19.49
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	10.15
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	9.99

### ■マイパッケージNEXT50

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.10
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.45
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)	34.27
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	15.05
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	10.13

### ■マイパッケージNEXT70

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.13
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	49.20
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	20.19
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	15.28
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	10.19

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■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	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.15
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の興建で 1.15%

## 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	3.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.98
日本	株式	ソニー	電気機器	2.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	1.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.40
日本	株式	日本電産	電気機器	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21

## ■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	80.32
特殊債券	日本	9.26
地方債証券	日本	6.67
社債券	日本	3.00
	フランス	0.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.59
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419回利付国債(2年)	0.100	2022/12/01	1.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.62
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	0.100	2030/09/20	1.49
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	0.100	2025/12/20	1.31
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.18
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	0.100	2025/09/20	1.03
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	1.03
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	0.100	2025/06/20	0.99
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.97
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.85

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	66.38
	イギリス	4.52
	カナダ	3.50
	フランス	3.36
	スイス	3.31
	ドイツ	3.04
	その他	12.79
投資証券	アメリカ・その他	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.81
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の興建で 0.81%

## 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	4.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.67
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.25
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.24
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.95
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	0.88
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.74

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	42.49
	フランス	10.59
	イタリア	9.58
	ドイツ	7.46
	イギリス	6.60
	スペイン	6.02
	オーストラリア	2.70
	その他	13.37
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1.19
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	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/08/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	0.375	2027/09/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	0.125	2023/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	0.250	2023/06/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	3.500	2030/03/01	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.42

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■マイパッケージNEXT30



### ■マイパッケージNEXT50



### ■マイパッケージNEXT70



※2019年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2019年6月28日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2021年の収益率は、年初から2021年2月26日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマーク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取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法

がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

#### 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。

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

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

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかか

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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、「マイパッケージNEXT30」は「マイN30」、「マイパッケージNEXT50」は「マイN50」、「マイパッケージNEXT70」は「マイN70」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。

#### (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】

2019年6月28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2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

##### イ 信託の終了

##### （イ）信託契約の解約

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

##### （ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

##### （ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

##### （ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

##### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### （イ）収益分配金

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

#### (ロ) 償還金

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

### 八 信託約款の変更等

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

### 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、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無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に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。

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(2020年2月19日から2021年2月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2020年 2月18日現在)	第2期 (2021年 2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	49,098	-
コール・ローン	3,167	6,453,577
親投資信託受益証券	984,490	122,996,937
未収入金	-	435,000
流動資産合計	1,036,755	129,885,514
資産合計	1,036,755	129,885,514
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	464,390
未払受託者報酬	42	9,804
未払委託者報酬	179	58,749
未払利息	-	18
その他未払費用	1	2,873
流動負債合計	222	535,834
負債合計	222	535,834
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,000,000	119,003,460
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	36,533	10,346,220
元本等合計	1,036,533	129,349,680
純資産合計	1,036,533	129,349,680
負債純資産合計	1,036,755	129,885,514

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期		第2期	
	自	2019年 6月28日 至 2020年 2月18日	自	2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		37,490		6,333,447
営業収益合計		37,490		6,333,447
営業費用				
支払利息		-		2,083
受託者報酬		191		12,212
委託者報酬		765		73,024
その他費用		1		3,879
営業費用合計		957		91,198
営業利益又は営業損失( )		36,533		6,242,249
経常利益又は経常損失( )		36,533		6,242,249
当期純利益又は当期純損失( )		36,533		6,242,249
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( )		-		329,045
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		36,533
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,622,742
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		-		4,622,742
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		226,259
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		226,259
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( )		36,533		10,346,220

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第2期
	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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1期	第2期
	( 2020年 2月18日現在 )	( 2021年 2月18日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,000,000口	119,003,460口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0365円 (10,000口当たりの純資産額 10,365円)	1口当たり純資産額 1.0869円 (10,000口当たりの純資産額 10,869円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18日	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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（9,405円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（27,128円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は36,533円（1万口当たり365.33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（687,721円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（5,225,483円）、収益調整金（4,408,636円）、および分配準備積立金（24,380円）より、分配対象収益は10,346,220円（1万口当たり869.39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2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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2期 (2021年 2月18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1期(自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18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	34,721円
合計	34,721円

第2期(自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	5,751,776円
合計	5,751,776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2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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1期 ( 2020年 2月18日現在 )	第2期 ( 2021年 2月18日現在 )
期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	-円	129,718,508円
期中一部解約元本額	-円	11,715,048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 )	8,116,700	25,824,904	
	外国株式インデックス・マザーファンド	2,741,835	12,898,688	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	6,805,603	13,002,785	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	55,942,355	71,270,560	
合計		73,606,493	122,996,937	



## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・年金バランス50(標準型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2020年 2月18日現在)	第2期 (2021年 2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	109,001	-
コール・ローン	7,030	17,041,155
親投資信託受益証券	2,163,911	318,577,696
流動資産合計	2,279,942	335,618,851
資産合計	2,279,942	335,618,851
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	70,517
未払受託者報酬	42	28,216
未払委託者報酬	180	169,243
未払利息	-	49
その他未払費用	1	8,397
流動負債合計	223	276,422
負債合計	223	276,422
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,156,528	291,333,032
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	123,191	44,009,397
元本等合計	2,279,719	335,342,429
純資産合計	2,279,719	335,342,429
負債純資産合計	2,279,942	335,618,851

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期		第2期	
	自	2019年 6月28日	自	2020年 2月19日
	至	2020年 2月18日	至	2021年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		52,911		31,775,785
営業収益合計		52,911		31,775,785
営業費用				
支払利息		-		6,521
受託者報酬		192		36,073
委託者報酬		769		216,370
その他費用		1		11,933
営業費用合計		962		270,897
営業利益又は営業損失( )		51,949		31,504,888
経常利益又は経常損失( )		51,949		31,504,888
当期純利益又は当期純損失( )		51,949		31,504,888
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		-		1,641,709
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		123,191
剰余金増加額又は欠損金減少額		71,242		14,910,655
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		71,242		14,910,655
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		887,628
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		887,628
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( )		123,191		44,009,397

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第2期
	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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1期	第2期
	( 2020年 2月18日現在 )	( 2021年 2月18日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,156,528口	291,333,032口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0571円 (10,000口当たりの純資産額 10,571円)	1口当たり純資産額 1.1511円 (10,000口当たりの純資産額 11,511円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第1期	第2期
	自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18日	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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（11,189円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（40,760円）、収益調整金（71,242円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は123,191円（1万口当たり571.22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（2,214,750円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（27,648,429円）、収益調整金（14,102,418円）、および分配準備積立金（43,800円）より、分配対象収益は44,009,397円（1万口当たり1,510.59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2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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2期 (2021年 2月18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1期(自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18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	49,916円
合計	49,916円

第2期(自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	29,578,110円
合計	29,578,110円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (2020年 2月18日現在)	第2期 (2021年 2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,156,528円
期中追加設定元本額	1,156,528円	322,790,706円
期中一部解約元本額	-円	33,614,202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）	36,797,812	117,079,598	
	外国株式インデックス・マザーファンド	10,771,338	50,672,682	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	17,506,667	33,448,237	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	92,132,794	117,377,179	
合計		157,208,611	318,577,696	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2020年 2月18日現在)	第2期 (2021年 2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	50,973	-
コール・ローン	3,287	10,710,390
親投資信託受益証券	1,024,437	202,385,361
未収入金	-	1,100,000
流動資産合計	1,078,697	214,195,751
資産合計	1,078,697	214,195,751
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,168,057
未払受託者報酬	43	16,461
未払委託者報酬	182	98,655
未払利息	-	31
その他未払費用	1	4,870
流動負債合計	226	1,288,074
負債合計	226	1,288,074
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,000,000	175,175,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	78,471	37,732,022
元本等合計	1,078,471	212,907,677
純資産合計	1,078,471	212,907,677
負債純資産合計	1,078,697	214,195,751

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期		第2期	
	自	2019年 6月28日 至 2020年 2月18日	自	2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		79,437		25,798,924
営業収益合計		79,437		25,798,924
営業費用				
支払利息		-		3,626
受託者報酬		193		20,040
委託者報酬		772		119,974
その他費用		1		6,528
営業費用合計		966		150,168
営業利益又は営業損失( )		78,471		25,648,756
経常利益又は経常損失( )		78,471		25,648,756
当期純利益又は当期純損失( )		78,471		25,648,756
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		-		1,056,807
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		78,471
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,597,725
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		-		13,597,725
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		536,123
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		536,123
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( )		78,471		37,732,022

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期
	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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1期	第2期
	( 2020年 2月18日現在 )	( 2021年 2月18日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,000,000口	175,175,655口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0785円 (10,000口当たりの純資産額 10,785円)	1口当たり純資産額 1.2154円 (10,000口当たりの純資産額 12,154円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第1期	第2期
	自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18日	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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（11,894円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（66,577円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は78,471円（1万口当たり784.71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（1,296,049円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（23,295,900円）、収益調整金（13,770,789円）、および分配準備積立金（63,628円）より、分配対象収益は38,426,366円（1万口当たり2,193.57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2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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2期 (2021年 2月18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1期(自 2019年 6月28日 至 2020年 2月18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	77,151円
合計	77,151円

第2期(自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	24,983,975円
合計	24,983,975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2期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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1期 ( 2020年 2月18日現在 )	第2期 ( 2021年 2月18日現在 )
期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	-円	190,606,278円
期中一部解約元本額	-円	16,430,623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 )	33,328,379	106,040,903	
	外国株式インデックス・マザーファンド	9,141,735	43,006,378	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	11,099,081	21,205,904	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	25,221,489	32,132,176	
合計		78,790,684	202,385,361	

## 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DS・年金バランス30(債券重点型)」、「三井住友DS・年金バランス50(標準型)」および「三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 貸借対照表

	(単位:円)	
	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,374,330,437	502,280
コール・ローン	217,628,532	1,720,766,125
株式	165,239,345,060	191,629,346,460
派生商品評価勘定	33,900	1,288,400
未収入金	-	834,420,600
未収配当金	274,012,742	258,091,983
前払金	105,020,000	6,325,000
流動資産合計	169,210,370,671	194,450,740,848
資産合計	169,210,370,671	194,450,740,848
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	105,302,500	7,672,800
未払金	50,590,000	32,510,000
未払解約金	55,889,728	898,854,281
未払利息	643	4,991
その他未払費用	37,546	-
流動負債合計	211,820,417	939,042,072
負債合計	211,820,417	939,042,072
純資産の部		
元本等		
元本	63,487,344,187	60,820,017,437
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	105,511,206,067	132,691,681,339
元本等合計	168,998,550,254	193,511,698,776
純資産合計	168,998,550,254	193,511,698,776
負債純資産合計	169,210,370,671	194,450,740,848

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,037,600,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,237,200,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,487,344,187口	60,820,017,437口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.6619円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,619円)</p>	<p>1口当たり純資産額 3.1817円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 31,817円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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、株式、新株予約権証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (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	(2021年 2月18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) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600
	東証株価指数先物	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600
	合計	3,874,948,600	-	3,769,680,000	105,268,600

(2021年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400
	東証株価指数先物	1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400
	合計	1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 2020年 2月18日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,179,274,809円
同期中における追加設定元本額	6,667,199,934円
同期中における一部解約元本額	11,359,130,556円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,962,956,005円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	899,792,988円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,246,929,769円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,050,011,107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)	147,935,771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)	7,077,011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)	24,690,524円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	66,210,067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)	111,561,135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)	75,508,956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)	164,558,698円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,418,399,205円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	12,163,001,184円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	694,688,267円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	710,823,587円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	541,400,084円
イオン・バランス戦略ファンド	43,891,805円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	13,245,790円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	68,627,795円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	59,324,587円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	171,410,982円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	88,467,156円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	109,282,288円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	14,855,913円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,145,713円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	74,615円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	295,775円

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	195,612円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,710,915円
S M A M・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,602,416,183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 >	23,376,394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 >	201,884,802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 >	2,889,783,682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 >	2,239,982,115円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	8,216,696,177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 >	52,551,780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 >	204,406,548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 >	764,319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 >	879,952,814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 >	54,695,884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 >	341,485,545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 >	1,024,074,965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 >	834,268,065円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,684,197,713円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	1,100,852円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	58,764,376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 >	69,407,060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 >	42,189,224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 >	21,110,955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 >	173,909,824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 >	336,437,232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 >	103,508,877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 >	57,354,700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 >	9,142,133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 >	65,926,808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 >	845,306,433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)	193,966,679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 >	16,650,131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 >	982,474,504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 >	176,502,720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 >	1,461,440,781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 >	102,546,812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 >	23,212,563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 >	76,939,106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 >	70,210,715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 >	489,631,412円
合計	63,487,344,187円

(2021年 2月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	63,487,344,187円
同期中における追加設定元本額	16,694,979,606円
同期中における一部解約元本額	19,362,306,356円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,404,590,793円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	898,808,952円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,316,392,926円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,161,513,971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)	164,327,444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)	4,745,714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)	21,665,760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)	62,490,514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)	126,044,617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)	99,906,541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)	194,915,092円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,071,059,349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	15,499,280,590円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	466,003,423円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	495,863,983円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	321,041,412円
イオン・バランス戦略ファンド	121,929,057円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	22,024,273円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	120,727,451円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	100,041,705円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	327,627,673円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	164,695,408円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	189,610,939円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	22,761,586円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	148,890,453円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	8,116,700円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	36,797,812円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	33,328,379円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,050,685円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,211,203,189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>	18,445,249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>	137,166,232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>	2,206,990,978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>	1,875,824,112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>	7,015,323,174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>	43,890,062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>	181,035,305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>	438,764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>	800,316,032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>	50,237,510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>	298,824,987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>	899,084,795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>	709,877,322円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	2,199,096,195円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	481,330円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	49,105,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	54,941,254円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,287,272円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	19,662,852円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	143,136,198円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	285,706,660円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	76,958,035円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	45,963,151円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,816,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	52,051,459円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	702,005,565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)	182,193,344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>	333,495,594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>	140,494,480円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	916,105,450円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	79,523,793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>	22,065,298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>	61,606,512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>	51,678,499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>	303,731,689円
合計	60,820,017,437円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,060.00	10,710,000	
日本水産	90,500	495.00	44,797,500	
マルハニチロ	15,100	2,444.00	36,904,400	
雪国まいたけ	6,100	1,741.00	10,620,100	
カネコ種苗	4,700	1,580.00	7,426,000	
サカタのタネ	11,700	4,025.00	47,092,500	
ホクト	8,200	2,146.00	17,597,200	
日鉄鉱業	2,300	5,700.00	13,110,000	
国際石油開発帝石	360,600	790.00	284,874,000	

石油資源開発	12,800	2,386.00	30,540,800
K & O エナジーグループ	5,800	1,440.00	8,352,000
ヒノキヤグループ	3,300	2,208.00	7,286,400
ショーボンドホールディングス	14,100	4,745.00	66,904,500
ミライト・ホールディングス	32,500	1,733.00	56,322,500
タマホーム	6,300	1,915.00	12,064,500
ベステラ	3,200	1,672.00	5,350,400
スペースバリューホールディングス	14,200	737.00	10,465,400
安藤・間	62,600	768.00	48,076,800
東急建設	30,800	537.00	16,539,600
コムシスホールディングス	34,600	3,280.00	113,488,000
ピーアールホールディングス	13,600	727.00	9,887,200
高松コンストラクショングループ	6,300	2,155.00	13,576,500
東建コーポレーション	3,000	8,640.00	25,920,000
大成建設	70,000	3,750.00	262,500,000
大林組	224,200	922.00	206,712,400
清水建設	210,300	803.00	168,870,900
飛鳥建設	9,400	1,114.00	10,471,600
長谷工コーポレーション	73,200	1,377.00	100,796,400
松井建設	11,800	707.00	8,342,600
銭高組	1,700	4,515.00	7,675,500
鹿島建設	164,600	1,430.00	235,378,000
不動テトラ	6,900	1,802.00	12,433,800
大末建設	7,100	893.00	6,340,300
鉄建建設	6,500	1,962.00	12,753,000
西松建設	16,700	2,543.00	42,468,100
三井住友建設	55,100	457.00	25,180,700
大豊建設	5,200	3,670.00	19,084,000
前田建設工業	58,600	942.00	55,201,200
奥村組	12,500	2,648.00	33,100,000
東鉄工業	9,000	2,687.00	24,183,000
浅沼組	3,200	4,545.00	14,544,000
戸田建設	95,300	748.00	71,284,400
熊谷組	10,400	2,811.00	29,234,400
北野建設	2,400	2,462.00	5,908,800
矢作建設工業	12,100	845.00	10,224,500

ピーエス三菱	10,400	689.00	7,165,600	
日本ハウスホールディングス	22,100	330.00	7,293,000	
大東建託	24,700	12,020.00	296,894,000	
新日本建設	10,500	842.00	8,841,000	
N I P P O	17,800	2,827.00	50,320,600	
東亜道路工業	1,900	4,065.00	7,723,500	
前田道路	14,700	2,001.00	29,414,700	
日本道路	2,300	7,900.00	18,170,000	
東亜建設工業	6,800	2,102.00	14,293,600	
日本国土開発	22,200	562.00	12,476,400	
若築建設	6,500	1,270.00	8,255,000	
東洋建設	26,700	554.00	14,791,800	
五洋建設	97,200	800.00	77,760,000	
世紀東急工業	13,300	892.00	11,863,600	
福田組	2,800	5,160.00	14,448,000	
住友林業	53,500	2,105.00	112,617,500	
巴コーポレーション	15,200	392.00	5,958,400	
大和ハウス工業	209,000	3,272.00	683,848,000	
ライト工業	12,500	1,659.00	20,737,500	
積水ハウス	245,600	2,082.50	511,462,000	
ユアテック	13,900	824.00	11,453,600	
日本リーテック	5,400	2,573.00	13,894,200	
中電工	8,900	2,209.00	19,660,100	
関電工	34,800	881.00	30,658,800	
きんでん	47,700	1,785.00	85,144,500	
東京エネシス	8,900	930.00	8,277,000	
トーエネック	2,900	3,810.00	11,049,000	
住友電設	6,400	2,434.00	15,577,600	
日本電設工業	11,500	1,964.00	22,586,000	
協和エクシオ	33,600	2,728.00	91,660,800	
新日本空調	6,400	2,245.00	14,368,000	
九電工	16,000	3,395.00	54,320,000	
三機工業	15,700	1,286.00	20,190,200	
日揮ホールディングス	76,200	1,353.00	103,098,600	
中外炉工業	4,300	1,751.00	7,529,300	
ヤマト	9,400	676.00	6,354,400	



太平電業	5,400	2,626.00	14,180,400
高砂熱学工業	19,500	1,626.00	31,707,000
朝日工業社	2,500	3,005.00	7,512,500
明星工業	15,900	828.00	13,165,200
大気社	10,800	2,953.00	31,892,400
ダイダン	5,100	2,846.00	14,514,600
日比谷総合設備	7,800	1,867.00	14,562,600
OSJBホールディングス	39,700	270.00	10,719,000
レイズネクスト	12,500	1,197.00	14,962,500
ニッポン	19,900	1,615.00	32,138,500
日清製粉グループ本社	81,400	1,756.00	142,938,400
昭和産業	5,500	3,280.00	18,040,000
鳥越製粉	8,500	850.00	7,225,000
中部飼料	8,700	1,430.00	12,441,000
フィード・ワン	10,500	912.00	9,576,000
日本甜菜製糖	5,100	1,674.00	8,537,400
三井製糖	5,300	1,932.00	10,239,600
日新製糖	4,200	1,866.00	7,837,200
森永製菓	17,000	4,125.00	70,125,000
中村屋	2,700	3,945.00	10,651,500
江崎グリコ	19,800	4,610.00	91,278,000
名糖産業	5,800	1,516.00	8,792,800
井村屋グループ	4,500	2,458.00	11,061,000
不二家	5,100	2,301.00	11,735,100
山崎製パン	54,000	1,934.00	104,436,000
モロゾフ	1,700	5,650.00	9,605,000
亀田製菓	4,100	4,820.00	19,762,000
寿スピリッツ	6,900	6,840.00	47,196,000
カルビー	33,100	2,952.00	97,711,200
森永乳業	13,400	4,875.00	65,325,000
六甲バター	5,900	1,791.00	10,566,900
ヤクルト本社	49,700	5,690.00	282,793,000
明治ホールディングス	47,900	7,100.00	340,090,000
雪印メグミルク	17,200	2,217.00	38,132,400
プリマハム	9,600	3,430.00	32,928,000
日本ハム	27,400	4,710.00	129,054,000

丸大食品	7,200	1,704.00	12,268,800	
S Foods	6,500	3,485.00	22,652,500	
柿安本店	3,000	2,749.00	8,247,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	42,500	752.00	31,960,000	
サッポロホールディングス	24,800	2,249.00	55,775,200	
アサヒグループホールディングス	158,300	4,619.00	731,187,700	
キリンホールディングス	306,900	2,114.00	648,786,600	
宝ホールディングス	53,000	1,580.00	83,740,000	
オエノンホールディングス	24,500	400.00	9,800,000	
養命酒製造	3,700	1,924.00	7,118,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	56,000	1,861.00	104,216,000	
サントリー食品インターナショナル	47,900	3,735.00	178,906,500	
ダイドーグループホールディングス	4,000	5,340.00	21,360,000	
伊藤園	21,900	6,520.00	142,788,000	
キーコーヒー	7,100	2,161.00	15,343,100	
日清オイリオグループ	8,800	3,200.00	28,160,000	
不二製油グループ本社	17,700	3,295.00	58,321,500	
かどや製油	1,400	4,105.00	5,747,000	
J - オイルミルズ	3,300	3,800.00	12,540,000	
キッコーマン	52,000	7,630.00	396,760,000	
味の素	172,200	2,288.50	394,079,700	
キューピー	40,200	2,423.00	97,404,600	
ハウス食品グループ本社	26,900	3,770.00	101,413,000	
カゴメ	29,500	3,405.00	100,447,500	
焼津水産化学工業	4,800	1,000.00	4,800,000	
アリアケジャパン	6,700	6,980.00	46,766,000	
ニチレイ	34,300	2,821.00	96,760,300	
東洋水産	37,100	4,645.00	172,329,500	
イトアンドホールディングス	4,300	1,982.00	8,522,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	936.00	4,960,800	
日清食品ホールディングス	28,300	8,470.00	239,701,000	
永谷園ホールディングス	4,300	2,357.00	10,135,100	
一正蒲鉾	4,000	1,137.00	4,548,000	
フジッコ	7,700	2,022.00	15,569,400	
ロック・フィールド	7,500	1,590.00	11,925,000	

日本たばこ産業	387,300	1,950.00	755,235,000
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,975.00	10,665,000
わらべや日洋ホールディングス	5,600	1,788.00	10,012,800
なとり	5,500	1,990.00	10,945,000
ピククルスコーポレーション	2,000	3,520.00	7,040,000
北の達人コーポレーション	25,100	641.00	16,089,100
ユーグレナ	31,000	995.00	30,845,000
ミヨシ油脂	4,700	1,206.00	5,668,200
理研ビタミン	8,100	1,370.00	11,097,000
片倉工業	10,600	1,354.00	14,352,400
ゲンゼ	5,100	3,805.00	19,405,500
東洋紡	29,100	1,326.00	38,586,600
ユニチカ	24,200	455.00	11,011,000
富士紡ホールディングス	3,700	4,420.00	16,354,000
倉敷紡績	6,900	1,901.00	13,116,900
シキボウ	6,300	1,012.00	6,375,600
日本毛織	22,900	956.00	21,892,400
帝国繊維	8,300	2,305.00	19,131,500
帝人	66,000	1,864.00	123,024,000
東レ	512,800	712.50	365,370,000
住江織物	2,700	2,040.00	5,508,000
アツギ	11,300	538.00	6,079,400
ダイニック	6,000	792.00	4,752,000
セーレン	17,700	1,866.00	33,028,200
小松マテーレ	12,300	1,010.00	12,423,000
ワコールホールディングス	18,400	2,283.00	42,007,200
ホギメディカル	9,600	3,250.00	31,200,000
T S Iホールディングス	28,900	277.00	8,005,300
マツオカコーポレーション	2,900	1,949.00	5,652,100
ワールド	10,200	1,384.00	14,116,800
オンワードホールディングス	47,500	280.00	13,300,000
ゴールドウイン	11,800	7,410.00	87,438,000
デサント	12,400	1,712.00	21,228,800
特種東海製紙	4,500	4,695.00	21,127,500
王子ホールディングス	316,300	706.00	223,307,800
日本製紙	31,700	1,376.00	43,619,200

北越コーポレーション	51,500	506.00	26,059,000	
中越パルプ工業	5,400	1,194.00	6,447,600	
大王製紙	33,400	2,100.00	70,140,000	
レンゴー	73,300	863.00	63,257,900	
トーモク	5,400	1,812.00	9,784,800	
ザ・パック	5,800	2,691.00	15,607,800	
クラレ	110,800	1,202.00	133,181,600	
旭化成	467,600	1,163.50	544,052,600	
昭和電工	53,600	2,649.00	141,986,400	
住友化学	552,800	514.00	284,139,200	
住友精化	3,600	3,990.00	14,364,000	
日産化学	38,900	6,060.00	235,734,000	
ラサ工業	2,800	2,204.00	6,171,200	
クレハ	6,000	7,180.00	43,080,000	
多木化学	2,900	6,230.00	18,067,000	
テイカ	6,000	1,456.00	8,736,000	
石原産業	14,800	796.00	11,780,800	
日本曹達	9,800	3,385.00	33,173,000	
東ソー	108,600	1,951.00	211,878,600	
トクヤマ	20,900	2,600.00	54,340,000	
セントラル硝子	14,100	2,249.00	31,710,900	
東亜合成	43,800	1,212.00	53,085,600	
大阪ソーダ	6,900	2,650.00	18,285,000	
関東電化工業	17,900	879.00	15,734,100	
デンカ	25,800	4,105.00	105,909,000	
信越化学工業	130,600	18,540.00	2,421,324,000	
堺化学工業	5,500	2,026.00	11,143,000	
第一稀元素化学工業	8,600	998.00	8,582,800	
エア・ウォーター	71,700	1,715.00	122,965,500	
日本酸素ホールディングス	58,000	1,998.00	115,884,000	
日本化学工業	2,500	3,145.00	7,862,500	
日本パーカライズिंग	36,800	1,105.00	40,664,000	
高压ガス工業	13,000	744.00	9,672,000	
四国化成工業	9,800	1,259.00	12,338,200	
ステラ ケミファ	4,000	3,275.00	13,100,000	
保土谷化学工業	2,200	5,000.00	11,000,000	

日本触媒	12,900	5,790.00	74,691,000
大日精化工業	5,800	2,401.00	13,925,800
カネカ	18,200	4,265.00	77,623,000
三菱瓦斯化学	70,400	2,551.00	179,590,400
三井化学	60,600	3,305.00	200,283,000
J S R	70,900	3,420.00	242,478,000
東京応化工業	12,200	6,880.00	83,936,000
大阪有機化学工業	6,500	3,720.00	24,180,000
三菱ケミカルホールディングス	472,400	733.70	346,599,880
K Hネオケム	11,900	2,506.00	29,821,400
ダイセル	95,200	830.00	79,016,000
住友ベークライト	11,400	4,460.00	50,844,000
積水化学工業	149,400	2,034.00	303,879,600
日本ゼオン	63,900	1,639.00	104,732,100
アイカ工業	19,700	3,915.00	77,125,500
宇部興産	35,400	2,096.00	74,198,400
積水樹脂	11,700	2,080.00	24,336,000
タキロンシーアイ	16,500	688.00	11,352,000
旭有機材	5,100	1,490.00	7,599,000
ニチバン	4,800	1,829.00	8,779,200
リケンテクノス	19,800	496.00	9,820,800
大倉工業	3,800	1,981.00	7,527,800
積水化成成品工業	12,000	565.00	6,780,000
群栄化学工業	2,600	2,509.00	6,523,400
ダイキョーニシカワ	15,400	820.00	12,628,000
森六ホールディングス	4,600	2,083.00	9,581,800
日本化薬	44,900	1,061.00	47,638,900
カーリットホールディングス	8,700	731.00	6,359,700
日本精化	5,900	1,419.00	8,372,100
扶桑化学工業	5,400	3,965.00	21,411,000
トリケミカル研究所	6,300	4,125.00	25,987,500
A D E K A	32,700	1,858.00	60,756,600
日油	26,300	5,750.00	151,225,000
新日本理化	15,000	274.00	4,110,000
ハリマ化成グループ	6,700	943.00	6,318,100
花王	172,600	7,504.00	1,295,190,400

第一工業製薬	2,700	3,825.00	10,327,500	
ニイタカ	2,000	2,716.00	5,432,000	
三洋化成工業	4,100	5,250.00	21,525,000	
大日本塗料	10,100	933.00	9,423,300	
日本ペイントホールディングス	58,200	8,610.00	501,102,000	
関西ペイント	79,200	2,972.00	235,382,400	
中国塗料	18,000	944.00	16,992,000	
日本特殊塗料	6,500	1,209.00	7,858,500	
藤倉化成	12,600	532.00	6,703,200	
太陽ホールディングス	5,200	5,820.00	30,264,000	
D I C	29,700	2,767.00	82,179,900	
サカティンクス	15,900	1,094.00	17,394,600	
東洋インキS Cホールディングス	13,800	1,991.00	27,475,800	
T & K T O K A	8,200	835.00	6,847,000	
富士フイルムホールディングス	126,700	6,350.00	804,545,000	
資生堂	143,300	8,250.00	1,182,225,000	
ライオン	93,500	2,188.00	204,578,000	
高砂香料工業	4,900	2,605.00	12,764,500	
マンダム	15,700	1,846.00	28,982,200	
ミルボン	9,800	6,640.00	65,072,000	
ファンケル	26,300	4,040.00	106,252,000	
コーセー	13,600	18,360.00	249,696,000	
コタ	5,500	1,646.00	9,053,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	31,000	2,483.00	76,973,000	
ノエビアホールディングス	6,100	4,955.00	30,225,500	
新日本製薬	2,000	2,665.00	5,330,000	
エステー	5,400	1,988.00	10,735,200	
アグロ カネショウ	3,600	1,625.00	5,850,000	
コニシ	11,900	1,657.00	19,718,300	
長谷川香料	12,400	1,983.00	24,589,200	
小林製薬	20,100	10,830.00	217,683,000	
荒川化学工業	7,000	1,294.00	9,058,000	
メック	5,200	2,050.00	10,660,000	
タカラバイオ	18,800	3,260.00	61,288,000	
J C U	8,100	3,335.00	27,013,500	
デクセリアルズ	20,600	1,455.00	29,973,000	

アース製薬	5,400	6,140.00	33,156,000	
北興化学工業	7,400	1,051.00	7,777,400	
大成ラミック	3,200	2,883.00	9,225,600	
クミアイ化学工業	30,700	891.00	27,353,700	
日本農薬	16,800	529.00	8,887,200	
アキレス	6,100	1,498.00	9,137,800	
有沢製作所	11,500	987.00	11,350,500	
日東電工	46,000	9,410.00	432,860,000	
レック	9,200	1,346.00	12,383,200	
三光合成	9,800	446.00	4,370,800	
藤森工業	6,200	4,595.00	28,489,000	
未来工業	3,600	1,767.00	6,361,200	
J S P	5,200	1,808.00	9,401,600	
エフピコ	13,400	4,180.00	56,012,000	
天馬	6,000	2,151.00	12,906,000	
信越ポリマー	11,200	1,029.00	11,524,800	
東リ	26,000	247.00	6,422,000	
ニフコ	26,500	3,875.00	102,687,500	
バルカー	6,100	2,141.00	13,060,100	
ユニ・チャーム	153,000	4,904.00	750,312,000	
協和キリン	72,100	3,250.00	234,325,000	
武田薬品工業	599,700	3,740.00	2,242,878,000	
アステラス製薬	624,500	1,779.50	1,111,297,750	
大日本住友製薬	53,700	1,764.00	94,726,800	
塩野義製薬	90,700	5,984.00	542,748,800	
あすか製薬	8,000	1,431.00	11,448,000	
日本新薬	20,500	7,780.00	159,490,000	
中外製薬	225,100	5,362.00	1,206,986,200	
科研製薬	12,500	4,220.00	52,750,000	
エーザイ	79,900	7,738.00	618,266,200	
ロート製薬	34,600	3,030.00	104,838,000	
小野薬品工業	165,900	3,090.00	512,631,000	
久光製薬	20,900	7,000.00	146,300,000	
持田製薬	10,300	4,220.00	43,466,000	
参天製薬	125,400	1,579.00	198,006,600	
扶桑薬品工業	3,300	2,640.00	8,712,000	

日本ケミファ	2,500	2,293.00	5,732,500
ツムラ	24,200	3,520.00	85,184,000
日医工	21,100	1,063.00	22,429,300
キッセイ薬品工業	13,400	2,253.00	30,190,200
生化学工業	13,400	1,076.00	14,418,400
栄研化学	12,800	2,166.00	27,724,800
鳥居薬品	4,700	3,000.00	14,100,000
J C R ファーマ	20,600	3,230.00	66,538,000
東和薬品	10,200	2,242.00	22,868,400
富士製薬工業	6,500	1,311.00	8,521,500
沢井製薬	15,700	4,975.00	78,107,500
ゼリア新薬工業	12,800	2,027.00	25,945,600
第一三共	618,600	3,316.00	2,051,277,600
キョーリン製薬ホールディングス	15,800	1,923.00	30,383,400
大幸薬品	9,200	1,330.00	12,236,000
ダイト	4,600	3,670.00	16,882,000
大塚ホールディングス	149,600	4,529.00	677,538,400
大正製薬ホールディングス	17,100	7,090.00	121,239,000
ペプチドリーム	36,800	5,410.00	199,088,000
日本コークス工業	75,400	106.00	7,992,400
ニチレキ	8,800	1,552.00	13,657,600
ユシロ化学工業	7,200	1,114.00	8,020,800
MORESCO	5,800	1,150.00	6,670,000
出光興産	79,900	2,830.00	226,117,000
E N E O S ホールディングス	1,086,100	464.00	503,950,400
コスモエネルギーホールディングス	23,000	2,521.00	57,983,000
横浜ゴム	41,200	1,793.00	73,871,600
TOYO TIRE	38,400	1,886.00	72,422,400
ブリヂストン	191,300	4,219.00	807,094,700
住友ゴム工業	63,200	1,160.00	73,312,000
オカモト	4,500	4,055.00	18,247,500
ニッタ	7,300	2,448.00	17,870,400
住友理工	15,300	648.00	9,914,400
三ツ星ベルト	9,000	1,725.00	15,525,000
バンドー化学	14,700	736.00	10,819,200
日東紡績	10,900	4,455.00	48,559,500



A G C	66,100	3,820.00	252,502,000	
日本板硝子	17,700	550.00	9,735,000	
日本電気硝子	27,400	2,510.00	68,774,000	
オハラ	4,000	2,016.00	8,064,000	
住友大阪セメント	13,600	3,495.00	47,532,000	
太平洋セメント	43,000	2,585.00	111,155,000	
日本ヒューム	11,000	766.00	8,426,000	
日本コンクリート工業	24,900	361.00	8,988,900	
三谷セキサン	3,400	5,400.00	18,360,000	
アジアパイルホールディングス	16,100	508.00	8,178,800	
東海カーボン	70,700	1,451.00	102,585,700	
日本カーボン	4,200	4,090.00	17,178,000	
東洋炭素	5,100	2,021.00	10,307,100	
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	3,540.00	15,222,000	
T O T O	51,500	6,970.00	358,955,000	
日本碍子	79,500	1,915.00	152,242,500	
日本特殊陶業	55,100	1,911.00	105,296,100	
M A R U W A	2,500	10,480.00	26,200,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	2,738.00	6,297,400	
黒崎播磨	1,600	4,790.00	7,664,000	
東京窯業	14,100	320.00	4,512,000	
フジインコーポレーテッド	5,900	4,185.00	24,691,500	
ニチアス	18,000	2,463.00	44,334,000	
ニチ八	10,100	3,105.00	31,360,500	
日本製鉄	340,400	1,526.50	519,620,600	
神戸製鋼所	130,400	631.00	82,282,400	
合同製鐵	4,600	2,116.00	9,733,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	205,300	1,102.00	226,240,600	
東京製鐵	28,200	721.00	20,332,200	
共英製鋼	8,900	1,442.00	12,833,800	
大和工業	15,600	2,729.00	42,572,400	
東京鐵鋼	3,400	1,980.00	6,732,000	
大阪製鐵	5,000	1,271.00	6,355,000	
淀川製鋼所	9,300	2,314.00	21,520,200	
丸一鋼管	23,100	2,517.00	58,142,700	
モリ工業	2,800	2,323.00	6,504,400	

大同特殊鋼	11,800	4,710.00	55,578,000
日本冶金工業	6,100	2,056.00	12,541,600
山陽特殊製鋼	9,100	1,778.00	16,179,800
愛知製鋼	4,200	3,305.00	13,881,000
日立金属	67,700	1,703.00	115,293,100
大太平洋金属	5,400	2,332.00	12,592,800
新日本電工	48,600	291.00	14,142,600
栗本鐵工所	4,400	1,794.00	7,893,600
三菱製鋼	8,700	737.00	6,411,900
日本精線	1,500	3,705.00	5,557,500
大紀アルミニウム工業所	10,900	784.00	8,545,600
日本軽金属ホールディングス	19,700	2,096.00	41,291,200
三井金属鉱業	19,200	3,735.00	71,712,000
東邦亜鉛	4,500	2,363.00	10,633,500
三菱マテリアル	46,900	2,549.00	119,548,100
住友金属鉱山	91,100	5,229.00	476,361,900
D O W Aホールディングス	17,900	4,080.00	73,032,000
古河機械金属	12,000	1,317.00	15,804,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,100	809.00	8,170,900
東邦チタニウム	13,500	964.00	13,014,000
U A C J	11,000	2,441.00	26,851,000
C Kサンエツ	1,900	3,875.00	7,362,500
古河電気工業	22,300	2,883.00	64,290,900
住友電気工業	248,700	1,556.50	387,101,550
フジクラ	87,500	511.00	44,712,500
昭和電線ホールディングス	7,200	1,755.00	12,636,000
タツタ電線	13,500	662.00	8,937,000
平河ヒューテック	5,100	1,190.00	6,069,000
リョービ	9,900	1,304.00	12,909,600
アサヒホールディングス	13,300	4,230.00	56,259,000
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,223.00	7,113,600
トーカロ	18,700	1,378.00	25,768,600
アルファC o	5,300	1,057.00	5,602,100
S U M C O	91,300	2,469.00	225,419,700
川田テクノロジーズ	1,900	4,545.00	8,635,500
R S Technologies	2,400	5,940.00	14,256,000

東洋製罐グループホールディングス	46,300	1,346.00	62,319,800
ホッカンホールディングス	5,300	1,441.00	7,637,300
横河ブリッジホールディングス	12,100	1,923.00	23,268,300
駒井ハルテック	2,300	2,097.00	4,823,100
三和ホールディングス	68,000	1,300.00	88,400,000
文化シャッター	21,200	1,019.00	21,602,800
三協立山	11,300	819.00	9,254,700
L I X I L	98,100	2,870.00	281,547,000
ノーリツ	15,700	1,669.00	26,203,300
長府製作所	7,000	2,086.00	14,602,000
リンナイ	13,900	11,490.00	159,711,000
日東精工	13,100	487.00	6,379,700
岡部	17,800	792.00	14,097,600
ジーテクト	9,400	1,452.00	13,648,800
東プレ	13,900	1,581.00	21,975,900
高周波熱錬	19,000	536.00	10,184,000
東京製綱	6,000	1,444.00	8,664,000
パイオラックス	11,000	1,669.00	18,359,000
エイチワン	9,100	796.00	7,243,600
日本発條	72,100	820.00	59,122,000
立川ブラインド工業	3,800	1,289.00	4,898,200
三益半導体工業	5,600	2,607.00	14,599,200
日本製鋼所	22,000	2,843.00	62,546,000
三浦工業	30,700	5,890.00	180,823,000
タクマ	23,700	1,974.00	46,783,800
ツガミ	14,700	1,585.00	23,299,500
オークマ	8,400	6,070.00	50,988,000
芝浦機械	7,600	2,929.00	22,260,400
アマダ	103,900	1,263.00	131,225,700
アイダエンジニアリング	18,900	968.00	18,295,200
F U J I	28,000	2,704.00	75,712,000
牧野フライス製作所	8,500	4,105.00	34,892,500
オーエスジー	35,800	1,972.00	70,597,600
旭ダイヤモンド工業	21,600	501.00	10,821,600
D M G 森精機	45,300	1,569.00	71,075,700
ソディック	15,800	997.00	15,752,600

ディスコ	9,700	34,500.00	334,650,000
日東工器	4,300	1,890.00	8,127,000
日進工具	3,100	2,716.00	8,419,600
豊和工業	5,200	872.00	4,534,400
石川製作所	2,400	1,737.00	4,168,800
島精機製作所	10,900	2,297.00	25,037,300
オプトラン	9,300	2,776.00	25,816,800
フリュー	8,300	1,123.00	9,320,900
ヤマシンフィルタ	14,300	890.00	12,727,000
日阪製作所	10,600	844.00	8,946,400
やまびこ	13,800	1,202.00	16,587,600
平田機工	3,300	7,420.00	24,486,000
マルマエ	3,200	1,234.00	3,948,800
タツモ	3,700	1,488.00	5,505,600
ナブテスコ	41,900	4,900.00	205,310,000
三井海洋開発	7,900	1,801.00	14,227,900
レオン自動機	7,800	1,149.00	8,962,200
S M C	21,100	65,820.00	1,388,802,000
ホソカワミクロン	2,600	7,020.00	18,252,000
ユニオンツール	2,800	3,405.00	9,534,000
オイレス工業	9,900	1,705.00	16,879,500
日精エー・エス・ビー機械	2,100	5,830.00	12,243,000
サトーホールディングス	9,600	2,499.00	23,990,400
技研製作所	6,300	5,160.00	32,508,000
日本エアーテック	3,100	1,223.00	3,791,300
日精樹脂工業	7,400	911.00	6,741,400
ワイエイシイホールディングス	3,900	986.00	3,845,400
小松製作所	326,300	3,231.00	1,054,275,300
住友重機械工業	40,800	2,914.00	118,891,200
日立建機	33,800	3,230.00	109,174,000
日工	13,300	725.00	9,642,500
巴工業	3,700	2,031.00	7,514,700
井関農機	8,500	1,540.00	13,090,000
T O W A	7,000	2,048.00	14,336,000
北川鉄工所	4,700	1,515.00	7,120,500
ローツェ	3,100	7,540.00	23,374,000

クボタ	378,600	2,459.50	931,166,700
荏原実業	2,100	4,725.00	9,922,500
三菱化工機	2,600	2,995.00	7,787,000
月島機械	13,600	1,339.00	18,210,400
帝国電機製作所	6,200	1,207.00	7,483,400
新東工業	18,000	766.00	13,788,000
澁谷工業	6,200	3,465.00	21,483,000
アイチ コーポレーション	12,900	905.00	11,674,500
小森コーポレーション	17,900	701.00	12,547,900
鶴見製作所	6,000	1,801.00	10,806,000
酒井重工業	2,200	2,129.00	4,683,800
荏原製作所	29,900	4,010.00	119,899,000
西島製作所	7,900	853.00	6,738,700
北越工業	9,100	1,110.00	10,101,000
ダイキン工業	91,900	23,255.00	2,137,134,500
オルガノ	2,300	6,080.00	13,984,000
トーヨーカネツ	3,300	2,785.00	9,190,500
栗田工業	38,800	4,335.00	168,198,000
椿本チエイン	9,800	2,873.00	28,155,400
大同工業	4,300	782.00	3,362,600
木村化工機	7,500	625.00	4,687,500
アネスト岩田	12,500	1,073.00	13,412,500
ダイフク	39,700	11,220.00	445,434,000
サムコ	2,000	3,570.00	7,140,000
加藤製作所	6,000	990.00	5,940,000
タダノ	36,300	1,012.00	36,735,600
フジテック	25,100	2,594.00	65,109,400
C K D	16,800	2,390.00	40,152,000
キトー	7,200	1,478.00	10,641,600
平和	20,000	1,580.00	31,600,000
理想科学工業	6,500	1,385.00	9,002,500
S A N K Y O	17,400	2,989.00	52,008,600
日本金銭機械	10,100	525.00	5,302,500
マースグループホールディングス	5,500	1,603.00	8,816,500
フクシマガリレイ	5,000	4,100.00	20,500,000
竹内製作所	11,900	2,760.00	32,844,000

アマノ	19,000	2,432.00	46,208,000	
JUKI	10,400	829.00	8,621,600	
蛇の目マシン工業	8,300	809.00	6,714,700	
マックス	9,900	1,605.00	15,889,500	
グローリー	18,800	2,339.00	43,973,200	
新晃工業	6,700	2,011.00	13,473,700	
大和冷機工業	11,800	1,087.00	12,826,600	
セガサミーホールディングス	65,400	1,830.00	119,682,000	
リケン	4,300	2,275.00	9,782,500	
T P R	9,900	1,538.00	15,226,200	
ツバキ・ナカシマ	13,500	1,233.00	16,645,500	
ホシザキ	22,700	9,910.00	224,957,000	
大豊工業	7,400	767.00	5,675,800	
日本精工	146,700	1,005.00	147,433,500	
N T N	170,100	311.00	52,901,100	
ジェイテクト	69,100	1,150.00	79,465,000	
不二越	6,700	4,585.00	30,719,500	
日本トムソン	23,100	546.00	12,612,600	
T H K	44,900	3,660.00	164,334,000	
ユーシン精機	6,400	948.00	6,067,200	
前澤給装工業	3,400	2,210.00	7,514,000	
イーグル工業	9,700	1,161.00	11,261,700	
日本ピラー工業	7,500	1,757.00	13,177,500	
キッツ	23,000	594.00	13,662,000	
マキタ	93,700	4,830.00	452,571,000	
日立造船	57,200	660.00	37,752,000	
三菱重工業	113,400	3,077.00	348,931,800	
I H I	48,700	1,977.00	96,279,900	
スター精密	11,400	1,561.00	17,795,400	
日清紡ホールディングス	45,600	797.00	36,343,200	
イビデン	34,700	4,785.00	166,039,500	
コニカミノルタ	148,600	574.00	85,296,400	
ブラザー工業	87,500	2,244.00	196,350,000	
ミネベアミツミ	123,600	2,640.00	326,304,000	
日立製作所	346,400	4,800.00	1,662,720,000	
三菱電機	719,700	1,626.00	1,170,232,200	

富士電機	43,300	4,535.00	196,365,500	
安川電機	77,400	5,800.00	448,920,000	
シンフォニアテクノロジー	10,000	1,352.00	13,520,000	
明電舎	12,600	2,395.00	30,177,000	
オリジン	4,300	1,346.00	5,787,800	
山洋電気	3,700	6,040.00	22,348,000	
デンヨー	6,600	2,187.00	14,434,200	
東芝テック	7,600	3,900.00	29,640,000	
芝浦メカトロニクス	1,500	4,855.00	7,282,500	
マブチモーター	20,000	4,940.00	98,800,000	
日本電産	173,500	14,600.00	2,533,100,000	
トレックス・セミコンダクター	5,100	1,503.00	7,665,300	
東光高岳	4,500	1,575.00	7,087,500	
ダイヘン	7,800	4,590.00	35,802,000	
ヤーマン	12,000	1,928.00	23,136,000	
JVCケンウッド	58,200	197.00	11,465,400	
ミマキエンジニアリング	11,200	559.00	6,260,800	
I - P E X	4,300	2,097.00	9,017,100	
日新電機	17,000	1,245.00	21,165,000	
大崎電気工業	18,300	610.00	11,163,000	
オムロン	60,100	9,410.00	565,541,000	
日東工業	10,700	2,131.00	22,801,700	
I D E C	10,400	1,834.00	19,073,600	
正興電機製作所	2,100	2,333.00	4,899,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,200	3,365.00	88,163,000	
メルコホールディングス	2,800	3,800.00	10,640,000	
日本電気	91,400	6,290.00	574,906,000	
富士通	64,800	15,735.00	1,019,628,000	
沖電気工業	30,800	1,045.00	32,186,000	
電気興業	4,000	2,852.00	11,408,000	
サンケン電気	8,700	5,560.00	48,372,000	
アイホン	5,100	1,772.00	9,037,200	
ルネサスエレクトロニクス	310,900	1,206.00	374,945,400	
セイコーエプソン	89,600	1,767.00	158,323,200	
ワコム	53,100	784.00	41,630,400	
アルバック	13,500	4,940.00	66,690,000	

E I Z O	6,300	3,770.00	23,751,000	
日本信号	17,700	966.00	17,098,200	
京三製作所	19,700	427.00	8,411,900	
能美防災	9,800	2,234.00	21,893,200	
ホーチキ	6,300	1,299.00	8,183,700	
エレコム	8,200	4,990.00	40,918,000	
パナソニック	768,700	1,459.50	1,121,917,650	
シャープ	83,500	2,256.00	188,376,000	
アンリツ	43,400	2,388.00	103,639,200	
富士通ゼネラル	22,200	3,070.00	68,154,000	
ソニー	451,800	12,000.00	5,421,600,000	
T D K	34,700	16,120.00	559,364,000	
帝国通信工業	6,400	1,153.00	7,379,200	
タムラ製作所	28,100	546.00	15,342,600	
アルプスアルパイン	60,200	1,420.00	85,484,000	
鈴木	4,200	1,076.00	4,519,200	
日本トリム	2,100	4,425.00	9,292,500	
ローランド ディー . ジー .	5,500	1,877.00	10,323,500	
フォスター電機	8,900	1,344.00	11,961,600	
S M K	2,500	3,025.00	7,562,500	
ヨコオ	5,400	2,929.00	15,816,600	
ホシデン	19,700	1,042.00	20,527,400	
ヒロセ電機	11,100	16,560.00	183,816,000	
日本航空電子工業	16,900	1,702.00	28,763,800	
T O A	10,800	893.00	9,644,400	
マクセルホールディングス	15,100	1,410.00	21,291,000	
古野電気	10,500	1,146.00	12,033,000	
ユニデンホールディングス	2,600	2,294.00	5,964,400	
スミダコーポレーション	7,500	1,007.00	7,552,500	
アイコム	3,500	2,774.00	9,709,000	
リオン	3,500	3,050.00	10,675,000	
船井電機	16,500	469.00	7,738,500	
横河電機	72,300	2,197.00	158,843,100	
新電元工業	3,400	3,010.00	10,234,000	
アズビル	48,500	4,990.00	242,015,000	
東亜ディーケーケー	5,800	826.00	4,790,800	



日本光電工業	30,000	3,140.00	94,200,000
共和電業	15,700	383.00	6,013,100
日本電子材料	3,100	1,774.00	5,499,400
堀場製作所	14,400	6,730.00	96,912,000
アドバンテスト	53,400	9,180.00	490,212,000
エスベック	7,000	1,877.00	13,139,000
キーエンス	70,800	58,140.00	4,116,312,000
日置電機	3,700	3,910.00	14,467,000
シスメックス	56,400	11,845.00	668,058,000
日本マイクロニクス	13,200	1,820.00	24,024,000
メガチップス	7,500	3,200.00	24,000,000
O B A R A G R O U P	4,400	3,930.00	17,292,000
コーセル	9,700	1,146.00	11,116,200
イリソ電子工業	6,300	5,110.00	32,193,000
オブテックスグループ	12,400	1,729.00	21,439,600
千代田インテグレ	4,500	1,793.00	8,068,500
レーザーテック	31,600	13,880.00	438,608,000
スタンレー電気	50,800	3,485.00	177,038,000
岩崎電気	4,100	1,520.00	6,232,000
ウシオ電機	38,000	1,359.00	51,642,000
日本セラミック	7,700	2,800.00	21,560,000
古河電池	5,600	1,654.00	9,262,400
山一電機	5,500	1,440.00	7,920,000
図研	5,000	2,908.00	14,540,000
日本電子	13,300	4,240.00	56,392,000
カシオ計算機	58,400	2,001.00	116,858,400
ファナック	63,300	29,050.00	1,838,865,000
日本シイエムケイ	20,300	415.00	8,424,500
エンプラス	3,500	4,700.00	16,450,000
大真空	3,000	2,461.00	7,383,000
ローム	29,900	11,230.00	335,777,000
浜松ホトニクス	51,500	6,910.00	355,865,000
三井ハイテック	7,200	4,150.00	29,880,000
新光電気工業	24,100	2,905.00	70,010,500
京セラ	109,800	6,996.00	768,160,800
太陽誘電	32,000	5,590.00	178,880,000

村田製作所	211,700	9,667.00	2,046,503,900	
双葉電子工業	14,200	981.00	13,930,200	
北陸電気工業	6,100	930.00	5,673,000	
ニチコン	23,100	1,154.00	26,657,400	
日本ケミコン	6,700	1,792.00	12,006,400	
K O A	10,500	1,518.00	15,939,000	
市光工業	12,100	749.00	9,062,900	
小糸製作所	43,000	7,840.00	337,120,000	
S C R E E Nホールディングス	12,600	8,820.00	111,132,000	
キヤノン電子	7,200	1,697.00	12,218,400	
キヤノン	358,500	2,339.00	838,531,500	
リコー	183,700	939.00	172,494,300	
象印マホービン	19,800	1,817.00	35,976,600	
東京エレクトロン	42,200	42,880.00	1,809,536,000	
トヨタ紡織	21,000	1,713.00	35,973,000	
ユニプレス	13,000	999.00	12,987,000	
豊田自動織機	58,300	9,310.00	542,773,000	
モリタホールディングス	12,100	1,801.00	21,792,100	
三櫻工業	11,100	1,002.00	11,122,200	
デンソー	158,500	6,728.00	1,066,388,000	
東海理化電機製作所	19,400	1,798.00	34,881,200	
川崎重工業	56,300	2,374.00	133,656,200	
日本車輛製造	3,400	2,529.00	8,598,600	
三菱ロジスネクスト	10,400	1,150.00	11,960,000	
日産自動車	851,300	595.40	506,864,020	
いすゞ自動車	208,400	1,124.00	234,241,600	
トヨタ自動車	730,800	8,093.00	5,914,364,400	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,900	1,010.00	91,809,000	
三菱自動車工業	269,500	301.00	81,119,500	
武蔵精密工業	16,800	1,911.00	32,104,800	
日産車体	11,000	806.00	8,866,000	
新明和工業	20,800	949.00	19,739,200	
極東開発工業	12,700	1,595.00	20,256,500	
トピー工業	7,600	1,475.00	11,210,000	
曙ブレーキ工業	47,800	160.00	7,648,000	

タチエス	11,900	1,150.00	13,685,000
N O K	35,800	1,433.00	51,301,400
フタバ産業	19,900	536.00	10,666,400
K Y B	8,300	2,954.00	24,518,200
大同メタル工業	21,000	560.00	11,760,000
プレス工業	39,600	334.00	13,226,400
太平洋工業	15,900	1,220.00	19,398,000
河西工業	16,400	419.00	6,871,600
アイシン精機	52,400	3,555.00	186,282,000
マツダ	226,800	866.00	196,408,800
今仙電機製作所	8,900	756.00	6,728,400
本田技研工業	567,200	3,052.00	1,731,094,400
スズキ	143,100	5,023.00	718,791,300
S U B A R U	207,100	2,028.50	420,102,350
安永	4,600	1,179.00	5,423,400
ヤマハ発動機	101,500	2,365.00	240,047,500
T B K	13,100	435.00	5,698,500
エクセディ	10,000	1,645.00	16,450,000
豊田合成	23,300	2,906.00	67,709,800
愛三工業	14,200	579.00	8,221,800
ヨロズ	8,000	1,341.00	10,728,000
エフ・シー・シー	12,100	1,710.00	20,691,000
シマノ	27,000	26,315.00	710,505,000
テイ・エス テック	16,700	3,065.00	51,185,500
ジャムコ	8,200	857.00	7,027,400
テルモ	220,900	4,541.00	1,003,106,900
日機装	23,500	1,079.00	25,356,500
日本エム・ディ・エム	4,600	2,049.00	9,425,400
島津製作所	92,300	4,315.00	398,274,500
J M S	7,300	1,041.00	7,599,300
長野計器	6,500	995.00	6,467,500
ブイ・テクノロジー	3,400	5,930.00	20,162,000
東京計器	6,400	950.00	6,080,000
インターアクション	3,800	2,459.00	9,344,200
東京精密	12,100	4,820.00	58,322,000
マニー	28,800	2,746.00	79,084,800

ニコン	110,900	921.00	102,138,900
トプコン	37,400	1,295.00	48,433,000
オリンパス	399,600	2,334.50	932,866,200
理研計器	6,300	2,935.00	18,490,500
タムロン	5,900	2,010.00	11,859,000
H O Y A	143,000	13,195.00	1,886,885,000
ノーリツ鋼機	6,800	2,465.00	16,762,000
エー・アンド・デイ	6,700	1,226.00	8,214,200
朝日インテック	76,000	3,490.00	265,240,000
シチズン時計	92,500	394.00	36,445,000
メニコン	11,100	6,910.00	76,701,000
松風	4,200	1,780.00	7,476,000
セイコーホールディングス	10,300	1,731.00	17,829,300
ニプロ	54,400	1,396.00	75,942,400
スノーピーク	5,300	2,867.00	15,195,100
パラマウントベッドホールディングス	6,900	4,580.00	31,602,000
トランザクション	5,100	1,147.00	5,849,700
ニホンフラッシュ	6,900	1,210.00	8,349,000
前田工織	7,700	2,926.00	22,530,200
永大産業	13,800	303.00	4,181,400
アートネイチャー	10,600	675.00	7,155,000
バンダイナムコホールディングス	59,600	8,876.00	529,009,600
S H O E I	6,200	4,225.00	26,195,000
フランスベッドホールディングス	11,700	969.00	11,337,300
パイロットコーポレーション	12,700	3,160.00	40,132,000
萩原工業	5,100	1,488.00	7,588,800
トッパン・フォームズ	13,100	1,060.00	13,886,000
フジシールインターナショナル	15,000	2,176.00	32,640,000
タカラトミー	32,100	994.00	31,907,400
廣済堂	7,800	896.00	6,988,800
プロネクサス	8,200	1,204.00	9,872,800
大建工業	5,500	1,984.00	10,912,000
凸版印刷	108,800	1,634.00	177,779,200
大日本印刷	86,800	1,898.00	164,746,400
共同印刷	2,600	3,145.00	8,177,000
N I S S H A	14,600	1,459.00	21,301,400

TAKARA & COMPANY	4,700	1,751.00	8,229,700	
アシックス	64,000	1,783.00	114,112,000	
ローランド	4,300	3,500.00	15,050,000	
ヤマハ	42,800	5,780.00	247,384,000	
河合楽器製作所	2,600	3,605.00	9,373,000	
ピジョン	46,400	4,210.00	195,344,000	
オリバー	2,000	2,551.00	5,102,000	
キングジム	8,400	886.00	7,442,400	
リンテック	15,400	2,390.00	36,806,000	
イトーキ	21,200	367.00	7,780,400	
任天堂	41,300	68,600.00	2,833,180,000	
三菱鉛筆	11,500	1,412.00	16,238,000	
タカラスタANDARD	14,300	1,575.00	22,522,500	
コクヨ	34,800	1,443.00	50,216,400	
ナカバヤシ	10,500	620.00	6,510,000	
グローブライド	3,500	4,040.00	14,140,000	
オカムラ	27,700	1,059.00	29,334,300	
美津濃	7,000	2,239.00	15,673,000	
東京電力ホールディングス	609,000	368.00	224,112,000	
中部電力	220,300	1,345.00	296,303,500	
関西電力	274,100	1,094.50	300,002,450	
中国電力	102,600	1,322.00	135,637,200	
北陸電力	68,000	689.00	46,852,000	
東北電力	167,400	956.00	160,034,400	
四国電力	60,800	775.00	47,120,000	
九州電力	156,900	947.00	148,584,300	
北海道電力	69,300	472.00	32,709,600	
沖縄電力	14,200	1,446.00	20,533,200	
電源開発	57,300	1,774.00	101,650,200	
エフオン	5,300	1,029.00	5,453,700	
イーレックス	11,000	1,715.00	18,865,000	
レノバ	12,300	3,360.00	41,328,000	
東京瓦斯	138,600	2,300.50	318,849,300	
大阪瓦斯	129,400	1,986.00	256,988,400	
東邦瓦斯	35,400	6,700.00	237,180,000	
北海道瓦斯	5,900	1,593.00	9,398,700	

広島ガス	22,700	380.00	8,626,000	
西部瓦斯	8,300	2,893.00	24,011,900	
静岡ガス	20,300	958.00	19,447,400	
メタウォーター	8,400	2,154.00	18,093,600	
SBSホールディングス	5,300	2,598.00	13,769,400	
東武鉄道	75,000	3,160.00	237,000,000	
相鉄ホールディングス	25,100	2,553.00	64,080,300	
東急	180,300	1,462.00	263,598,600	
京浜急行電鉄	92,400	1,841.00	170,108,400	
小田急電鉄	114,800	3,415.00	392,042,000	
京王電鉄	40,100	8,710.00	349,271,000	
京成電鉄	53,900	3,900.00	210,210,000	
富士急行	9,900	5,990.00	59,301,000	
新京成電鉄	3,300	2,260.00	7,458,000	
東日本旅客鉄道	127,000	7,635.00	969,645,000	
西日本旅客鉄道	64,200	6,359.00	408,247,800	
東海旅客鉄道	60,000	17,740.00	1,064,400,000	
西武ホールディングス	88,100	1,297.00	114,265,700	
鴻池運輸	11,500	1,096.00	12,604,000	
西日本鉄道	20,300	3,115.00	63,234,500	
ハマキョウレックス	5,700	3,220.00	18,354,000	
サカイ引越センター	3,300	4,920.00	16,236,000	
近鉄グループホールディングス	68,300	4,730.00	323,059,000	
阪急阪神ホールディングス	91,100	3,715.00	338,436,500	
南海電気鉄道	33,100	2,697.00	89,270,700	
京阪ホールディングス	30,200	5,120.00	154,624,000	
神戸電鉄	2,800	3,670.00	10,276,000	
名古屋鉄道	55,300	2,859.00	158,102,700	
山陽電気鉄道	6,300	2,014.00	12,688,200	
日本通運	23,500	7,850.00	184,475,000	
ヤマトホールディングス	95,700	2,846.00	272,362,200	
山九	17,500	4,455.00	77,962,500	
丸全昭和運輸	5,300	3,235.00	17,145,500	
センコーグループホールディングス	36,100	1,025.00	37,002,500	
トナミホールディングス	1,900	5,510.00	10,469,000	
ニッコンホールディングス	23,200	2,196.00	50,947,200	

福山通運	8,600	4,470.00	38,442,000	
セイノーホールディングス	51,000	1,559.00	79,509,000	
神奈川中央交通	2,400	3,830.00	9,192,000	
日立物流	14,800	3,315.00	49,062,000	
丸和運輸機関	14,000	2,164.00	30,296,000	
C & F ロジホールディングス	7,000	1,789.00	12,523,000	
九州旅客鉄道	53,000	2,638.00	139,814,000	
S Gホールディングス	128,900	2,644.00	340,811,600	
日本郵船	56,300	2,839.00	159,835,700	
商船三井	40,200	3,135.00	126,027,000	
川崎汽船	21,000	1,958.00	41,118,000	
N S ユナイテッド海運	4,500	1,559.00	7,015,500	
飯野海運	34,600	437.00	15,120,200	
乾汽船	6,500	927.00	6,025,500	
日本航空	166,300	2,373.00	394,629,900	
A N Aホールディングス	185,700	2,519.00	467,778,300	
ランコム	2,200	8,240.00	18,128,000	
日新	6,700	1,394.00	9,339,800	
三菱倉庫	23,900	3,375.00	80,662,500	
三井倉庫ホールディングス	7,500	2,230.00	16,725,000	
住友倉庫	23,600	1,466.00	34,597,600	
澁澤倉庫	4,500	2,262.00	10,179,000	
東陽倉庫	20,900	330.00	6,897,000	
日本トランスシティ	18,000	566.00	10,188,000	
川西倉庫	4,000	1,200.00	4,800,000	
安田倉庫	7,600	961.00	7,303,600	
東洋埠頭	4,900	1,442.00	7,065,800	
上組	37,000	2,050.00	75,850,000	
近鉄エクスプレス	12,700	2,720.00	34,544,000	
エーアイティー	6,800	1,069.00	7,269,200	
N E C ネットエスアイ	22,700	1,905.00	43,243,500	
システナ	25,100	1,945.00	48,819,500	
デジタルアーツ	4,200	10,360.00	43,512,000	
日鉄ソリューションズ	10,400	3,280.00	34,112,000	
キューブシステム	5,100	1,131.00	5,768,100	
コア	4,500	1,535.00	6,907,500	

ラクーンホールディングス	5,900	2,242.00	13,227,800
ソリトンシステムズ	4,300	1,837.00	7,899,100
ソフトクリエイティブホールディングス	3,200	2,612.00	8,358,400
T I S	70,500	2,295.00	161,797,500
電算システム	3,400	3,260.00	11,084,000
グリー	44,600	597.00	26,626,200
G M Oペパボ	700	6,300.00	4,410,000
コーエーテクモホールディングス	14,500	6,530.00	94,685,000
三菱総合研究所	3,100	4,155.00	12,880,500
ファインデックス	7,800	1,205.00	9,399,000
ブレインパッド	2,100	4,640.00	9,744,000
K L a b	14,300	849.00	12,140,700
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	10,500	1,180.00	12,390,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,350.00	3,525,000
ネクソン	178,800	3,530.00	631,164,000
アイスタイル	13,900	548.00	7,617,200
エムアップホールディングス	2,200	2,528.00	5,561,600
エイチーム	6,600	1,249.00	8,243,400
エニグモ	7,400	1,238.00	9,161,200
テクノスジャパン	8,900	705.00	6,274,500
コロプラ	24,000	936.00	22,464,000
ブロードリーフ	36,500	511.00	18,651,500
デジタルハーツホールディングス	4,600	1,462.00	6,725,200
システム情報	5,800	1,073.00	6,223,400
メディアドゥ	2,700	6,160.00	16,632,000
じげん	22,000	403.00	8,866,000
ブイキューブ	4,100	2,737.00	11,221,700
サイバーリンクス	2,700	2,018.00	5,448,600
フィックスターズ	9,500	999.00	9,490,500
C A R T A H O L D I N G S	4,500	1,570.00	7,065,000
オブティム	5,200	3,220.00	16,744,000
セレス	2,800	4,000.00	11,200,000
S H I F T	3,200	14,040.00	44,928,000
ティーガイア	7,300	1,887.00	13,775,100
テクマトリックス	11,400	1,772.00	20,200,800



ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,500	2,376.00	41,580,000	
GMOペイメントゲートウェイ	15,000	15,840.00	237,600,000	
システムリサーチ	3,000	1,884.00	5,652,000	
インターネットイニシアティブ	19,100	2,346.00	44,808,600	
さくらインターネット	10,300	674.00	6,942,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,600	8,840.00	14,144,000	
SRAホールディングス	4,700	2,585.00	12,149,500	
朝日ネット	7,500	832.00	6,240,000	
eBASE	9,300	902.00	8,388,600	
アバント	8,000	1,393.00	11,144,000	
アドソル日進	3,100	2,800.00	8,680,000	
フリービット	6,000	997.00	5,982,000	
コムチュア	6,400	2,949.00	18,873,600	
アステリア	6,400	929.00	5,945,600	
アイル	4,700	1,627.00	7,646,900	
マークラインズ	3,700	2,450.00	9,065,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,300	2,172.00	18,027,600	
gumi	11,200	967.00	10,830,400	
テラスカイ	2,600	3,700.00	9,620,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,615.00	7,106,000	
PCIホールディングス	4,000	1,307.00	5,228,000	
ネオジャパン	2,100	1,794.00	3,767,400	
PR TIMES	1,700	3,645.00	6,196,500	
ダブルスタンダード	1,400	4,115.00	5,761,000	
オープンドア	4,900	2,429.00	11,902,100	
アカツキ	2,900	4,235.00	12,281,500	
Ubicomホールディングス	2,100	3,155.00	6,625,500	
カナミックネットワーク	8,500	793.00	6,740,500	
チェンジ	10,000	3,595.00	35,950,000	
オークネット	5,300	1,355.00	7,181,500	
エイトレッド	2,000	2,414.00	4,828,000	
マクロミル	16,900	898.00	15,176,200	
オロ	2,500	3,960.00	9,900,000	
ユーザーローカル	1,300	4,485.00	5,830,500	
プロトコーポレーション	8,000	1,179.00	9,432,000	

野村総合研究所	129,000	3,655.00	471,495,000
サイバネットシステム	6,700	864.00	5,788,800
インテージホールディングス	10,200	1,212.00	12,362,400
ソースネクスト	38,400	321.00	12,326,400
インフォコム	6,500	2,866.00	18,629,000
HEROZ	2,300	3,375.00	7,762,500
ラクスル	6,000	3,860.00	23,160,000
I P S	1,600	2,895.00	4,632,000
イーソル	5,100	1,423.00	7,257,300
アルテリア・ネットワークス	8,400	1,569.00	13,179,600
E d u L a b	900	7,470.00	6,723,000
ギフトィ	3,600	4,690.00	16,884,000
ベース	800	5,110.00	4,088,000
フォーカスシステムズ	6,900	938.00	6,472,200
クレスコ	6,300	1,385.00	8,725,500
フジ・メディア・ホールディングス	73,200	1,308.00	95,745,600
オービック	22,200	19,630.00	435,786,000
ジャストシステム	10,000	7,120.00	71,200,000
T D C ソフト	7,700	955.00	7,353,500
Zホールディングス	973,700	639.10	622,291,670
トレンドマイクロ	37,900	5,850.00	221,715,000
日本オラクル	14,300	12,370.00	176,891,000
アルファシステムズ	2,200	3,765.00	8,283,000
フューチャー	8,800	1,899.00	16,711,200
C A C H o l d i n g s	6,100	1,453.00	8,863,300
S B テクノロジー	2,800	3,005.00	8,414,000
オービックビジネスコンサルタント	7,100	6,520.00	46,292,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,800	3,535.00	112,413,000
アイティフォー	11,200	866.00	9,699,200
大塚商会	38,100	5,300.00	201,930,000
サイボウズ	8,500	2,601.00	22,108,500
電通国際情報サービス	8,800	3,695.00	32,516,000
A C C E S S	9,900	802.00	7,939,800
デジタルガレージ	12,000	4,335.00	52,020,000
E M システムズ	13,100	869.00	11,383,900
ウェザーニューズ	2,400	5,140.00	12,336,000

C I J	6,500	884.00	5,746,000
WOWOW	3,500	2,861.00	10,013,500
スカラ	8,600	717.00	6,166,200
ネットワンシステムズ	29,100	3,365.00	97,921,500
アルゴグラフィックス	5,500	3,030.00	16,665,000
マーベラス	12,800	942.00	12,057,600
エイベックス	12,800	1,488.00	19,046,400
日本ユニシス	24,700	3,345.00	82,621,500
兼松エレクトロニクス	3,800	3,645.00	13,851,000
都築電気	3,300	1,534.00	5,062,200
T B S ホールディングス	47,100	2,012.00	94,765,200
日本テレビホールディングス	58,900	1,403.00	82,636,700
朝日放送グループホールディングス	11,000	722.00	7,942,000
テレビ朝日ホールディングス	22,200	2,203.00	48,906,600
スカパーJ S A Tホールディングス	48,200	460.00	22,172,000
テレビ東京ホールディングス	5,400	2,481.00	13,397,400
ビジョン	10,100	950.00	9,595,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	3,100	1,973.00	6,116,300
コネクシオ	4,500	1,394.00	6,273,000
日本電信電話	827,200	2,848.50	2,356,279,200
K D D I	567,000	3,362.00	1,906,254,000
ソフトバンク	642,500	1,442.50	926,806,250
光通信	8,300	21,390.00	177,537,000
エムティーアイ	9,500	844.00	8,018,000
G M O インターネット	25,700	3,510.00	90,207,000
ファイバーゲート	2,800	2,242.00	6,277,600
K A D O K A W A	19,200	3,970.00	76,224,000
学研ホールディングス	9,600	1,616.00	15,513,600
ゼンリン	13,900	1,325.00	18,417,500
アイネット	5,000	1,506.00	7,530,000
松竹	4,700	15,350.00	72,145,000
東宝	41,700	4,225.00	176,182,500
東映	2,300	21,420.00	49,266,000
エヌ・ティ・ティ・データ	187,500	1,648.00	309,000,000
ピー・シー・エー	1,400	4,245.00	5,943,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,200	1,736.00	5,555,200

D T S	14,100	2,444.00	34,460,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,200	6,690.00	202,038,000
シーイーシー	8,500	1,498.00	12,733,000
カプコン	30,300	6,750.00	204,525,000
アイ・エス・ビー	4,200	1,260.00	5,292,000
ジャステック	5,800	1,251.00	7,255,800
S C S K	16,400	6,690.00	109,716,000
日本システムウエア	3,000	2,056.00	6,168,000
アイネス	8,500	1,388.00	11,798,000
T K C	5,800	6,700.00	38,860,000
富士ソフト	7,500	5,600.00	42,000,000
N S D	22,700	1,922.00	43,629,400
コナミホールディングス	25,700	7,350.00	188,895,000
福井コンピュータホールディングス	3,600	3,725.00	13,410,000
J B C Cホールディングス	6,000	1,469.00	8,814,000
ミロク情報サービス	7,500	2,277.00	17,077,500
ソフトバンクグループ	561,600	10,340.00	5,806,944,000
伊藤忠食品	2,000	5,270.00	10,540,000
エレマテック	7,500	1,003.00	7,522,500
あらた	5,500	4,670.00	25,685,000
東京エレクトロン デバイス	2,700	3,785.00	10,219,500
フィールズ	9,400	545.00	5,123,000
双日	387,800	275.00	106,645,000
アルフレッサ ホールディングス	73,300	2,186.00	160,233,800
横浜冷凍	20,400	898.00	18,319,200
アルコニックス	8,000	1,660.00	13,280,000
神戸物産	48,800	2,960.00	144,448,000
あい ホールディングス	10,800	2,061.00	22,258,800
ダイワボウホールディングス	6,400	8,320.00	53,248,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,900	2,074.00	35,050,600
ラクト・ジャパン	3,500	2,657.00	9,299,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,400	802.00	11,548,800
八洲電機	8,800	950.00	8,360,000
レスターホールディングス	7,700	2,055.00	15,823,500
ジュテックホールディングス	3,200	1,060.00	3,392,000
T O K A Iホールディングス	32,800	958.00	31,422,400

三洋貿易	8,900	1,086.00	9,665,400
ウイン・パートナーズ	5,900	1,129.00	6,661,100
シップヘルスケアホールディングス	12,500	5,920.00	74,000,000
コメダホールディングス	15,200	1,944.00	29,548,800
アセンテック	2,400	1,797.00	4,312,800
小野建	7,400	1,323.00	9,790,200
佐鳥電機	7,800	802.00	6,255,600
伯東	5,700	1,313.00	7,484,100
コンドーテック	7,100	1,057.00	7,504,700
ナガイレーベン	9,700	2,841.00	27,557,700
三菱食品	7,000	3,005.00	21,035,000
松田産業	5,900	1,883.00	11,109,700
第一興商	11,100	4,120.00	45,732,000
メディパルホールディングス	70,300	2,225.00	156,417,500
S P K	5,500	1,272.00	6,996,000
萩原電気ホールディングス	3,400	2,559.00	8,700,600
アズワン	5,100	14,830.00	75,633,000
尾家産業	4,000	1,393.00	5,572,000
シモジマ	6,000	1,382.00	8,292,000
ドウシシャ	6,800	1,835.00	12,478,000
高速	5,000	1,537.00	7,685,000
丸文	10,900	523.00	5,700,700
ハピネット	6,900	1,537.00	10,605,300
日本ライフライン	22,900	1,361.00	31,166,900
タカショー	7,500	788.00	5,910,000
マルカ	3,600	2,000.00	7,200,000
I D O M	25,700	645.00	16,576,500
進和	5,200	2,156.00	11,211,200
ダイトロン	4,100	1,551.00	6,359,100
シークス	9,800	1,763.00	17,277,400
オーハシテクニカ	5,300	1,474.00	7,812,200
伊藤忠商事	496,700	3,182.00	1,580,499,400
丸紅	700,500	777.40	544,568,700
長瀬産業	39,800	1,758.00	69,968,400
蝶理	5,600	1,574.00	8,814,400
豊田通商	71,400	4,595.00	328,083,000

三共生興	16,400	495.00	8,118,000
兼松	27,700	1,387.00	38,419,900
三井物産	575,700	2,158.50	1,242,648,450
日本紙パルプ商事	3,900	3,645.00	14,215,500
カメイ	9,700	1,239.00	12,018,300
スターゼン	2,900	4,265.00	12,368,500
山善	26,700	1,014.00	27,073,800
椿本興業	1,800	3,755.00	6,759,000
住友商事	448,800	1,529.00	686,215,200
内田洋行	3,000	4,505.00	13,515,000
三菱商事	432,200	2,977.00	1,286,659,400
第一実業	3,400	4,115.00	13,991,000
キヤノンマーケティングジャパン	17,800	2,443.00	43,485,400
西華産業	5,600	1,406.00	7,873,600
佐藤商事	7,900	1,004.00	7,931,600
菱洋エレクトロ	5,500	2,831.00	15,570,500
東京産業	10,100	652.00	6,585,200
ユアサ商事	7,200	3,125.00	22,500,000
阪和興業	14,000	2,790.00	39,060,000
正栄食品工業	4,600	3,855.00	17,733,000
カナデン	7,200	1,266.00	9,115,200
菱電商事	6,400	1,608.00	10,291,200
フルサト工業	5,500	1,318.00	7,249,000
岩谷産業	17,100	6,310.00	107,901,000
極東貿易	3,700	1,409.00	5,213,300
イワキ	10,800	620.00	6,696,000
三愛石油	17,600	1,079.00	18,990,400
稲畑産業	16,500	1,515.00	24,997,500
G S Iクレオス	2,800	2,620.00	7,336,000
ヤマエ久野	6,800	1,063.00	7,228,400
ワキタ	14,400	1,021.00	14,702,400
東邦ホールディングス	23,100	1,992.00	46,015,200
サンゲツ	18,800	1,611.00	30,286,800
ミツウロコグループホールディングス	10,600	1,245.00	13,197,000
シナネンホールディングス	3,100	3,270.00	10,137,000
伊藤忠エネクス	14,700	1,045.00	15,361,500

サンリオ	19,600	1,745.00	34,202,000
サンワテクノス	6,000	1,045.00	6,270,000
リョーサン	8,200	2,262.00	18,548,400
新光商事	12,800	779.00	9,971,200
トーホー	4,700	1,839.00	8,643,300
三信電気	4,800	2,068.00	9,926,400
東陽テクニカ	9,200	1,126.00	10,359,200
モスフードサービス	10,300	3,125.00	32,187,500
加賀電子	6,700	2,403.00	16,100,100
ソーダニッカ	12,000	539.00	6,468,000
立花エレテック	6,100	1,579.00	9,631,900
PALTA C	11,400	5,660.00	64,524,000
三谷産業	12,400	428.00	5,307,200
太平洋興発	9,700	662.00	6,421,400
西本Wismettacホールディングス	2,300	2,900.00	6,670,000
国際紙パルプ商事	24,700	244.00	6,026,800
ヤマタネ	5,700	1,421.00	8,099,700
日鉄物産	4,600	3,880.00	17,848,000
泉州電業	2,500	3,520.00	8,800,000
トラスコ中山	16,000	2,668.00	42,688,000
オートボックスセブン	27,800	1,406.00	39,086,800
モリト	10,000	611.00	6,110,000
加藤産業	9,600	3,820.00	36,672,000
イノテック	5,500	1,221.00	6,715,500
イエローハット	13,400	1,727.00	23,141,800
J Kホールディングス	8,100	812.00	6,577,200
日伝	6,100	2,230.00	13,603,000
杉本商事	4,100	2,411.00	9,885,100
因幡電機産業	18,300	2,550.00	46,665,000
東テク	2,900	2,817.00	8,169,300
ミスミグループ本社	88,900	3,525.00	313,372,500
タキヒヨー	4,100	1,992.00	8,167,200
スズケン	30,100	4,330.00	130,333,000
ジェコス	6,700	965.00	6,465,500
ローソン	18,100	5,220.00	94,482,000
サンエー	5,200	4,330.00	22,516,000

カワチ薬品	5,000	2,980.00	14,900,000
エービーシー・マート	11,100	6,310.00	70,041,000
アスクル	6,400	3,675.00	23,520,000
ゲオホールディングス	9,800	1,195.00	11,711,000
アダストリア	10,200	2,077.00	21,185,400
くら寿司	4,300	7,490.00	32,207,000
キャンドウ	4,900	1,892.00	9,270,800
パルグループホールディングス	7,300	1,619.00	11,818,700
エディオン	28,800	1,069.00	30,787,200
サーラコーポレーション	16,100	587.00	9,450,700
ハローズ	3,000	3,025.00	9,075,000
フジオフードグループ本社	7,900	1,326.00	10,475,400
あみやき亭	2,700	2,941.00	7,940,700
大黒天物産	1,900	6,110.00	11,609,000
ハニーズホールディングス	6,800	1,011.00	6,874,800
アルペン	5,800	2,319.00	13,450,200
クオールホールディングス	10,700	1,451.00	15,525,700
ジinzホールディングス	4,000	7,390.00	29,560,000
ビックカメラ	42,300	1,186.00	50,167,800
D C Mホールディングス	43,700	1,117.00	48,812,900
Monotaro	50,600	6,680.00	338,008,000
アークランドサービスホールディングス	6,500	2,154.00	14,001,000
J . フロント リテイリング	86,500	1,016.00	87,884,000
ドトール・日レスホールディングス	11,600	1,687.00	19,569,200
マツモトキヨシホールディングス	29,300	4,395.00	128,773,500
broncoピリー	5,000	2,295.00	11,475,000
Z O Z O	42,200	3,630.00	153,186,000
物語コーポレーション	2,000	11,880.00	23,760,000
ココカラファイン	6,300	7,410.00	46,683,000
三越伊勢丹ホールディングス	125,600	743.00	93,320,800
H a m e e	2,300	1,701.00	3,912,300
ウエルシアホールディングス	37,500	3,520.00	132,000,000
クリエイトSDホールディングス	10,300	3,420.00	35,226,000
シュッピン	6,800	1,053.00	7,160,400
オイシックス・ラ・大地	7,200	2,977.00	21,434,400
ネクステージ	12,300	1,739.00	21,389,700



ジョイフル本田	20,600	1,450.00	29,870,000
ホットランド	8,000	1,207.00	9,656,000
すかいらーくホールディングス	80,500	1,633.00	131,456,500
SFPホールディングス	5,300	1,463.00	7,753,900
綿半ホールディングス	6,600	1,262.00	8,329,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,100	1,150.00	23,115,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,234.00	7,157,200
B E E N O S	3,800	2,690.00	10,222,000
あさひ	5,600	1,555.00	8,708,000
日本調剤	5,500	1,634.00	8,987,000
コスモス薬品	7,200	15,820.00	113,904,000
セブン&アイ・ホールディングス	278,000	4,240.00	1,178,720,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	39,500	850.00	33,575,000
ツルハホールディングス	15,400	14,290.00	220,066,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,603.00	11,701,900
トリドールホールディングス	18,100	1,490.00	26,969,000
J Mホールディングス	6,100	2,028.00	12,370,800
アレンザホールディングス	5,400	1,426.00	7,700,400
パロックジャパンリミテッド	8,000	818.00	6,544,000
クスリのアオキホールディングス	7,200	8,740.00	62,928,000
スシローグローバルホールディングス	39,100	4,230.00	165,393,000
メディカルシステムネットワーク	8,300	687.00	5,702,100
ノジマ	12,600	2,916.00	36,741,600
カッパ・クリエイト	11,300	1,504.00	16,995,200
良品計画	94,700	2,590.00	245,273,000
アドヴァン	8,300	1,100.00	9,130,000
アルビス	3,000	2,482.00	7,446,000
コナカ	18,700	339.00	6,339,300
G - 7ホールディングス	4,600	2,349.00	10,805,400
イオン北海道	11,100	1,064.00	11,810,400
コジマ	14,000	653.00	9,142,000
コーナン商事	10,000	2,995.00	29,950,000
エコス	3,400	1,992.00	6,772,800
ワタミ	11,400	1,015.00	11,571,000

パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	141,700	2,587.00	366,577,900
西松屋チェーン	15,900	1,515.00	24,088,500
ゼンショーホールディングス	38,600	2,870.00	110,782,000
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,735.00	10,583,500
サイゼリヤ	11,400	2,194.00	25,011,600
V Tホールディングス	29,100	413.00	12,018,300
フジ・コーポレーション	3,000	2,236.00	6,708,000
ユナイテッドアローズ	9,000	2,009.00	18,081,000
ハイデイ日高	10,400	1,831.00	19,042,400
コロワイド	18,900	1,942.00	36,703,800
ピーシーデポコーポレーション	11,400	542.00	6,178,800
壱番屋	5,100	5,060.00	25,806,000
スギホールディングス	14,300	7,370.00	105,391,000
薬王堂ホールディングス	3,500	2,743.00	9,600,500
スクロール	11,000	1,305.00	14,355,000
ヨンドシーホールディングス	7,200	2,014.00	14,500,800
木曽路	9,700	2,432.00	23,590,400
S R S ホールディングス	12,000	868.00	10,416,000
千趣会	19,800	359.00	7,108,200
リテールパートナーズ	9,200	1,412.00	12,990,400
ケーヨー	16,300	750.00	12,225,000
上新電機	8,200	3,195.00	26,199,000
日本瓦斯	11,800	4,985.00	58,823,000
ロイヤルホールディングス	9,200	1,894.00	17,424,800
いなげや	8,000	1,683.00	13,464,000
チヨダ	11,100	996.00	11,055,600
ライフコーポレーション	5,400	3,330.00	17,982,000
リンガーハット	9,800	2,463.00	24,137,400
Mr M a x H D	11,600	749.00	8,688,400
A O K Iホールディングス	17,900	630.00	11,277,000
オークワ	11,600	1,213.00	14,070,800
コメリ	11,000	2,899.00	31,889,000
青山商事	20,400	797.00	16,258,800
しまむら	8,200	11,700.00	95,940,000
高島屋	53,500	1,063.00	56,870,500

松屋	17,400	968.00	16,843,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,300	846.00	29,017,800	
近鉄百貨店	3,200	3,420.00	10,944,000	
丸井グループ	60,900	2,015.00	122,713,500	
アクシアル リテイリング	5,800	4,875.00	28,275,000	
イオン	273,300	3,546.00	969,121,800	
イズミ	14,700	3,930.00	57,771,000	
平和堂	12,700	2,122.00	26,949,400	
フジ	8,700	2,046.00	17,800,200	
ヤオコー	8,100	6,730.00	54,513,000	
ゼビオホールディングス	10,400	951.00	9,890,400	
ケーズホールディングス	63,000	1,519.00	95,697,000	
日産東京販売ホールディングス	20,900	260.00	5,434,000	
Genky DrugStores	3,200	3,720.00	11,904,000	
ブックオフグループホールディングス	6,100	875.00	5,337,500	
アインホールディングス	10,500	7,230.00	75,915,000	
元気寿司	2,900	2,498.00	7,244,200	
ヤマダホールディングス	236,800	546.00	129,292,800	
アークランドサカモト	11,400	1,602.00	18,262,800	
ニトリホールディングス	28,200	21,355.00	602,211,000	
グルメ杵屋	8,200	995.00	8,159,000	
吉野家ホールディングス	24,400	2,211.00	53,948,400	
松屋フーズホールディングス	3,600	3,660.00	13,176,000	
サガミホールディングス	12,900	1,190.00	15,351,000	
関西スーパーマーケット	6,600	1,160.00	7,656,000	
王将フードサービス	4,700	5,850.00	27,495,000	
プレナス	8,300	1,918.00	15,919,400	
ミニストップ	6,900	1,446.00	9,977,400	
アークス	13,300	2,401.00	31,933,300	
バローホールディングス	14,100	2,359.00	33,261,900	
ベルク	3,600	5,750.00	20,700,000	
ファーストリテイリング	9,500	107,350.00	1,019,825,000	
サンドラッグ	26,700	4,060.00	108,402,000	
ペルーナ	15,800	1,016.00	16,052,800	
じもとホールディングス	5,600	813.00	4,552,800	
めぶきフィナンシャルグループ	366,400	231.00	84,638,400	

東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,400	1,247.00	11,721,800
九州フィナンシャルグループ	142,600	448.00	63,884,800
ゆうちょ銀行	200,300	1,022.00	204,706,600
富山第一銀行	18,800	294.00	5,527,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	432,200	421.00	181,956,200
西日本フィナンシャルホールディングス	47,900	710.00	34,009,000
関西みらいフィナンシャルグループ	33,000	606.00	19,998,000
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,369.00	9,172,300
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,358.00	27,117,000
ひろぎんホールディングス	104,600	647.00	67,676,200
新生銀行	58,000	1,449.00	84,042,000
あおぞら銀行	42,300	2,300.00	97,290,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,864,900	553.50	2,692,722,150
りそなホールディングス	769,500	433.30	333,424,350
三井住友トラスト・ホールディングス	134,200	3,522.00	472,652,400
三井住友フィナンシャルグループ	492,200	3,733.00	1,837,382,600
千葉銀行	236,600	693.00	163,963,800
群馬銀行	145,900	340.00	49,606,000
武蔵野銀行	11,500	1,646.00	18,929,000
千葉興業銀行	20,200	260.00	5,252,000
筑波銀行	30,600	190.00	5,814,000
七十七銀行	22,300	1,428.00	31,844,400
青森銀行	5,600	2,505.00	14,028,000
秋田銀行	4,800	1,438.00	6,902,400
山形銀行	9,200	1,104.00	10,156,800
岩手銀行	4,800	2,151.00	10,324,800
東邦銀行	72,000	213.00	15,336,000
東北銀行	4,000	1,080.00	4,320,000
みちのく銀行	4,500	1,071.00	4,819,500
ふくおかフィナンシャルグループ	64,200	2,027.00	130,133,400
静岡銀行	169,700	805.00	136,608,500
十六銀行	8,900	2,008.00	17,871,200
スルガ銀行	64,200	348.00	22,341,600
八十二銀行	154,500	364.00	56,238,000
山梨中央銀行	10,100	901.00	9,100,100
大垣共立銀行	14,200	2,084.00	29,592,800

福井銀行	6,200	1,937.00	12,009,400	
北國銀行	7,100	2,791.00	19,816,100	
清水銀行	3,000	1,654.00	4,962,000	
富山銀行	1,500	2,878.00	4,317,000	
滋賀銀行	14,100	2,035.00	28,693,500	
南都銀行	10,400	1,829.00	19,021,600	
百五銀行	66,300	313.00	20,751,900	
京都銀行	25,500	6,530.00	166,515,000	
紀陽銀行	25,100	1,457.00	36,570,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	47,200	971.00	45,831,200	
山陰合同銀行	46,400	501.00	23,246,400	
中国銀行	61,200	873.00	53,427,600	
伊予銀行	92,600	640.00	59,264,000	
百十四銀行	8,500	1,596.00	13,566,000	
四国銀行	9,800	736.00	7,212,800	
阿波銀行	11,000	2,280.00	25,080,000	
大分銀行	4,900	2,133.00	10,451,700	
宮崎銀行	4,900	2,294.00	11,240,600	
佐賀銀行	4,500	1,403.00	6,313,500	
沖縄銀行	6,700	2,832.00	18,974,400	
琉球銀行	15,300	786.00	12,025,800	
セブン銀行	238,400	243.00	57,931,200	
みずほフィナンシャルグループ	966,100	1,570.00	1,516,777,000	
山口フィナンシャルグループ	89,000	659.00	58,651,000	
名古屋銀行	6,100	2,847.00	17,366,700	
北洋銀行	113,200	235.00	26,602,000	
愛知銀行	2,900	2,986.00	8,659,400	
中京銀行	3,000	1,836.00	5,508,000	
愛媛銀行	11,500	1,017.00	11,695,500	
京葉銀行	32,400	432.00	13,996,800	
栃木銀行	44,500	180.00	8,010,000	
北日本銀行	2,700	1,933.00	5,219,100	
東和銀行	14,600	699.00	10,205,400	
トモニホールディングス	57,600	313.00	18,028,800	
フィデアホールディングス	75,000	122.00	9,150,000	
池田泉州ホールディングス	82,400	165.00	13,596,000	

F P G	22,000	614.00	13,508,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	4,500	1,292.00	5,814,000	
S B Iホールディングス	87,000	3,125.00	271,875,000	
ジャフコ グループ	11,200	6,910.00	77,392,000	
大和証券グループ本社	531,100	534.30	283,766,730	
野村ホールディングス	1,085,400	630.40	684,236,160	
岡三証券グループ	62,600	408.00	25,540,800	
丸三証券	22,100	607.00	13,414,700	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,300	378.00	28,841,400	
水戸証券	24,200	298.00	7,211,600	
いちよし証券	16,300	603.00	9,828,900	
松井証券	36,200	905.00	32,761,000	
マネックスグループ	65,000	995.00	64,675,000	
極東証券	10,900	810.00	8,829,000	
岩井コスモホールディングス	7,500	1,541.00	11,557,500	
藍澤證券	13,900	864.00	12,009,600	
スパークス・グループ	33,800	317.00	10,714,600	
かんぽ生命保険	88,600	2,169.00	192,173,400	
S O M P Oホールディングス	125,100	4,190.00	524,169,000	
アニコム ホールディングス	22,200	1,114.00	24,730,800	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	171,900	3,117.00	535,812,300	
第一生命ホールディングス	375,100	1,890.50	709,126,550	
東京海上ホールディングス	235,900	5,400.00	1,273,860,000	
T & Dホールディングス	212,100	1,442.00	305,848,200	
アドバンスクリエイト	2,000	1,826.00	3,652,000	
全国保証	18,500	5,270.00	97,495,000	
日本モーゲージサービス	4,200	1,127.00	4,733,400	
アルヒ	11,500	1,582.00	18,193,000	
プレミアグループ	3,900	2,340.00	9,126,000	
クレディセゾン	41,800	1,336.00	55,844,800	
芙蓉総合リース	7,400	7,250.00	53,650,000	
みずほリース	11,100	3,365.00	37,351,500	
東京センチュリー	16,400	7,580.00	124,312,000	
日本証券金融	28,700	600.00	17,220,000	
アイフル	123,900	277.00	34,320,300	

リコーリース	6,100	3,305.00	20,160,500
イオンフィナンシャルサービス	43,600	1,410.00	61,476,000
アコム	142,500	468.00	66,690,000
ジャックス	8,500	2,090.00	17,765,000
オリエントコーポレーション	199,800	149.00	29,770,200
日立キャピタル	16,800	2,877.00	48,333,600
オリックス	441,200	1,802.00	795,042,400
三菱UFJリース	159,300	571.00	90,960,300
日本取引所グループ	192,100	2,440.00	468,724,000
イー・ギャランティ	8,800	2,186.00	19,236,800
NECキャピタルソリューション	3,500	2,005.00	7,017,500
いちご	83,300	328.00	27,322,400
日本駐車場開発	89,800	141.00	12,661,800
スター・マイカ・ホールディングス	5,200	1,182.00	6,146,400
SREホールディングス	1,000	5,080.00	5,080,000
ヒューリック	150,800	1,204.00	181,563,200
三栄建築設計	3,500	1,800.00	6,300,000
野村不動産ホールディングス	43,200	2,432.00	105,062,400
三重交通グループホールディングス	18,800	496.00	9,324,800
サムティ	10,300	1,751.00	18,035,300
ディア・ライフ	16,100	417.00	6,713,700
日本商業開発	6,500	1,658.00	10,777,000
プレサンスコーポレーション	12,000	1,523.00	18,276,000
日本管理センター	5,600	1,207.00	6,759,200
フージャースホールディングス	13,600	683.00	9,288,800
オープンハウス	22,400	4,045.00	90,608,000
東急不動産ホールディングス	193,300	676.00	130,670,800
飯田グループホールディングス	58,800	2,386.00	140,296,800
ハウスドゥ	4,800	1,137.00	5,457,600
ケイアイスター不動産	2,500	3,610.00	9,025,000
グッドコムアセット	3,900	1,400.00	5,460,000
ジェイ・エス・ピー	1,700	3,335.00	5,669,500
パーク24	38,700	2,292.00	88,700,400
パラカ	4,600	1,623.00	7,465,800
三井不動産	324,300	2,400.00	778,320,000
三菱地所	467,100	1,863.00	870,207,300

平和不動産	12,100	3,585.00	43,378,500
東京建物	70,900	1,528.00	108,335,200
ダイビル	19,100	1,268.00	24,218,800
京阪神ビルディング	12,900	1,531.00	19,749,900
住友不動産	160,100	3,583.00	573,638,300
テーオーシー	16,500	805.00	13,282,500
東京楽天地	1,800	4,335.00	7,803,000
スターツコーポレーション	8,000	2,905.00	23,240,000
フジ住宅	11,800	666.00	7,858,800
空港施設	13,100	517.00	6,772,700
ゴールドクレスト	7,400	1,719.00	12,720,600
日本エスコン	13,600	765.00	10,404,000
タカラレーベン	35,000	341.00	11,935,000
A V A N T I A	7,800	875.00	6,825,000
イオンモール	35,900	1,870.00	67,133,000
カチタス	17,700	3,170.00	56,109,000
トーセイ	11,500	1,011.00	11,626,500
サンフロンティア不動産	11,200	918.00	10,281,600
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	1,146.00	8,709,600
ランドビジネス	13,800	362.00	4,995,600
日本空港ビルデング	23,000	5,080.00	116,840,000
日本工営	4,700	2,842.00	13,357,400
L I F U L L	29,900	426.00	12,737,400
ミクシィ	13,300	2,741.00	36,455,300
ジェイエシーリクルートメント	5,500	1,700.00	9,350,000
日本M&Aセンター	56,700	6,180.00	350,406,000
メンバーズ	2,600	2,682.00	6,973,200
UTグループ	10,200	3,165.00	32,283,000
アイティメディア	2,900	1,991.00	5,773,900
タケエイ	9,100	1,273.00	11,584,300
ビーネックスグループ	10,100	1,345.00	13,584,500
コシダカホールディングス	19,800	564.00	11,167,200
パソナグループ	7,900	1,929.00	15,239,100
リンクアンドモチベーション	15,200	537.00	8,162,400
G C A	13,300	791.00	10,520,300
エス・エム・エス	24,000	3,635.00	87,240,000



パーソルホールディングス	69,500	2,199.00	152,830,500	
リニカル	6,600	762.00	5,029,200	
クックパッド	29,600	310.00	9,176,000	
スタジオアリス	4,600	2,045.00	9,407,000	
シミックホールディングス	5,100	1,724.00	8,792,400	
総合警備保障	27,400	4,990.00	136,726,000	
カカクコム	51,400	3,610.00	185,554,000	
アイロムグループ	3,300	1,927.00	6,359,100	
セントケア・ホールディング	6,400	918.00	5,875,200	
ルネサンス	7,400	1,206.00	8,924,400	
ディップ	11,100	3,100.00	34,410,000	
デジタルホールディングス	5,800	2,011.00	11,663,800	
新日本科学	11,100	661.00	7,337,100	
ベネフィット・ワン	25,500	2,943.00	75,046,500	
エムスリー	121,600	8,886.00	1,080,537,600	
アウトソーシング	40,200	1,491.00	59,938,200	
ウェルネット	14,600	510.00	7,446,000	
ワールドホールディングス	2,900	2,351.00	6,817,900	
ディー・エヌ・エー	29,900	2,208.00	66,019,200	
博報堂D Yホールディングス	96,100	1,800.00	172,980,000	
ぐるなび	15,600	636.00	9,921,600	
タカミヤ	12,900	527.00	6,798,300	
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	917.00	7,060,900	
ファンコミュニケーションズ	23,800	402.00	9,567,600	
ライク	2,700	1,933.00	5,219,100	
エスプール	18,300	1,059.00	19,379,700	
WDBホールディングス	3,700	2,718.00	10,056,600	
手間いらず	900	5,140.00	4,626,000	
アドウェイズ	9,900	896.00	8,870,400	
バリューコマース	4,800	3,155.00	15,144,000	
インフォマート	71,500	997.00	71,285,500	
J Pホールディングス	27,700	290.00	8,033,000	
E P Sホールディングス	10,700	1,210.00	12,947,000	
プレステージ・インターナショナル	26,500	783.00	20,749,500	
アミューズ	4,600	2,493.00	11,467,800	
ドリームインキュベータ	4,300	1,192.00	5,125,600	

クイック	6,300	1,222.00	7,698,600
電通グループ	77,700	3,640.00	282,828,000
イオンファンタジー	3,400	2,498.00	8,493,200
シーティーエス	8,900	913.00	8,125,700
H . U . グループホールディングス	19,900	3,255.00	64,774,500
アルプス技研	6,800	2,028.00	13,790,400
日本空調サービス	11,200	734.00	8,220,800
オリエンタルランド	73,300	18,355.00	1,345,421,500
ダスキン	16,400	2,830.00	46,412,000
明光ネットワークジャパン	13,600	573.00	7,792,800
ファルコホールディングス	4,600	1,640.00	7,544,000
ラウンドワン	24,600	1,127.00	27,724,200
リゾートトラスト	32,900	1,750.00	57,575,000
ビー・エム・エル	8,900	3,710.00	33,019,000
りらいあコミュニケーションズ	10,800	1,405.00	15,174,000
リソー教育	40,400	344.00	13,897,600
ユー・エス・エス	77,400	2,094.00	162,075,600
東京個別指導学院	9,400	676.00	6,354,400
サイバーエージェント	42,600	6,830.00	290,958,000
楽天	322,000	1,130.00	363,860,000
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,297.00	6,485,000
モーニングスター	13,700	481.00	6,589,700
山田コンサルティンググループ	5,800	1,002.00	5,811,600
セントラルスポーツ	4,100	2,411.00	9,885,100
フルキャストホールディングス	7,000	1,883.00	13,181,000
エン・ジャパン	12,600	3,320.00	41,832,000
テクノプロ・ホールディングス	14,000	8,110.00	113,540,000
アイ・アールジャパンホールディングス	2,900	14,190.00	41,151,000
K e e P e r 技研	4,900	1,729.00	8,472,100
G u n o s y	6,100	767.00	4,678,700
イー・ガーディアン	3,500	3,220.00	11,270,000
ジャパンマテリアル	21,400	1,411.00	30,195,400
ベクトル	9,600	1,205.00	11,568,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,900	1,450.00	10,005,000
キャリアリンク	2,700	3,140.00	8,478,000
I B J	7,800	994.00	7,753,200

アサンテ	4,100	1,719.00	7,047,900	
バリューHR	4,000	1,827.00	7,308,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,700	4,880.00	27,816,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,753.00	6,135,500	
シグマクシス	4,500	1,835.00	8,257,500	
ウィルグループ	6,600	988.00	6,520,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,800	287.00	4,534,600	
メドピア	3,300	6,340.00	20,922,000	
リクルートホールディングス	493,500	5,312.00	2,621,472,000	
エラン	9,500	1,448.00	13,756,000	
日本郵政	521,800	901.00	470,141,800	
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,844.00	22,312,400	
鎌倉新書	8,200	888.00	7,281,600	
LITALICO	3,100	3,715.00	11,516,500	
アトラエ	2,500	3,305.00	8,262,500	
ストライク	2,700	4,700.00	12,690,000	
ソラスト	17,200	1,525.00	26,230,000	
セラク	2,800	1,769.00	4,953,200	
インソース	6,200	2,248.00	13,937,600	
ベिकाレント・コンサルティング	4,600	21,200.00	97,520,000	
Orchestra Holdings	2,300	2,610.00	6,003,000	
アイモバイル	3,300	1,319.00	4,352,700	
グレイステクノロジー	3,600	5,580.00	20,088,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	20,000	2,315.00	46,300,000	
ミダック	1,800	4,125.00	7,425,000	
日総工産	7,100	855.00	6,070,500	
キュービーネットホールディングス	5,000	1,834.00	9,170,000	
RPAホールディングス	9,700	661.00	6,411,700	
マネジメントソリューションズ	4,100	1,929.00	7,908,900	
プロレド・パートナーズ	1,200	3,480.00	4,176,000	
カーブスホールディングス	20,200	967.00	19,533,400	
ダイレクトマーケティングミックス	3,200	3,020.00	9,664,000	
ポピンズホールディングス	1,700	3,100.00	5,270,000	
リログループ	38,600	2,622.00	101,209,200	
東祥	5,300	1,829.00	9,693,700	

エイチ・アイ・エス	10,600	2,305.00	24,433,000	
ラックランド	3,000	2,380.00	7,140,000	
共立メンテナンス	11,800	3,820.00	45,076,000	
イチネンホールディングス	8,600	1,307.00	11,240,200	
建設技術研究所	5,000	2,395.00	11,975,000	
長大	3,500	1,551.00	5,428,500	
燦ホールディングス	4,800	1,134.00	5,443,200	
東京テアトル	6,200	1,296.00	8,035,200	
ナガワ	2,200	12,130.00	26,686,000	
東京都競馬	4,700	4,840.00	22,748,000	
カナモト	12,500	2,412.00	30,150,000	
西尾レントオール	6,500	2,657.00	17,270,500	
トランス・コスモス	7,000	2,786.00	19,502,000	
乃村工藝社	30,700	827.00	25,388,900	
日本管財	7,400	2,124.00	15,717,600	
トーカイ	6,700	2,245.00	15,041,500	
セコム	67,900	9,882.00	670,987,800	
セントラル警備保障	3,800	3,570.00	13,566,000	
丹青社	15,500	812.00	12,586,000	
メイテック	8,900	5,630.00	50,107,000	
応用地質	8,800	1,282.00	11,281,600	
船井総研ホールディングス	14,600	2,386.00	34,835,600	
オオバ	8,700	743.00	6,464,100	
ベネッセホールディングス	26,200	2,175.00	56,985,000	
イオンディライト	8,500	3,180.00	27,030,000	
ダイセキ	11,800	3,465.00	40,887,000	
合 計	74,393,800		191,629,346,460	

## (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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（2020年 2月18日現在）	（2021年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	478,901,879	-
コール・ローン	30,886,932	2,728,345,705
国債証券	107,923,204,140	102,126,845,070
地方債証券	8,574,266,640	8,642,456,560
特殊債券	14,874,562,019	12,556,759,175
社債券	6,837,231,000	4,039,898,000
未収入金	116,611,400	507,203,000
未収利息	420,107,736	376,676,876
前払費用	4,543,049	4,039,280
流動資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666
資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,104,493,400
未払解約金	99,011,550	2,317,953,000
未払利息	91	7,914
その他未払費用	6,316	-
流動負債合計	99,017,957	3,422,454,314
負債合計	99,017,957	3,422,454,314
純資産の部		
元本等		
元本	107,405,246,912	100,129,074,120
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,756,049,926	27,430,695,232
元本等合計	139,161,296,838	127,559,769,352
純資産合計	139,161,296,838	127,559,769,352
負債純資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	107,405,246,912口	100,129,074,120口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2957円 (10,000口当たりの純資産額 12,957円)	1口当たり純資産額 1.2740円 (10,000口当たりの純資産額 12,740円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（2020年 2月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	121,666,391,786円
同期中における追加設定元本額	14,406,619,423円
同期中における一部解約元本額	28,667,764,297円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	5,200,488,591円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	8,973,645,381円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,935,830,418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）	625,719,043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）	52,869,460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）	188,105,232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）	361,976,149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）	350,151,880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）	141,140,207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）	264,626,940円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	120,218,313円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,773,898,437円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	510,411,078円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	23,338,429円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	14,905,538円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,051,182,559円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	353,693,767円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	463,109,615円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	83,984,752円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	7,138,094円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	47,682,561円



三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	442,976円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	620,981円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	126,573円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,213,875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>	5,855,107,812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>	16,578,099,929円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	7,134,235,811円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	17,510,036,902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>	337,602,291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>	584,000,853円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	2,857,949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>	263,178,696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>	114,381,750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>	1,976,884,869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>	2,195,429,901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>	2,671,616,453円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	10,029,580,964円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	2,314,139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)	1,422,913,818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>	488,613,431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>	645,327,491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>	181,670,894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>	45,425,323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>	1,816,743,594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>	2,381,697,831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>	952,715,786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>	245,199,667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>	19,479,316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>	326,867,434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>	5,969,464,326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>	268,464,600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>	194,699,554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>	705,362,167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>	663,872,246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>	3,272,880,266円
合計	107,405,246,912円

(2021年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,405,246,912円
同期中における追加設定元本額	31,312,880,290円
同期中における一部解約元本額	38,589,053,082円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,849,125,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,277,305,275円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,281,609,671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)	557,497,100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)	42,772,936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)	195,547,502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)	416,828,870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)	506,152,768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)	222,180,703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)	359,091,057円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,162,809円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,290,177,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	405,171,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	30,166,475円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,117,329,028円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	356,713,253円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	509,322,266円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,902,299円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	29,345,283円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	84,760,569円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	55,942,355円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	92,132,794円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	25,221,489円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	4,051,909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>	1,635,333,683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>	14,645,125,243円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	6,716,300,176円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	16,758,553,795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>	324,470,878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>	584,749,121円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	1,828,677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>	269,243,070円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,304,219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>	1,906,397,650円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,164,794,277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>	2,519,848,740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>	9,294,363,282円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	1,106,276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)	1,295,938,945円
S M A M ・ グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	467,586,621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>	599,719,035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>	177,900,320円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	46,646,093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>	1,629,572,303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>	2,241,285,586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>	821,846,833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>	212,410,596円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	18,427,405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 >	302,971,200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 >	5,582,241,420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 >	288,586,835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 >	885,855,263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 >	742,864,411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 >	2,910,700,492円
合計	100,129,074,120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419回利付国債(2年)	3,280,000,000	3,293,448,000	
	第420回利付国債(2年)	510,000,000	512,193,000	
	第421回利付国債(2年)	330,000,000	331,448,700	
	第133回利付国債(5年)	48,000,000	48,174,720	
	第134回利付国債(5年)	110,000,000	110,454,300	
	第135回利付国債(5年)	190,000,000	190,870,200	
	第136回利付国債(5年)	500,000,000	502,570,000	
	第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,570,000	
	第138回利付国債(5年)	600,000,000	603,834,000	
	第139回利付国債(5年)	260,000,000	261,765,400	
	第140回利付国債(5年)	600,000,000	604,314,000	
	第141回利付国債(5年)	15,000,000	15,113,250	
	第142回利付国債(5年)	680,000,000	685,358,400	
	第143回利付国債(5年)	770,000,000	776,306,300	

第144回利付国債(5年)	1,250,000,000	1,260,600,000	
第145回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,321,750,700	
第146回利付国債(5年)	930,000,000	938,342,100	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,576,800	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	337,887,660	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	259,895,400	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	349,033,230	
第5回利付国債(40年)	215,000,000	294,229,650	
第6回利付国債(40年)	240,000,000	323,930,400	
第7回利付国債(40年)	255,000,000	331,505,100	
第8回利付国債(40年)	300,000,000	364,809,000	
第9回利付国債(40年)	483,000,000	439,713,540	
第10回利付国債(40年)	460,000,000	490,737,200	
第11回利付国債(40年)	320,000,000	331,369,600	
第12回利付国債(40年)	390,000,000	364,899,600	
第13回利付国債(40年)	310,000,000	289,639,200	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,159,620	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,422,250	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	131,950,000	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,073,421,700	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,315,467,350	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	809,113,760	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	833,003,350	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	322,478,100	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,088,000	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	347,847,200	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	121,846,800	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	821,317,350	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	801,893,200	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	787,540,600	
第341回利付国債(10年)	557,000,000	567,404,760	
第342回利付国債(10年)	350,000,000	353,213,000	
第343回利付国債(10年)	890,000,000	898,330,400	
第344回利付国債(10年)	811,000,000	818,720,720	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	947,061,080	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	646,246,400	

第347回利付国債(10年)	540,000,000	545,313,600	
第348回利付国債(10年)	145,000,000	146,387,650	
第349回利付国債(10年)	250,000,000	252,397,500	
第350回利付国債(10年)	420,000,000	423,872,400	
第351回利付国債(10年)	290,000,000	292,554,900	
第352回利付国債(10年)	790,000,000	796,588,600	
第353回利付国債(10年)	640,000,000	645,011,200	
第354回利付国債(10年)	965,000,000	972,005,900	
第355回利付国債(10年)	870,000,000	875,420,100	
第356回利付国債(10年)	850,000,000	854,726,000	
第357回利付国債(10年)	35,000,000	35,169,050	
第358回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,024,141,200	
第359回利付国債(10年)	780,000,000	782,168,400	
第360回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,913,629,000	
第361回利付国債(10年)	280,000,000	280,271,600	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	617,411,100	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	381,852,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	351,590,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	587,034,780	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,201,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	615,001,050	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	508,234,200	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	728,042,300	
第14回利付国債(30年)	712,000,000	910,491,360	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	604,035,000	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	575,464,500	
第19回利付国債(30年)	470,000,000	602,474,200	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	444,246,150	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	415,875,600	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	435,408,470	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	411,224,300	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	389,805,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	478,463,040	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	589,195,200	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	519,328,260	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	236,125,080	

第30回利付国債(30年)	472,000,000	623,724,400	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	412,363,350	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	519,971,400	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	485,193,240	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	605,950,010	
第35回利付国債(30年)	390,000,000	503,876,100	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	77,755,200	
第37回利付国債(30年)	355,000,000	454,030,800	
第38回利付国債(30年)	320,000,000	403,923,200	
第39回利付国債(30年)	190,000,000	243,923,900	
第40回利付国債(30年)	270,000,000	341,571,600	
第41回利付国債(30年)	270,000,000	336,395,700	
第42回利付国債(30年)	260,000,000	324,222,600	
第43回利付国債(30年)	305,000,000	380,676,600	
第44回利付国債(30年)	300,000,000	374,757,000	
第45回利付国債(30年)	245,000,000	295,597,400	
第46回利付国債(30年)	295,000,000	356,103,350	
第47回利付国債(30年)	280,000,000	344,568,000	
第48回利付国債(30年)	345,000,000	409,390,800	
第49回利付国債(30年)	355,000,000	421,388,550	
第50回利付国債(30年)	355,000,000	372,096,800	
第51回利付国債(30年)	335,000,000	311,529,900	
第52回利付国債(30年)	353,000,000	344,404,450	
第53回利付国債(30年)	247,000,000	246,446,720	
第54回利付国債(30年)	45,000,000	47,029,500	
第55回利付国債(30年)	315,000,000	328,951,350	
第56回利付国債(30年)	300,000,000	313,038,000	
第57回利付国債(30年)	295,000,000	307,567,000	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	364,605,500	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	406,528,000	
第60回利付国債(30年)	400,000,000	425,880,000	
第61回利付国債(30年)	345,000,000	349,474,650	
第62回利付国債(30年)	105,000,000	100,899,750	
第63回利付国債(30年)	380,000,000	354,722,400	
第64回利付国債(30年)	235,000,000	218,989,450	
第65回利付国債(30年)	355,000,000	330,238,750	

第66回利付国債(30年)	310,000,000	288,225,600	
第67回利付国債(30年)	310,000,000	303,933,300	
第68回利付国債(30年)	400,000,000	392,116,000	
第69回利付国債(30年)	80,000,000	80,496,000	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,503,640,650	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,243,358,100	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,078,515,250	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,078,405,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,089,819,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	845,457,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	812,720,430	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	720,200,960	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	534,046,100	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	641,052,700	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	682,489,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	935,773,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	716,530,500	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	836,107,860	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	22,429,400	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	653,613,600	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	826,799,620	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	711,221,200	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	350,524,300	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	777,101,220	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	794,337,390	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	239,747,400	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	416,198,450	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	538,199,760	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	452,450,700	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	432,056,400	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	440,177,220	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	448,039,800	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	391,873,800	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	455,800,380	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	502,455,170	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	428,626,770	

第116回利付国債(20年)	200,000,000	238,756,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	235,894,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	342,471,400	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	228,474,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	299,280,750	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	384,162,900	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	95,719,200	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	225,478,700	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	248,082,800	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	214,234,200	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	171,129,000	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	254,312,750	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	222,801,600	
第130回利付国債(20年)	155,000,000	182,213,350	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	442,745,600	
第132回利付国債(20年)	450,000,000	525,469,500	
第133回利付国債(20年)	190,000,000	223,894,100	
第134回利付国債(20年)	200,000,000	236,220,000	
第135回利付国債(20年)	155,000,000	181,379,450	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	139,113,600	
第137回利付国債(20年)	25,000,000	29,317,500	
第139回利付国債(20年)	70,000,000	81,309,200	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	622,824,200	
第141回利付国債(20年)	230,000,000	270,818,100	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	130,797,700	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	198,537,900	
第144回利付国債(20年)	30,000,000	34,681,500	
第145回利付国債(20年)	110,000,000	130,013,400	
第146回利付国債(20年)	105,000,000	124,331,550	
第147回利付国債(20年)	230,000,000	269,948,700	
第148回利付国債(20年)	59,000,000	68,601,070	
第149回利付国債(20年)	635,000,000	739,311,450	
第150回利付国債(20年)	221,000,000	254,722,390	
第151回利付国債(20年)	770,000,000	867,220,200	
第152回利付国債(20年)	245,000,000	276,090,500	
第153回利付国債(20年)	247,000,000	281,906,040	



	第154回利付国債(20年)	580,000,000	654,303,800	
	第155回利付国債(20年)	410,000,000	450,754,000	
	第156回利付国債(20年)	380,000,000	384,370,000	
	第157回利付国債(20年)	155,000,000	151,948,050	
	第158回利付国債(20年)	360,000,000	368,521,200	
	第159回利付国債(20年)	318,000,000	330,173,040	
	第160回利付国債(20年)	315,000,000	331,528,050	
	第161回利付国債(20年)	260,000,000	269,209,200	
	第162回利付国債(20年)	80,000,000	82,745,600	
	第163回利付国債(20年)	670,000,000	692,223,900	
	第164回利付国債(20年)	215,000,000	218,435,700	
	第165回利付国債(20年)	650,000,000	659,464,000	
	第166回利付国債(20年)	295,000,000	308,776,500	
	第167回利付国債(20年)	500,000,000	505,375,000	
	第168回利付国債(20年)	150,000,000	148,746,000	
	第169回利付国債(20年)	400,000,000	388,848,000	
	第170回利付国債(20年)	255,000,000	247,589,700	
	第171回利付国債(20年)	525,000,000	509,113,500	
	第172回利付国債(20年)	500,000,000	493,435,000	
	第173回利付国債(20年)	515,000,000	507,707,600	
	第174回利付国債(20年)	660,000,000	649,961,400	
	国債証券合計	93,847,000,000	102,126,845,070	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,558,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,004,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,092,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	516,368,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	631,575,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,125,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	101,060,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	101,138,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,560,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,623,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,910,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,452,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,074,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,843,000	

第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,412,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,055,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,883,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,328,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,153,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	325,365,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	128,330,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	109,940,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,986,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,760,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,810,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,388,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,352,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,768,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,143,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,281,000	
第115回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,640,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,595,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,866,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,665,000	
第183回共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,180,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	211,196,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	108,727,000	
第5回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,364,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	133,525,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	116,861,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,052,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,043,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,214,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,079,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,477,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,048,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,753,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	101,751,000	
平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,267,000	

	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	148,614,060	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,153,000	
地方債証券合計		8,097,000,000	8,642,456,560	
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	211,894,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,698,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,081,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,343,000	
	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	100,188,000	
	第9回道路債券	100,000,000	128,708,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,210,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	434,574,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,798,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	349,521,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,890,000	
	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	232,552,000	
	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	131,522,000	
	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	350,301,000	
	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	118,206,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	405,828,000	
	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	100,706,000	
	第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,913,000	
	第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,230,000	
	第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,384,000	
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	203,894,000		
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	305,553,000		
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	189,000,000	188,523,720		

第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,066,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,118,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,417,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,829,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,208,000	
第20回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,121,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,995,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	230,574,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,359,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,982,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,413,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,144,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,267,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,460,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,994,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,759,000	
第101回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,897,000	
第106回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,208,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	103,174,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,247,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,385,000	10,474,830	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,426,000	12,788,963	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,800,000	10,912,320	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,978,000	14,560,183	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,690,000	24,292,199	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,137,000	14,836,074	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,882,000	37,947,889	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,910,000	14,466,678	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,935,000	15,732,827	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,599,000	9,615,318	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,676,000	9,694,964	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,358,000	24,662,231	

第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,082,000	19,191,149	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,068,000	39,502,626	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,286,000	59,656,405	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,733,000	22,010,152	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,434,000	23,871,346	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,316,000	11,513,464	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,330,000	27,137,295	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,872,000	26,646,865	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,608,000	12,907,313	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,158,000	52,230,375	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,505,000	13,972,948	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,606,000	27,223,274	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,152,000	26,617,355	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,197,000	12,496,070	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,221,000	13,716,655	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,040,000	25,931,674	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,708,000	34,688,142	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,586,000	30,418,362	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,054,000	57,423,726	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,975,000	28,552,767	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,147,000	12,514,082	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,916,000	63,355,777	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,598,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,917,000	13,361,215	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,040,000	84,569,463	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,903,000	40,014,955	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,691,000	42,954,233	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,482,000	82,950,765	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,076,000	128,541,144	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,421,000	41,348,686	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,928,000	46,827,555	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,358,000	96,121,406	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,276,000	83,083,626	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,185,000	47,576,190	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,142,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,844,000	69,105,332	

	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,822,000	85,551,469
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,585,000	85,078,976
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,880,000	85,372,304
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,213,000	86,570,783
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,545,000	86,027,473
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,904,000	87,607,053
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,314,000
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,883,000	90,708,125
	第226回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,847,000
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,926,000	24,588,271
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,658,000	27,597,427
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,876,000	13,288,418
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,367,000	12,695,838
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,966,000	27,925,450
	い第810号農林債	300,000,000	300,450,000
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	101,196,000
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,014,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,410,000
	第85回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,255,000
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,898,000
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,857,000
特殊債券合計		11,735,516,000	12,556,759,175
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債	200,000,000	200,590,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,784,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,814,000
	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	100,042,000
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,067,000
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,916,000
	第22回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,571,000
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,788,000
	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	114,467,000
	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	101,155,000

第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,702,000	
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	101,373,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,408,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,284,000	
第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,954,000	
第93回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	399,740,000	
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	99,860,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	125,266,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,238,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,493,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,013,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,522,000	
第45回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,394,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,710,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,550,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,230,000	
第37回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,616,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,052,000	
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	101,011,000	
社債券合計	3,900,000,000	4,039,898,000	
合計		127,365,958,805	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,141,752,692	1,920,973,169
金銭信託	702,503,849	-
コール・ローン	45,308,213	228,430,090
株式	233,710,263,718	267,313,435,920
投資証券	6,446,937,770	6,105,616,194
派生商品評価勘定	157,726,072	69,749,174
未収入金	64,328	758,789,533
未収配当金	283,567,619	286,772,376
差入委託証拠金	1,982,236,680	848,540,673
流動資産合計	246,470,360,941	277,532,307,129
資産合計	246,470,360,941	277,532,307,129
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,383,285	267,971
前受金	153,450,087	68,809,493
未払解約金	830,678,122	1,002,530,455
未払利息	134	662
その他未払費用	2,936	-
流動負債合計	988,514,564	1,071,608,581
負債合計	988,514,564	1,071,608,581
純資産の部		
元本等		
元本	59,028,905,441	58,766,657,288
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	186,452,940,936	217,694,041,260
元本等合計	245,481,846,377	276,460,698,548
純資産合計	245,481,846,377	276,460,698,548
負債純資産合計	246,470,360,941	277,532,307,129

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,028,905,441口	58,766,657,288口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 4.1587円 (10,000口当たりの純資産額 41,587円)</p>	<p>1口当たり純資産額 4.7044円 (10,000口当たりの純資産額 47,044円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

(2020年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,086,093,166	-	5,239,543,253	153,450,087
	SPMINI 2003	3,715,249,600	-	3,844,255,725	129,006,125
	DJ EUR 2003	856,921,748	-	879,050,016	22,128,268
	FTSE 2003	299,497,825	-	295,363,185	4,134,640
	SPI200 2003	214,423,993	-	220,874,327	6,450,334
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	184,238,700	-	184,346,000	107,300
	米ドル	129,505,000	-	129,623,000	118,000
	カナダドル	6,627,200	-	6,637,600	10,400
	ユーロ	19,030,400	-	19,032,000	1,600
	英ポンド	11,451,200	-	11,424,800	26,400
	スイスフラン	5,588,500	-	5,597,000	8,500
	スウェーデンクローナ	2,034,000	-	2,037,600	3,600
	ノルウェークローネ	474,800	-	473,600	1,200
	デンマーククローネ	1,273,600	-	1,273,600	-
	オーストラリアドル	4,422,600	-	4,412,400	10,200
	香港ドル	2,402,100	-	2,402,100	-
	シンガポールドル	788,900	-	790,300	1,400
	イスラエルシェケル	640,400	-	642,000	1,600
	合計	5,270,331,866	-	5,423,889,253	153,342,787

(2021年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

--	--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,745,707,052	-	2,814,516,545	68,809,493
	SPMINI 2103	2,065,041,400	-	2,118,268,272	53,226,872
	DJ EUR 2103	435,929,493	-	447,483,031	11,553,538
	FTSE 2103	134,662,153	-	136,794,292	2,132,139
	SPI200 2103	110,074,006	-	111,970,950	1,896,944
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	364,763,810	-	364,092,100	671,710
	米ドル	233,044,600	-	232,606,000	438,600
	カナダドル	26,667,100	-	26,649,600	17,500
	ユーロ	15,400,320	-	15,289,200	111,120
	英ポンド	45,498,240	-	45,470,800	27,440
	スイスフラン	16,524,600	-	16,483,600	41,000
	スウェーデンクローナ	5,983,120	-	5,973,700	9,420
	ノルウェークローネ	1,620,330	-	1,618,500	1,830
	デンマーククローネ	4,120,260	-	4,111,200	9,060
	オーストラリアドル	6,567,680	-	6,562,400	5,280
	ニュージーランドドル	760,620	-	760,600	20
	香港ドル	6,007,560	-	6,001,600	5,960
	シンガポールドル	1,595,490	-	1,593,200	2,290
	イスラエルシェケル	973,890	-	971,700	2,190
	合計		3,110,470,862	-	3,178,608,645

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2020年 2月18日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,205,007,755円
同期中における追加設定元本額	17,841,275,258円
同期中における一部解約元本額	10,017,377,572円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	24,828,043,242円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	303,036,450円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,226,998,168円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	822,009,476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)	75,101,360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)	2,101,425円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,192,634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)	22,897,019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)	47,925,112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)	36,295,463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)	83,049,192円
外国株式指数ファンド	516,313,712円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,289,680,165円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	412,589,320円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	419,978,757円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	318,817,093円
イオン・バランス戦略ファンド	25,105,401円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	7,491,762円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	45,849,580円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,836,373円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	114,226,463円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,367,997円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	73,375,327円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,103,337円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	286,222円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	26,000円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	82,549円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	55,524円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,643,256円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,229,811,499円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,672,249円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	66,348,893円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,277,164,230円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,305,319,045円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,509,240,201円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	17,911,308円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	94,101,398円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	399,172円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	682,688,394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>	55,944,645円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	158,440,162円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	721,136,946円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	558,667,645円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,345,334,596円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	746,596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)	282,073,284円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	116,624,991円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	15,373,482円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,502,233円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,176,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	37,751,066円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	96,012,758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>	659,889,934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>	120,415,216円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,222,610,762円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	221,785,813円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	3,893,763,433円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,071,423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>	46,409,987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>	42,379,851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>	410,659,696円
合計	59,028,905,441円

(2021年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,028,905,441円
同期中における追加設定元本額	21,383,368,865円
同期中における一部解約元本額	21,645,617,018円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,959,034,399円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	303,792,749円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,258,091,387円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	856,580,813円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	72,192,845円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,387,865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)	6,808,713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)	20,760,185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)	51,873,489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)	49,391,613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)	96,959,787円
外国株式指数ファンド	568,180,269円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,713,337,204円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	274,434,170円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	290,257,470円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,039,592円
イオン・バランス戦略ファンド	47,420,115円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,429,026円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	92,308,642円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	76,998,068円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	241,854,195円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	120,616,253円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	136,527,997円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,180,752円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	161,377,669円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	2,741,835円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	10,771,338円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	9,141,735円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,883,247円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	19,920,837円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	854,963,605円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	6,257,384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>	45,229,221円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,006,088,194円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,105,519,628円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	4,733,561,628円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	15,126,382円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	82,302,577円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	221,797円

S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	618,727,388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 >	50,710,438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 >	132,813,524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 >	615,908,839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 >	474,127,525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 >	1,109,446,238円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	323,177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 )	258,084,232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 >	97,914,771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 >	12,472,286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 >	10,134,411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 >	5,648,485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 >	31,438,597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 >	83,975,579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 >	230,303,089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 >	90,262,097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 >	3,445,551,577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 >	171,768,987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 >	1,326,659,547円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	14,023,156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 >	40,287,615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 >	33,743,927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 >	385,767,128円
合計	58,766,657,288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	23.55	752,987.70	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	18.58	364,762.56	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	69.29	813,949.63	
	CHEVRON CORPORATION	100,597	95.92	9,649,264.24	
	CONOCOPHILLIPS	70,648	49.36	3,487,185.28	
	DEVON ENERGY CORPORATION	31,182	21.73	677,584.86	
	EOG RESOURCES INC	30,830	63.54	1,958,938.20	
	EXXON MOBIL CORPORATION	222,493	52.85	11,758,755.05	
	HALLIBURTON CO	44,317	20.55	910,714.35	
	HESS CORPORATION	15,765	61.82	974,592.30	
	KINDER MORGAN INC	105,940	15.13	1,602,872.20	



MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,933	51.89	1,760,783.37
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	26.73	1,298,543.40
ONEOK INC	21,278	45.99	978,575.22
PHILLIPS 66	22,492	80.64	1,813,754.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,578	136.20	1,440,723.60
SCHLUMBERGER LTD	73,444	26.87	1,973,440.28
VALERO ENERGY CORP	22,007	68.12	1,499,116.84
WILLIAMS COS INC	64,802	23.09	1,496,278.18
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,739	260.01	3,052,257.39
ALBEMARLE CORPORATION	5,548	157.47	873,643.56
AMCOR PLC	82,302	11.30	930,012.60
AVERY DENNISON CORP	4,848	175.48	850,727.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	27.03	340,307.70
BALL CORPORATION	17,166	89.86	1,542,536.76
CELANESE CORPORATION	6,420	132.42	850,136.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	45.06	540,810.12
CORTEVA INC	39,348	44.98	1,769,873.04
CROWN HOLDINGS INC	6,863	98.99	679,368.37
DOW INC	38,654	58.54	2,262,805.16
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	69.99	1,955,800.56
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	110.25	774,726.75
ECOLAB INC	13,341	208.79	2,785,467.39
FMC CORPORATION	6,676	106.75	712,663.00
FREEMONT-MCMORAN INC	75,431	34.15	2,575,968.65
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	48.50	928,290.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,734	137.67	1,615,419.78
LINDE PLC	27,261	249.28	6,795,622.08
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	97.81	1,362,591.11
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	325.30	1,005,827.60
MOSAIC CO/THE	18,584	30.43	565,511.12
NEWMONT CORPORATION	41,882	56.99	2,386,855.18
NUCOR CORP	15,455	57.00	880,935.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	133.42	624,672.44
PPG INDUSTRIES INC	12,256	136.60	1,674,169.60
RPM INTERNATIONAL INC	5,917	86.00	508,862.00
SEALED AIR CORP	7,895	43.41	342,721.95
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,385	721.40	3,163,339.00
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	40.71	414,875.61
VULCAN MATERIALS CO	6,698	161.88	1,084,272.24
WESTROCK CO	13,034	44.00	573,496.00
3M COMPANY	30,517	176.65	5,390,828.05
ALLEGION PLC	4,764	109.30	520,705.20

AMETEK INC	11,312	120.21	1,359,815.52
BOEING CO	27,549	215.52	5,937,360.48
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	37.24	1,610,741.72
CATERPILLAR INC	28,478	202.30	5,761,099.40
CUMMINS INC	8,021	241.81	1,939,558.01
DEERE & CO	15,649	312.08	4,883,739.92
DOVER CORP	6,972	120.63	841,032.36
EATON CORP PLC	21,253	125.03	2,657,262.59
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	84.87	2,646,076.86
FASTENAL COMPANY	29,892	46.95	1,403,429.40
FORTIVE CORP	15,750	67.60	1,064,700.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,166	85.74	614,412.84
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	355.32	1,172,556.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	164.49	2,079,482.58
GENERAL ELECTRIC CO	463,903	11.86	5,501,889.58
HEICO CORP	1,888	128.34	242,305.92
HEICO CORP-CLASS A	3,183	117.66	374,511.78
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,031	201.90	7,476,558.90
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	28.64	544,847.36
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	178.42	375,930.94
IDEX CORP	3,839	193.50	742,846.50
ILLINOIS TOOL WORKS	16,893	198.24	3,348,868.32
INGERSOLL-RAND INC	16,781	42.99	721,415.19
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	112.81	781,434.87
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	51.64	593,860.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,600	24.35	258,110.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,644	55.20	2,133,148.80
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,215	188.46	2,113,578.90
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,527	293.60	448,327.20
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,370	337.00	4,505,690.00
MASCO CORP	14,885	54.22	807,064.70
NORDSON CORP	3,207	183.76	589,318.32
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	297.18	2,465,108.10
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	62.69	1,323,448.59
OWENS CORNING	5,205	83.49	434,565.45
PACCAR INC	18,041	96.04	1,732,747.84
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,691	272.01	1,820,018.91
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	54.88	451,113.60
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	80,919	73.06	5,911,942.14
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	248.10	1,542,933.90
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,651	387.12	2,187,615.12
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	58.57	445,132.00

SMITH(A.O.) CORP	7,157	59.26	424,123.82
SNAP-ON INC	2,285	188.87	431,567.95
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,007	170.47	1,364,953.29
SUNRUN INC	6,112	74.20	453,510.40
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	403.24	830,674.40
TEXTRON INC	11,803	50.78	599,356.34
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	151.30	1,930,436.70
TRANSDIGM GROUP INC	2,681	570.37	1,529,161.97
UNITED RENTALS INC	3,596	277.81	999,004.76
WABTEC CORP	9,231	79.35	732,479.85
WW GRAINGER INC	2,390	372.18	889,510.20
XYLEM INC	9,124	98.19	895,885.56
CINTAS CORP	4,615	339.11	1,564,992.65
COPART INC	10,977	117.99	1,295,176.23
COSTAR GROUP INC	2,054	910.75	1,870,680.50
EQUIFAX INC	6,127	176.59	1,081,966.93
IHS MARKIT LTD	19,584	93.15	1,824,249.60
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	90.08	1,028,263.20
ROBERT HALF INTL INC	5,555	76.50	424,957.50
ROLLINS INC	11,493	36.60	420,643.80
TRANSUNION	9,497	88.51	840,579.47
VERISK ANALYTICS INC	7,929	188.56	1,495,092.24
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	98.24	1,331,741.44
WASTE MANAGEMENT INC	22,023	112.21	2,471,200.83
AMERCO	390	504.23	196,649.70
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	89.95	622,903.75
CSX CORPORATION	40,214	89.99	3,618,857.86
DELTA AIR LINES INC	8,299	44.39	368,392.61
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	94.42	820,415.38
FEDEX CORP	13,083	259.09	3,389,674.47
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	143.82	634,390.02
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	209.85	1,070,235.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	7,940	42.93	340,864.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,410	253.03	3,393,132.30
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	207.99	1,024,558.74
SOUTHWEST AIRLINES	9,083	52.44	476,312.52
UBER TECHNOLOGIES INC	49,619	60.81	3,017,331.39
UNION PACIFIC CORP	35,835	211.23	7,569,427.05
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,435	161.00	5,866,035.00
XPO LOGISTICS INC	4,716	119.00	561,204.00
APTIV PLC	14,147	156.57	2,214,995.79
AUTOLIV INC	4,001	91.67	366,771.67

BORNGARNER INC	12,075	44.57	538,182.75
FORD MOTOR COMPANY	208,063	11.48	2,388,563.24
GENERAL MOTORS CO	67,788	52.89	3,585,307.32
LEAR CORP	2,749	163.25	448,774.25
TESLA INC	39,040	798.15	31,159,776.00
D.R.HORTON INC	18,162	78.39	1,423,719.18
GARMIN LTD	6,854	129.51	887,661.54
HASBRO INC	7,491	90.88	680,782.08
LENNAR CORP-CL A	14,494	87.25	1,264,601.50
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	337.52	2,187,467.12
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	168.45	482,272.35
NEWELL BRANDS INC	17,587	24.08	423,494.96
NIKE INC -CL B	65,547	143.99	9,438,112.53
NVR INC	173	4,704.40	813,861.20
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,216	139.23	1,422,373.68
PULTE GROUP INC	12,271	46.17	566,552.07
VF CORP	17,117	79.52	1,361,143.84
WHIRLPOOL CORP	3,212	193.97	623,031.64
ARAMARK	13,242	37.05	490,616.10
CARNIVAL CORP	27,595	23.20	640,204.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,381	1,459.50	2,015,569.50
DARDEN RESTAURANTS INC	6,111	128.27	783,857.97
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	376.49	798,535.29
DRAFTKINGS INC - CL A	8,947	58.86	526,620.42
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	111.43	1,628,772.31
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	57.99	1,022,595.66
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	131.34	1,932,668.10
MCDONALD'S CORPORATION	39,217	213.45	8,370,868.65
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	15,060	18.59	279,965.40
MGM MIRAGE	25,878	34.96	904,694.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	75.11	678,693.96
STARBUCKS CORP	61,056	104.44	6,376,688.64
VAIL RESORTS INC	2,038	296.32	603,900.16
WYNN RESORTS LTD	4,913	122.17	600,221.21
YUM! BRANDS INC	15,549	104.34	1,622,382.66
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	102.35	4,103,416.20
ALPHABET INC-CL A	15,733	2,118.62	33,332,248.46
ALPHABET INC-CL C	15,722	2,128.31	33,461,289.82
ALTICE USA INC-A	14,243	34.05	484,974.15
CABLE ONE INC	246	2,104.09	517,606.14
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,491	624.12	4,675,282.92
COMCAST CORP-CLASS A	236,457	52.99	12,529,856.43

DISCOVERY INC-A	7,075	49.36	349,222.00
DISCOVERY INC-C	18,283	41.62	760,938.46
DISH NETWORK CORP.	12,937	32.50	420,452.50
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	145.83	2,238,782.16
FACEBOOK INC-A	125,809	273.57	34,417,568.13
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	31.75	538,543.50
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	30.66	268,980.18
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	263.29	1,046,314.46
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	25.16	493,790.16
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	147.83	193,952.96
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	151.21	1,239,317.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	45.46	467,692.48
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	42.65	326,187.20
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	43.41	179,760.81
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	84.86	637,468.32
MATCH GROUP INC	12,773	160.80	2,053,898.40
NETFLIX INC	23,034	551.34	12,699,565.56
NEWS CORP-CLASS A	16,662	23.18	386,225.16
OMNICOM GROUP	10,417	67.10	698,980.70
PINTEREST INC- CLASS A	24,320	86.30	2,098,816.00
ROKU INC	5,620	456.97	2,568,171.40
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.01	406,612.56
SNAP INC-A	47,744	62.72	2,994,503.68
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	195.93	1,118,172.51
THE WALT DISNEY CO.	94,382	186.44	17,596,580.08
TWITTER INC	40,795	71.79	2,928,673.05
VIACOMCBS INC	30,908	61.00	1,885,388.00
ZILLOW GROUP INC-A	3,154	193.55	610,456.70
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	189.76	1,500,242.56
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	161.82	554,395.32
AMAZON.COM INC	22,260	3,308.64	73,650,326.40
AUTOZONE INC	1,271	1,192.97	1,516,264.87
BEST BUY COMPANY INC	12,132	118.34	1,435,700.88
BOOKING HOLDINGS INC	2,139	2,233.77	4,778,034.03
BURLINGTON STORES INC	3,391	264.79	897,902.89
CARMAX INC	8,427	122.51	1,032,391.77
CARVANA CO	3,285	295.61	971,078.85
CHEWY INC - CLASS A	3,969	110.49	438,534.81
DOLLAR GENERAL CORP	13,090	201.50	2,637,635.00
DOLLAR TREE INC	12,047	108.32	1,304,931.04
EBAY INC	36,668	63.05	2,311,917.40
ETSY INC	6,272	222.41	1,394,955.52

EXPEDIA GROUP INC	6,894	154.04	1,061,951.76
GENUINE PARTS CO	7,406	98.94	732,749.64
HOME DEPOT INC	56,492	280.92	15,869,732.64
LKQ CORPORATION	15,922	36.78	585,611.16
LOWE'S COMPANIES INC	39,472	177.13	6,991,675.36
MERCADOLIBRE INC	2,337	1,890.25	4,417,514.25
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,833	447.46	1,715,114.18
POOL CORP	2,107	330.17	695,668.19
ROSS STORES INC	18,792	119.47	2,245,080.24
TARGET CORP	26,147	193.60	5,062,059.20
TJX COMPANIES INC	63,027	66.83	4,212,094.41
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	170.25	1,041,419.25
ULTA BEAUTY INC	2,765	324.55	897,380.75
WAYFAIR INC-CLASS A	3,266	273.26	892,467.16
COSTCO WHOLESALE CORP	23,269	358.04	8,331,232.76
KROGER CO	40,843	34.37	1,403,773.91
SYSCO CORP	25,165	74.89	1,884,606.85
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,655	49.56	1,965,301.80
WALMART INC	73,955	147.20	10,886,176.00
ALTRIA GROUP INC	98,861	43.60	4,310,339.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,476	55.92	1,704,217.92
BROWN-FORMAN CORPORATION	16,130	75.98	1,225,557.40
BUNGE LIMITED	7,174	78.00	559,572.00
CAMPBELL SOUP CO	10,638	46.38	493,390.44
COCA-COLA CO/THE	213,255	50.13	10,690,473.15
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	12,266	53.43	655,372.38
CONAGRA BRANDS INC	24,639	33.97	836,986.83
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	228.46	2,028,953.26
GENERAL MILLS INC	31,489	56.81	1,788,890.09
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	46.96	701,535.44
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	115.44	665,857.92
KELLOGG CO	12,949	58.03	751,430.47
KEURIG DR PEPPER INC	29,587	31.66	936,724.42
KRAFT HEINZ COMPANY	32,774	37.02	1,213,293.48
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	77.09	571,776.53
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	85.95	1,124,569.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	45.38	436,964.02
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,601	54.92	4,097,086.92
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	21,116	92.16	1,946,050.56
PEPSICO INC	72,318	134.46	9,723,878.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	81,336	86.61	7,044,510.96
THE HERSHEY COMPANY	7,514	151.29	1,136,793.06

TYSON FOODS INC-CL A	14,949	67.22	1,004,871.78
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	82.76	1,033,258.60
CLOROX COMPANY	6,542	187.76	1,228,325.92
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	42,815	78.44	3,358,408.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,380	289.59	3,295,534.20
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	130.77	2,327,706.00
PROCTER & GAMBLE CO	130,031	128.46	16,703,782.26
ABBOTT LABORATORIES	92,474	127.24	11,766,391.76
ABIOMED INC	2,288	316.30	723,694.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	599.53	2,310,588.62
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	105.31	841,742.83
ANTHEM INC	13,220	290.25	3,837,105.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	77.68	2,053,393.12
BECTON DICKINSON & CO	15,140	256.82	3,888,254.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	37.50	2,795,850.00
CARDINAL HEALTH INC	15,114	51.72	781,696.08
CENTENE CORP	30,528	58.61	1,789,246.08
CERNER CORP	15,537	72.49	1,126,277.13
CIGNA CORPORATION	19,179	208.02	3,989,615.58
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,771	384.65	1,065,865.15
CVS HEALTH CORPORATION	69,375	72.71	5,044,256.25
DANAHER CORP	33,671	239.91	8,078,009.61
DAVITA INC	4,138	103.11	426,669.18
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	52.69	625,114.16
DEXCOM INC	4,765	414.12	1,973,281.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,336	85.07	2,750,823.52
HCA HEALTHCARE INC	14,352	176.44	2,532,266.88
HENRY SCHEIN INC	7,559	64.87	490,352.33
HOLOGIC INC	13,592	82.50	1,121,340.00
HUMANA INC.	6,899	377.52	2,604,510.48
IDEXX LABORATORIES INC	4,260	540.35	2,301,891.00
INSULET CORP	3,400	279.69	950,946.00
INTUITIVE SURGICAL INC	6,211	780.06	4,844,952.66
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	242.95	1,213,535.25
MASIMO CORPORATION	2,941	267.38	786,364.58
MCKESSON CORP	8,411	181.29	1,524,830.19
MEDTRONIC PLC	70,810	118.16	8,366,909.60
MOLINA HEALTHCARE INC	2,698	216.90	585,196.20
NOVOCURE LTD	4,517	180.89	817,080.13
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	121.85	830,285.90
RESMED INC	7,181	199.73	1,434,261.13
STERIS PLC	4,287	185.00	793,095.00

STRYKER CORP	17,769	246.57	4,381,302.33
TELADOC HEALTH INC	6,122	287.86	1,762,278.92
TELEFLEX INC	2,340	403.30	943,722.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,857	326.86	16,296,259.02
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	129.02	542,271.06
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,718	176.18	831,217.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,005	316.29	2,215,611.45
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	293.99	1,110,988.21
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	158.58	1,721,544.48
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,227	187.55	605,223.85
ABBVIE INC	92,176	106.29	9,797,387.04
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,406	130.12	2,004,628.72
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,519	157.02	1,808,713.38
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	156.53	878,602.89
AMGEN INC	30,884	235.61	7,276,579.24
AVANTOR INC	25,606	29.63	758,705.78
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	655.72	799,978.40
BIOGEN INC	8,548	276.67	2,364,975.16
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	85.80	779,064.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	118,900	60.59	7,204,151.00
CATALENT INC	8,935	120.95	1,080,688.25
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	30.04	625,162.44
ELI LILLY & CO	45,317	206.46	9,356,147.82
EXACT SCIENCES CORP	8,428	140.99	1,188,263.72
GILEAD SCIENCES INC	65,673	65.10	4,275,312.30
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	87.17	1,009,602.94
ILLUMINA INC	7,655	494.24	3,783,407.20
INCYTE CORP	9,243	83.77	774,286.11
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	58.30	394,108.00
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	188.93	1,874,374.53
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	164.28	427,785.12
JOHNSON & JOHNSON	137,956	165.66	22,853,790.96
MERCK & CO. INC.	132,101	75.54	9,978,909.54
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	1,166.46	1,467,406.68
MODERNA INC	14,409	176.76	2,546,934.84
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	115.29	482,603.94
PERKINELMER INC	5,624	144.42	812,218.08
PERRIGO CO PLC	6,187	44.05	272,537.35
PFIZER INC	290,232	34.89	10,126,194.48
PPD INC	6,413	36.90	236,639.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	481.68	2,646,831.60
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,978	47.38	283,237.64



SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	89.60	342,988.80
SEAGEN INC	6,654	158.83	1,056,854.82
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	58,227	11.30	657,965.10
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,661	498.46	10,298,682.06
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	214.85	2,906,920.50
VIATRIS INC	63,072	18.52	1,168,093.44
WATERS CORP	2,901	282.58	819,764.58
ZOETIS INC	24,975	168.90	4,218,277.50
BANK OF AMERICA CORP	409,722	34.41	14,098,534.02
CITIGROUP INC	109,981	64.76	7,122,369.56
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	41.83	870,022.17
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	33.53	1,245,639.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	163.15	1,451,545.55
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	14.97	794,338.14
JPMORGAN CHASE & CO	159,751	145.10	23,179,870.10
KEYCORP	51,128	19.72	1,008,244.16
M & T BANK CORP	6,094	148.20	903,130.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,684	167.55	3,800,704.20
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	45,343	20.02	907,766.86
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	530.12	1,399,516.80
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	70,316	55.65	3,913,085.40
US BANCORP	70,743	49.30	3,487,629.90
WELLS FARGO & COMPANY	204,428	36.59	7,480,020.52
ALLY FINANCIAL INC	20,139	41.74	840,601.86
AMERICAN EXPRESS COMPANY	36,399	128.56	4,679,455.44
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,412	218.39	1,400,316.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	51.95	402,352.75
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	42.90	1,810,680.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	73,192	245.25	17,950,338.00
BLACKROCK INC	8,069	721.39	5,820,895.91
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,684	69.88	2,423,717.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	118.91	2,812,697.14
CARLYLE GROUP INC/THE	9,341	36.55	341,413.55
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	96.02	543,569.22
CME GROUP INC.	18,712	191.14	3,576,611.68
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	91.70	1,506,172.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	27.87	635,993.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	315.04	610,862.56
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	27.68	395,768.64
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,342	312.74	5,423,537.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	27,549	112.78	3,106,976.22
INVESCO LIMITED	18,328	22.58	413,846.24

KKR & CO INC	24,324	47.55	1,156,606.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	535.71	1,024,277.52
MOODY'S CORP	8,519	280.55	2,390,005.45
MORGAN STANLEY	71,864	75.45	5,422,138.80
MSCI INC-A	4,383	439.32	1,925,539.56
NASDAQ INC	6,558	144.69	948,877.02
NORTHERN TRUST CORP	9,502	97.46	926,064.92
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	116.90	751,199.40
S&P GLOBAL INC	12,668	338.93	4,293,565.24
SCHWAB (CHARLES) CORP	80,364	61.30	4,926,313.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	57.80	316,801.80
STATE STREET CORP	18,694	75.16	1,405,041.04
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	37.47	1,042,602.75
T ROWE PRICE GROUP INC	11,312	163.24	1,846,570.88
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	67.86	354,229.20
VOYA FINANCIAL INC	7,308	56.00	409,248.00
AFLAC INC	35,411	47.04	1,665,733.44
ALLEGHANY CORPORATION	689	608.99	419,594.11
ALLSTATE CORP	16,654	104.86	1,746,338.44
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	107.92	381,928.88
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	43.27	1,936,116.15
AON PLC	12,005	229.20	2,751,546.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	35.35	723,826.60
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,895	117.66	1,164,245.70
ASSURANT INC	3,114	125.72	391,492.08
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	45.30	371,414.70
BROWN & BROWN INC	14,036	44.25	621,093.00
CHUBB LTD	23,255	166.38	3,869,166.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	93.80	737,080.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	256.64	330,552.32
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	242.72	501,216.80
FNF GROUP	13,937	39.54	551,068.98
GLOBE LIFE INC	6,040	94.68	571,867.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	50.10	918,383.10
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	54.52	473,070.04
LOEWS CORPORATION	13,914	48.52	675,107.28
MARKEL CORP	702	1,093.90	767,917.80
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	117.68	3,133,230.00
METLIFE INC	41,811	55.41	2,316,747.51
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	54.27	766,509.48
PROGRESSIVE CORP	30,543	86.25	2,634,333.75
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	83.42	1,729,129.76

REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	118.19	357,170.18
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	160.59	490,120.68
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	148.45	1,948,554.70
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	67.88	504,212.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	229.89	1,568,539.47
CBRE GROUP INC-A	18,244	69.72	1,271,971.68
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.58	239,534.00
ACCENTURE PLC-CL A	33,228	258.78	8,598,741.84
ADOBE INC	25,053	491.23	12,306,785.19
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	101.95	848,325.95
ANSYS INC	4,470	393.90	1,760,733.00
AUTODESK INC	11,506	302.52	3,480,795.12
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,463	167.13	3,754,241.19
AVALARA INC	4,319	171.21	739,455.99
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	80.29	612,050.67
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	80.70	647,940.30
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	147.43	868,215.27
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	141.78	2,020,365.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	95.90	669,286.10
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,930	116.92	693,335.60
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	134.08	870,179.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,105	84.40	684,062.00
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,737	76.43	2,196,368.91
COUPA SOFTWARE INC	3,490	359.75	1,255,527.50
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,411	238.56	1,767,968.16
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	152.89	314,188.95
DATADOG INC - CLASS A	7,981	103.08	822,681.48
DOCUSIGN INC	9,078	254.98	2,314,708.44
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	24.10	399,674.40
DYNATRACE INC	11,194	52.50	587,685.00
EPAM SYSTEMS INC	3,128	391.70	1,225,237.60
FAIR ISAAC CORP	1,494	469.24	701,044.56
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,954	132.99	4,382,552.46
FISERV INC	29,729	111.07	3,302,000.03
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	271.99	1,188,868.29
FORTINET INC	7,360	166.23	1,223,452.80
GARTNER INC	4,568	178.24	814,200.32
GLOBAL PAYMENTS INC	15,685	192.85	3,024,852.25
GODADDY INC - CLASS A	8,905	83.06	739,649.30
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	125.33	592,936.23
HUBSPOT INC	2,275	523.33	1,190,575.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	47,134	119.97	5,654,665.98

INTUIT INC	13,620	415.81	5,663,332.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	148.88	582,865.20
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	105.48	732,769.56
MASTERCARD INC-CL A	46,656	337.33	15,738,468.48
MICROSOFT CORP	375,814	244.20	91,773,778.80
MONGODB INC	2,659	410.80	1,092,317.20
NORTONLIFELOCK INC	31,347	21.15	662,989.05
OKTA INC	6,306	284.09	1,791,471.54
ORACLE CORPORATION	105,407	62.09	6,544,720.63
PALO ALTO NETWORKS INC	5,221	395.42	2,064,487.82
PAYCHEX INC	15,878	89.18	1,416,000.04
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	391.75	987,993.50
PAYPAL HOLDINGS INC	58,574	297.20	17,408,192.80
PTC INC	5,462	144.19	787,565.78
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	420.38	1,678,156.96
SALESFORCE.COM, INC.	47,267	247.66	11,706,145.22
SERVICENOW INC	10,018	580.94	5,819,856.92
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	18,528	43.46	805,226.88
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,505	288.78	434,613.90
SPLUNK INC	8,252	170.50	1,406,966.00
SQUARE INC-A	18,945	270.94	5,132,958.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	65.99	761,920.54
SYNOPSYS INC	7,869	283.76	2,232,907.44
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	2,140	844.42	1,807,058.80
TWILIO INC-A	6,861	411.65	2,824,330.65
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	469.04	945,584.64
VERISIGN INC	5,227	199.11	1,040,747.97
VISA INC	88,435	207.51	18,351,146.85
VMWARE INC	4,194	141.31	592,654.14
WESTERN UNION COMPANY	21,840	23.87	521,320.80
WIX.COM LTD	2,840	302.16	858,134.40
WORKDAY INC-CLASS A	9,080	271.05	2,461,134.00
ZENDESK INC	6,067	153.43	930,859.81
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,094	429.42	3,905,145.48
ZSCALER INC	3,322	224.83	746,885.26
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,698	133.97	2,103,061.06
APPLE INC	893,253	130.84	116,873,222.52
ARISTA NETWORKS INC	2,699	312.21	842,654.79
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	106.51	439,886.30
CDW CORP/DE	7,404	157.86	1,168,795.44
CISCO SYSTEMS INC	220,528	46.25	10,199,420.00
COGNEX CORP	8,698	87.14	757,943.72

CORNING INC	39,709	37.89	1,504,574.01
DELL TECHNOLOGIES INC-C	12,602	79.26	998,834.52
F5 NETWORKS INC	2,909	204.14	593,843.26
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	14.00	894,334.00
HP INC	73,161	26.28	1,922,671.08
IPG PHOTONICS CORP	1,776	237.59	421,959.84
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	24.20	422,532.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	149.06	1,422,330.52
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,241	181.79	1,679,921.39
NETAPP INC	10,919	68.24	745,112.56
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	71.41	902,193.94
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	129.71	2,260,196.75
TRIMBLE INC	12,759	72.48	924,772.32
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	67.30	999,876.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	479.58	1,312,610.46
AT&T INC	370,085	29.57	10,943,413.45
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	26.17	220,665.44
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	25.98	547,632.42
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	11.77	585,651.66
T-MOBILE US INC	29,019	121.30	3,520,004.70
VERIZON COMMUNICATIONS INC	216,128	56.99	12,317,134.72
AES CORPORATION	33,656	28.76	967,946.56
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	48.22	583,570.72
AMEREN CORPORATION	12,454	73.30	912,878.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	78.49	2,019,312.23
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	160.78	1,471,780.12
ATMOS ENERGY CORP	6,965	92.43	643,774.95
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	21.53	548,239.92
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	55.83	783,853.20
CONSOLIDATED EDISON INC	18,551	70.16	1,301,538.16
DOMINION ENERGY INC	44,161	72.39	3,196,814.79
DTE ENERGY COMPANY	10,496	120.15	1,261,094.40
DUKE ENERGY CORP	37,896	89.20	3,380,323.20
EDISON INTERNATIONAL	18,856	56.49	1,065,175.44
ENERGY CORP	10,866	93.19	1,012,602.54
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,567	45.39	479,636.13
EVERGY INC	11,273	54.80	617,760.40
EVERSOURCE ENERGY	17,557	82.34	1,445,643.38
EXELON CORP	50,837	42.17	2,143,796.29
FIRSTENERGY CORP	26,948	31.95	860,988.60
NEXTERA ENERGY INC	103,187	80.68	8,325,127.16
NISOURCE INC	18,919	22.67	428,893.73

	NRG ENERGY INC	13,547	39.77	538,764.19	
	OGE ENERGY CORP	11,870	31.76	376,991.20	
	P G & E CORPORATION	76,538	11.71	896,259.98	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	77.15	462,591.40	
	PPL CORPORATION	42,841	28.07	1,202,546.87	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,717	58.01	1,607,863.17	
	SEMPRA ENERGY	15,304	124.61	1,907,031.44	
	SOUTHERN CO	55,514	59.27	3,290,314.78	
	UGI CORPORATION	10,588	40.25	426,167.00	
	VISTRA CORP	25,777	22.01	567,351.77	
	WEC ENERGY GROUP INC	16,438	82.03	1,348,409.14	
	XCEL ENERGY INC	26,959	60.90	1,641,803.10	
	ADVANCED MICRO DEVICES	62,122	89.94	5,587,252.68	
	ANALOG DEVICES INC	19,298	159.75	3,082,855.50	
	APPLIED MATERIALS INC	48,420	115.71	5,602,678.20	
	BROADCOM INC	21,006	482.48	10,134,974.88	
	ENPHASE ENERGY INC	6,292	189.34	1,191,327.28	
	INTEL CORP	222,131	61.85	13,738,802.35	
	KLA CORPORATION	8,157	330.30	2,694,257.10	
	LAM RESEARCH CORP	7,581	585.91	4,441,783.71	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,976	50.40	1,762,790.40	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	95.63	1,321,032.82	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,745	163.05	2,078,072.25	
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,027	86.05	4,993,223.35	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	380.28	852,968.04	
	NVIDIA CORP	32,367	596.24	19,298,500.08	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	189.69	2,742,348.33	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	41.08	859,064.96	
	QORVO INC	6,042	174.61	1,054,993.62	
	QUALCOMM INC	58,929	144.75	8,529,972.75	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	192.09	1,682,132.13	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	334.80	881,863.20	
	TERADYNE INC	8,542	139.30	1,189,900.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	47,839	178.53	8,540,696.67	
	XILINX INC	12,876	139.32	1,793,884.32	
	米ドル 小計	16,291,244		1,819,193,668.85 (192,361,538,544)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,696	21.24	567,023.04	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,883	35.20	2,107,881.60	
	CENOVUS ENERGY INC	81,654	8.81	719,371.74	
	ENBRIDGE INC	106,452	43.81	4,663,662.12	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	26.69	346,943.31	

INTER PIPELINE LTD	19,394	17.51	339,588.94
KEYERA CORP	11,374	26.09	296,747.66
PARKLAND CORP	7,666	37.66	288,701.56
PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	35.46	971,994.06
SUNCOR ENERGY INC	78,642	24.18	1,901,563.56
TC ENERGY CORP	47,323	56.55	2,676,115.65
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	13,447	78.28	1,052,631.16
B2GOLD CORP	42,963	6.14	263,792.82
BARRICK GOLD CORP	93,098	26.41	2,458,718.18
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	66.15	434,142.45
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	25.98	822,838.56
FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	145.22	1,476,161.30
KINROSS GOLD CORP	63,501	8.68	551,188.68
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,593	45.78	713,847.54
LUNDIN MINING CORP	28,209	14.00	394,926.00
NUTRIEN LTD	29,898	70.90	2,119,768.20
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	40.40	475,225.20
SSR MINING INC	11,552	19.35	223,531.20
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	26.32	653,104.48
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	89.50	397,201.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,117	48.26	1,163,886.42
YAMANA GOLD INC	53,588	5.80	310,810.40
CAE INC	12,891	31.71	408,773.61
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	89.85	345,293.55
WSP GLOBAL INC	6,141	116.23	713,768.43
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	36.99	366,681.87
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	72.91	413,180.97
THOMSON REUTERS CORP	10,122	104.21	1,054,813.62
AIR CANADA	5,737	23.56	135,163.72
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,737	138.28	5,218,272.36
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	461.44	3,283,145.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	99.06	1,422,897.84
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	35.01	317,400.66
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	75.48	1,095,214.80
QUEBECOR INC -CL B	9,953	32.02	318,695.06
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	22.44	611,086.08
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,001	175.97	528,085.97
DOLLARAMA INC	17,025	47.85	814,646.25
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	44,270	38.80	1,717,676.00
EMPIRE CO LTD A	9,148	36.87	337,286.76
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	62.18	539,908.94
METRO INC	13,109	54.00	707,886.00

WESTON (GEORGE) LTD	4,281	95.33	408,107.73	
SAPUTO INC	13,425	37.86	508,270.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	19,380	40.66	787,990.80	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	51.61	580,664.11	
BANK OF MONTREAL	33,057	99.37	3,284,874.09	
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	71.00	4,494,797.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	114.02	2,680,952.26	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	73.99	1,257,312.07	
ROYAL BANK OF CANADA	75,237	107.37	8,078,196.69	
TORONTO-DOMINION BANK	92,906	75.51	7,015,332.06	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,755	55.84	3,671,759.20	
CI FINANCIAL CORP	11,041	18.38	202,933.58	
IGM FINANCIAL INC	6,433	35.08	225,669.64	
ONEX CORPORATION	4,217	73.25	308,895.25	
TMX GROUP LTD	3,142	126.66	397,965.72	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	521.87	726,964.91	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	31.32	444,744.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	63.80	309,493.80	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	145.60	1,027,644.80	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	25.08	2,503,234.80	
POWER CORP OF CANADA	32,335	30.76	994,624.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	32,103	61.60	1,977,544.80	
FIRSTSERVICE CORP	1,820	190.26	346,273.20	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	14.37	373,519.41	
CGI INC-CL A	12,634	99.28	1,254,303.52	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,686.95	1,730,810.70	
OPEN TEXT CORPORATION	13,665	59.64	814,980.60	
SHOPIFY INC-CLASS A	5,623	1,804.18	10,144,904.14	
BCE INC	8,379	55.89	468,302.31	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	20,136	56.57	1,139,093.52	
TELUS CORPORATION	15,222	26.33	400,795.26	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	21.98	689,270.82	
ALTAGAS LTD	17,347	19.84	344,164.48	
ATCO LTD-CLASS I	3,030	38.22	115,806.60	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	61.53	389,854.08	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	32.08	235,595.52	
EMERA INC	14,279	51.12	729,942.48	
FORTIS INC	24,171	51.40	1,242,389.40	
HYDRO ONE LTD	15,052	28.46	428,379.92	
NORTHLAND POWER INC	8,016	48.72	390,539.52	
カナダドル 小計	2,081,522		111,868,142.81 (9,317,497,614)	



ユーロ	ENI SPA	139,208	9.16	1,275,562.90
	GALP ENERGIA SGPS S.A	22,025	9.57	210,955.45
	NESTE OYJ	22,153	57.58	1,275,569.74
	OMV AG	6,939	39.30	272,702.70
	REPSOL SA	81,853	9.45	774,001.96
	TENARIS S.A.	25,963	7.37	191,399.23
	TOTAL SE	130,580	36.96	4,826,889.70
	VOPAK	3,130	42.24	132,211.20
	AIR LIQUIDE SA	25,186	133.55	3,363,590.30
	AKZO NOBEL	10,399	85.90	893,274.10
	ARCELORMITTAL	36,689	19.58	718,517.37
	ARKEMA	3,250	91.46	297,245.00
	BASF SE	48,579	67.16	3,262,565.64
	COVESTRO AG	9,346	58.96	551,040.16
	CRH PLC	41,091	36.45	1,497,766.95
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	27.84	304,903.68
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	48.14	162,231.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,440	63.40	535,096.00
	KONINKLIJKE DSM NV	8,994	145.75	1,310,875.50
	LANXESS	4,409	62.90	277,326.10
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	41.52	536,479.92
	SOLVAY SA	3,758	96.20	361,519.60
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	16.44	497,198.13
	SYMRISE AG	6,524	102.00	665,448.00
	UMICORE	10,560	47.03	496,636.80
	UPM-KYMMENE OYJ	28,055	32.44	910,104.20
	VOESTALPINE AG	6,056	31.56	191,127.36
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,716	25.25	396,829.00
	AIRBUS SE	30,165	93.90	2,832,493.50
	ALSTOM RGPT	11,800	41.62	491,116.00
	BOUYGUES SA	11,049	34.46	380,748.54
	BRENTAG SE	7,392	65.32	482,845.44
	CNH INDUSTRIAL NV	54,775	11.94	654,013.50
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	28,528	42.29	1,206,449.12
	DASSAULT AVIATION SA	172	918.00	157,896.00
	EIFFAGE SA	4,989	81.78	408,000.42
	FERROVIAL SA	24,212	20.08	486,176.96
	GEA GROUP AG	8,178	30.08	245,994.24
	HOCHTIEF AG	1,931	76.30	147,335.30
	KINGSPAN GROUP PLC	7,215	54.65	394,299.75
KION GROUP AG	3,179	75.38	239,633.02	
KNORR-BREMSE AG	3,881	107.42	416,897.02	

KONE OYJ-B	17,618	68.24	1,202,252.32
LEGRAND SA	13,323	75.00	999,225.00
MTU AERO ENGINES AG	2,957	198.30	586,373.10
PRYSMIAN SPA	14,105	27.90	393,529.50
RATIONAL AG	344	804.00	276,576.00
SAFRAN SA	17,312	111.00	1,921,632.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,924	127.05	3,547,744.20
SIEMENS AG-REG	40,114	130.78	5,246,108.92
SIEMENS ENERGY AG	19,855	33.10	657,200.50
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	34.33	394,177.06
THALES SA	5,403	77.64	419,488.92
VINCI S.A.	27,668	85.24	2,358,420.32
WARTSILA OYJ-B SHARES	26,753	8.36	223,655.08
BUREAU VERITAS SA	17,817	22.27	396,784.59
RANDSTAD NV	5,367	54.56	292,823.52
TELEPERFORMANCE	2,970	286.50	850,905.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	70.16	1,022,792.48
AENA SME SA	3,556	132.40	470,814.40
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	96.80	130,292.80
ATLANTIA SPA	26,501	15.30	405,597.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	10.94	181,319.56
DEUTSCHE POST AG-REG	51,345	42.30	2,171,893.50
GETLINK	22,311	13.46	300,306.06
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	70.86	1,266,480.78
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	4,110	55.90	229,749.00
CONTINENTAL AG	5,578	118.05	658,482.90
DAIMLER AG	44,402	65.44	2,905,666.88
FAURECIA	3,127	45.38	141,903.26
FERRARI NV	6,452	166.00	1,071,032.00
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	116.25	1,016,722.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	60.24	467,763.60
RENAULT SA	8,830	39.49	348,696.70
STELLANTIS NV	105,516	13.21	1,393,866.36
VALEO SA	14,048	32.40	455,155.20
VOLKSWAGEN AG	1,984	182.10	361,286.40
VOLKSWAGEN AG PFD	9,869	161.38	1,592,659.22
ADIDAS AG	9,675	290.90	2,814,457.50
ESSILORLUXOTTICA	14,521	136.95	1,988,650.95
HERMES INTERNATIONAL	1,676	930.40	1,559,350.40
KERING	3,983	524.90	2,090,676.70
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,621	535.00	7,822,235.00
MONCLER SPA	10,437	50.64	528,529.68

PUMA SE	5,052	85.86	433,764.72
SEB SA	1,025	164.10	168,202.50
ACCOR SA	10,451	31.04	324,399.04
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,841	159.70	1,411,907.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	36.98	213,929.30
SODEXO	3,900	76.00	296,400.00
BOLLORE	39,433	4.10	161,754.16
PUBLICIS GROUPE	10,736	47.51	510,067.36
SCOUT24 AG	5,610	66.40	372,504.00
SES	25,036	6.89	172,648.25
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	4,745	73.28	347,713.60
VIVENDI SA	41,661	30.25	1,260,245.25
DELIVERY HERO SE	6,675	124.00	827,700.00
HELLOFRESH AG	8,096	71.90	582,102.40
INDITEX	55,025	25.85	1,422,396.25
JUST EAT TAKEAWAY	6,355	87.04	553,139.20
PROSUS NV	25,646	109.05	2,796,696.30
ZALANDO SE	7,911	95.72	757,240.92
CARREFOUR SA	27,456	14.72	404,152.32
COLRUYT NV	2,870	50.66	145,394.20
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	14,348	13.32	191,115.36
KESKO OYJ-B SHS	13,402	21.80	292,163.60
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	23.04	1,369,774.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,567	53.31	2,109,316.77
DANONE	32,081	55.88	1,792,686.28
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	9.76	273,597.04
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	75.00	462,600.00
HEINEKEN NV	13,143	85.88	1,128,720.84
JDE PEET'S BV	2,166	32.70	70,828.20
KERRY GROUP PLC-A	8,193	105.20	861,903.60
PERNOD-RICARD SA	11,112	163.30	1,814,589.60
REMY COINTREAU	1,273	162.30	206,607.90
BEIERSDORF AG	5,138	86.00	441,868.00
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	76.10	454,621.40
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	85.56	773,719.08
L'OREAL	13,145	317.00	4,166,965.00
AMPLIFON SPA	7,567	35.87	271,428.29
BIOMERIEUX	2,637	121.40	320,131.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	134.10	304,272.90
DIASORIN SPA	1,313	183.50	240,935.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	60.98	677,975.64
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	36.06	770,349.78

KONINKLIJKE PHILIPS NV	48,838	47.44	2,316,874.72
ORPEA	2,695	110.80	298,606.00
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	488.40	881,073.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	47.59	674,992.29
ARGENX SE	2,330	302.20	704,126.00
BAYER AG	50,652	53.98	2,734,194.96
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	81.57	571,805.70
GALAPAGOS NV	2,318	69.98	162,213.64
GRIFOLS S.A.	15,169	22.65	343,577.85
IPSEN	1,498	70.95	106,283.10
MERCK KGAA	6,553	141.10	924,628.30
ORION OYJ	4,159	35.93	149,432.87
QIAGEN N.V.	12,543	45.46	570,204.78
RECORDATI SPA	4,578	44.00	201,432.00
SANOFI	58,854	78.78	4,636,518.12
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	412.00	640,660.00
UCB SA	6,623	86.42	572,359.66
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	9.12	172,627.41
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	4.44	1,569,650.27
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	893,341	2.89	2,585,775.52
BNP PARIBAS	58,640	47.65	2,794,196.00
CAIXABANK	181,981	2.33	425,289.59
COMMERZBANK AG	46,644	5.24	244,601.13
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	11.18	650,295.90
ERSTE GROUP BANK AG	14,968	26.76	400,543.68
FINECOBANK SPA	32,034	14.90	477,306.60
ING GROEP NV-CVA	205,237	8.92	1,831,740.22
INTESA SANPAOLO	852,114	2.09	1,786,030.94
KBC GROUPE SA	13,049	58.68	765,715.32
MEDIOBANCA SPA	24,371	9.02	219,875.16
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,034	16.98	119,437.32
SOCIETE GENERALE	41,025	19.06	781,936.50
UNICREDIT SPA	112,845	8.30	936,613.50
AMUNDI SA	3,955	65.90	260,634.50
DEUTSCHE BANK AG -REG	102,459	9.32	954,917.88
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	136.60	1,370,234.60
EURAZEO	1,792	61.65	110,476.80
EXOR NV	6,204	65.32	405,245.28
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	83.96	496,539.44
NATIXIS	45,362	4.05	183,716.10
SOFINA	804	289.50	232,758.00

WENDEL	1,082	94.85	102,627.70
AEGON NV	91,609	3.86	353,977.17
AGEAS	8,765	45.68	400,385.20
ALLIANZ SE-REG	21,625	197.86	4,278,722.50
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	15.65	897,078.46
AXA SA	100,473	19.70	1,979,719.99
CNP ASSURANCES	8,978	14.25	127,936.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	141.20	431,789.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,587	233.90	1,774,599.30
NN GROUP NV	14,069	37.31	524,914.39
POSTE ITALIANE SPA	26,562	9.48	251,860.88
SAMPO OYJ-A SHS	25,587	36.87	943,392.69
SCOR SE	10,726	28.00	300,328.00
AROUNDTOWN SA	52,114	5.89	307,159.91
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,850	40.32	760,032.00
LEG IMMOBILIEN AG	3,680	117.86	433,724.80
VONOVIA SE	26,829	54.18	1,453,595.22
ADYEN NV	942	2,160.00	2,034,720.00
AMADEUS IT GROUP SA	23,777	53.82	1,279,678.14
ATOS SE	4,592	66.34	304,633.28
BECHTLE AG	1,435	167.50	240,362.50
CAPGEMINI SA	8,862	135.50	1,200,801.00
DASSAULT SYSTEMES SA	7,023	186.80	1,311,896.40
EDEMRED	12,139	47.36	574,903.04
NEMETSCHKE SE	3,011	56.25	169,368.75
NEXI SPA	20,612	15.88	327,318.56
SAP SE	54,000	104.42	5,638,680.00
TEAMVIEWER AG	9,059	48.64	440,629.76
WORLDLINE SA	12,774	77.24	986,663.76
NOKIA OYJ	296,840	3.40	1,009,701.26
CELLNEX TELECOM SA	16,378	45.47	744,707.66
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	175,196	14.76	2,585,892.96
ELISA OYJ	6,988	50.70	354,291.60
ILIAD SA	1,016	154.60	157,073.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.21	145,633.86
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.86	496,851.78
ORANGE S.A.	106,132	10.05	1,066,626.60
PROXIMUS SA	9,697	17.76	172,218.72
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.38	187,297.54
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.42	105,830.13
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.39	112,172.84
TELEFONICA S.A.	280,997	3.78	1,063,292.64

	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	38.25	201,539.25
	E.ON SE	116,681	8.78	1,025,392.62
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.95	722,692.23
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	29,644	10.58	313,781.74
	ELIA GROUP SA/NV	1,464	96.00	140,544.00
	ENAGAS	14,471	17.33	250,854.78
	ENDESA S.A.	14,104	21.86	308,313.44
	ENEL SPA	420,487	8.30	3,491,303.56
	ENGIE	94,886	12.98	1,232,094.71
	FORTUM OYJ	24,312	21.64	526,111.68
	IBERDROLA SA	320,809	10.70	3,432,656.30
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	20.72	319,896.08
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	14.91	352,353.12
	RWE AG	32,165	32.89	1,057,906.85
	SNAM SPA	106,707	4.43	472,712.01
	SUEZ	18,986	16.83	319,629.31
	TERNA SPA	78,980	6.04	477,197.16
	UNIPER SE	10,456	29.62	309,706.72
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	22.57	644,621.77
	VERBUND AG	3,744	69.95	261,892.80
	ASML HOLDING NV	22,313	484.35	10,807,301.55
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	66,553	35.23	2,344,662.19
	STMICROELECTRONICS NV	33,261	34.44	1,145,508.84
	ユーロ 小計	9,902,963		224,513,556.80 (28,605,272,271)
英債券	BP PLC	1,057,250	2.80	2,966,643.50
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,867	14.38	3,062,304.66
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	197,000	13.76	2,712,296.00
	ANGLO AMERICAN PLC	61,589	27.79	1,711,866.25
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	17.14	333,281.65
	BHP GROUP PLC	110,160	22.44	2,472,541.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,626	65.60	434,665.60
	EVRAZ PLC	28,275	5.29	149,631.30
	FRESNILLO PLC	9,684	9.73	94,225.32
	GLENCORE PLC	538,015	2.88	1,550,559.23
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	30.51	307,357.74
	MONDI PLC	25,128	18.31	460,219.32
	RIO TINTO PLC	59,547	62.35	3,712,755.45
	ASSTEAD GROUP PLC	23,686	38.72	917,121.92
	BAE SYSTEMS PLC	165,753	4.81	798,763.70
	BUNZL PLC	17,064	23.11	394,349.04
	DCC PLC	5,954	59.54	354,501.16

FERGUSON PLC	12,331	86.84	1,070,824.04
MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	1.71	422,242.18
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	389,579	1.02	398,539.31
SMITHS GROUP PLC	24,168	14.85	358,894.80
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	116.70	430,039.50
EXPERIAN PLC	48,895	26.10	1,276,159.50
INTERTEK GROUP PLC	8,184	58.84	481,546.56
RELX PLC	100,974	18.30	1,847,824.20
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.14	465,799.48
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	6.80	317,519.20
BURBERRY GROUP PLC	23,066	18.60	429,027.60
PERSIMMON PLC	16,916	27.59	466,712.44
TAYLOR WIMPEY PLC	158,662	1.60	254,731.84
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	43.36	311,628.32
COMPASS GROUP PLC	93,018	14.48	1,346,900.64
ENTAIN PLC	28,865	13.47	388,955.87
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,790	50.06	389,967.40
WHITBREAD PLC	11,282	33.66	379,752.12
AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	5.93	260,735.12
INFORMA PLC	78,152	5.10	399,044.11
PEARSON PLC	39,623	7.58	300,421.58
WPP PLC	63,987	8.30	531,476.02
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	8.31	239,884.32
KINGFISHER PLC	109,678	2.75	302,053.21
NEXT PLC	6,860	77.50	531,650.00
OCADO GROUP PLC	27,379	25.93	709,937.47
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.31	261,277.22
TESCO PLC	399,930	2.37	950,433.64
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.73	253,717.72
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	23.08	387,074.68
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	119,386	26.40	3,151,790.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	23.44	204,021.76
DIAGEO PLC	120,446	30.46	3,668,785.16
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	15.05	752,545.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	62.84	2,349,273.40
UNILEVER PLC	137,324	39.80	5,465,495.20
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	15.67	695,264.62
ASTRAZENECA PLC	68,540	74.21	5,086,353.40
GLAXOSMITHKLINE PLC	263,731	12.76	3,366,262.48
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	23.92	181,337.52
BARCLAYS PLC	904,741	1.54	1,396,558.20

	HSBC HOLDINGS PLC	1,076,526	4.32	4,653,283.63
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.38	1,462,227.74
	NATWEST GROUP PLC	245,244	1.78	436,902.18
	STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.97	729,140.97
	3I GROUP PLC	49,338	11.56	570,593.97
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	15.39	301,310.94
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,810	98.10	1,550,961.00
	M&G PLC	133,064	1.87	249,228.87
	SCHRODERS PLC	6,213	35.49	220,499.37
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	12.05	315,322.63
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	3.23	398,139.49
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	30.60	352,971.00
	AVIVA PLC	198,601	3.61	718,141.21
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.12	197,714.83
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.66	835,528.96
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	21,914	7.13	156,290.64
	PRUDENTIAL PLC	140,314	13.99	1,962,992.86
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	6.76	353,618.79
	AVEVA GROUP PLC	6,037	38.38	231,700.06
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	5.96	333,794.49
	HALMA PLC	19,839	25.19	499,744.41
	BT GROUP PLC	469,907	1.29	610,174.23
	VODAFONE GROUP PLC	1,442,387	1.32	1,914,047.54
	NATIONAL GRID PLC	182,788	8.64	1,580,385.04
	SEVERN TRENT PLC	12,418	23.34	289,836.12
	SSE PLC	55,879	14.28	797,952.12
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	9.34	310,286.20
	英ポンド 小計	15,384,995		86,948,369.11 (12,754,456,264)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	19.16	193,535.16
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	875.00	311,500.00
	GIVAUDAN-REG	484	3,562.00	1,724,008.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	49.41	1,345,878.99
	SIKA AG	7,399	249.80	1,848,270.20
	ABB LTD	95,025	26.26	2,495,356.50
	GEBERIT AG-REG	1,986	551.80	1,095,874.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	243.60	229,227.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	246.10	524,685.20
	ADECCO GROUP AG-REG	8,786	57.18	502,383.48
	SGS SA	308	2,745.00	845,460.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,618	207.90	544,282.20
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,855	87.66	2,441,769.30



	THE SWATCH GROUP AG-B	1,257	263.90	331,722.30
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	51.00	128,316.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	1,990.00	286,560.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	8,205.00	484,095.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	85,900.00	429,500.00
	NESTLE SA-REGISTERED	150,922	100.36	15,146,531.92
	ALCON INC	26,585	65.00	1,728,025.00
	SONOVA HOLDING AG	2,660	238.00	633,080.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	475	1,135.00	539,125.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	609.40	2,427,849.60
	NOVARTIS AG-REG SHS	115,968	80.80	9,370,214.40
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,790	308.10	11,334,999.00
	VIFOR PHARMA AG	2,638	117.10	308,909.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	99.10	155,587.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	126,713	12.70	1,609,255.10
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,925	54.30	701,827.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	1,102.00	1,072,246.00
	UBS GROUP AG	191,189	13.98	2,672,822.22
	BALOISE HOLDING AG	2,475	155.20	384,120.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,421	439.20	624,103.20
	SWISS RE AG	15,168	83.38	1,264,707.84
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,733	376.30	2,909,927.90
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	88.15	344,313.90
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,063	107.80	437,991.40
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,150	102.65	836,597.50
	SWISSCOM AG-REG	1,399	468.00	654,732.00
	スイスフラン 小計	906,918		70,919,391.01 (8,350,049,097)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	262.20	2,249,938.20
	BOLIDEN AB	13,086	313.00	4,095,918.00
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	34,370	151.65	5,212,210.50
	ALFA LAVAL AB	13,939	251.00	3,498,689.00
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	217.10	11,315,034.90
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	492.70	16,965,631.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	421.60	8,342,199.20
	EPIROC AB-A	34,230	174.00	5,956,020.00
	EPIROC AB-B	24,667	157.85	3,893,685.95
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,951	204.00	1,010,004.00
	NIBE INDUSTRIER-B	18,441	290.80	5,362,642.80
	SANDVIK AB	61,070	218.50	13,343,795.00
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	205.30	3,527,669.90
	SKF AB-B SHARES	20,607	223.20	4,599,482.40

	VOLVO AB-B SHS	71,792	212.10	15,227,083.20	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	125.00	2,015,375.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,098	206.60	3,119,246.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	102.30	1,902,063.90	
	EVOLUTION GAMING GROUP	7,578	1,057.00	8,009,946.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	42,837	185.05	7,926,986.85	
	ICA GRUPPEN AB	5,614	415.30	2,331,494.20	
	SWEDISH MATCH AB	8,464	606.80	5,135,955.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,701	263.60	8,619,983.60	
	NORDEA BANK ABP	167,942	75.06	12,605,726.52	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	96.30	8,504,927.10	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	85.96	6,676,341.28	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	146.84	6,743,039.64	
	EQT AB	15,614	251.60	3,928,482.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,396	287.60	976,689.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	274.40	2,920,164.80	
	INVESTOR AB-B SHS	23,614	634.20	14,975,998.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	12,465	417.70	5,206,630.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	431.60	1,453,628.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	408.00	2,171,784.00	
	ERICSSON LM-B SHS	153,422	109.55	16,807,380.10	
	HEXAGON AB-B SHS	14,730	722.40	10,640,952.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	109.10	2,786,086.70	
	TELIA CO AB	128,045	35.14	4,499,501.30	
	スウェーデンクローナ 小計	1,352,269		244,558,389.94 (3,110,782,720)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	51,871	156.30	8,107,437.30	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	43.01	2,767,435.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	414.50	3,732,572.50	
	ADEVINTA ASA-B	11,815	129.90	1,534,768.50	
	SCHIBSTED ASA	1,709	353.40	603,960.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	296.20	1,623,176.00	
	MOWI ASA	22,242	190.90	4,245,997.80	
	ORKLA ASA	37,292	80.00	2,983,360.00	
	DNB ASA	49,048	168.00	8,240,064.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,596	203.80	2,770,864.80	
	TELENOR ASA	37,498	141.45	5,304,092.10	
	ノルウェークローネ 小計	303,900		41,913,729.04 (522,245,063)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	566.40	3,120,297.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	400.00	4,604,800.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S	205	2,270.00	465,350.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,488	1,335.50	14,006,724.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	11,700.00	1,965,600.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	311	12,690.00	3,946,590.00
	DSV PANALPINA A S	10,873	1,129.00	12,275,617.00
	PANDORA A/S	4,763	611.40	2,912,098.20
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,009.50	5,638,057.50
	AMBU A/S-B	8,356	309.50	2,586,182.00
	COLOPLAST-B	6,399	1,008.50	6,453,391.50
	DEMANT A/S	4,455	262.90	1,171,219.50
	GN STORE NORD A/S	7,299	543.40	3,966,276.60
	GENMAB A/S	3,317	2,503.00	8,302,451.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	255.90	741,086.40
	NOVO NORDISK A/S-B	89,680	466.10	41,799,848.00
	DANSKE BANK A/S	40,189	112.70	4,529,300.30
	TRYG A/S	5,752	200.40	1,152,700.80
	ORSTED A/S	10,279	1,031.00	10,597,649.00
	デンマーククローネ 小計	228,036		130,235,239.40 (2,230,929,650)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	10,927	27.32	298,525.64
	OIL SEARCH LTD	105,618	4.31	455,213.58
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,448	4.60	503,460.80
	SANTOS LTD	84,586	7.04	595,485.44
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	29.53	156,331.82
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	25.96	1,307,189.84
	BHP GROUP LTD	153,209	48.60	7,445,957.40
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	18.19	419,988.91
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.21	355,408.20
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	92,105	24.41	2,248,283.05
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,266	40.70	906,226.20
	NEWCREST MINING LIMITED	42,131	24.52	1,033,052.12
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	38,584	10.74	414,392.16
	ORICA LIMITED	17,981	15.24	274,030.44
	RIO TINTO LIMITED	19,336	127.47	2,464,759.92
	SOUTH32 LTD	280,961	2.71	761,404.31
	CIMIC GROUP LTD	4,062	20.95	85,098.90
	BRAMBLES LIMITED	74,638	10.58	789,670.04
	AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.96	373,982.40
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	4.73	216,780.63
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	33.34	1,025,171.66
	CROWN RESORTS LTD	21,863	9.69	211,852.47
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	112,817	4.41	497,522.97
	REA GROUP LTD	2,833	154.36	437,301.88

	SEEK LIMITED	16,730	30.80	515,284.00
	WESFARMERS LIMITED	57,250	54.15	3,100,087.50
	COLES GROUP LIMITED	70,782	17.20	1,217,450.40
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	39.41	2,585,571.87
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,639	13.37	356,163.43
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	10.14	369,744.96
	COCHLEAR LIMITED	3,798	204.36	776,159.28
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	62.28	588,296.88
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	33.58	707,899.98
	CSL LIMITED	23,602	281.17	6,636,174.34
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	148,002	25.82	3,821,411.64
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	93,590	84.28	7,887,765.20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	172,940	25.60	4,427,264.00
	WESTPAC BANKING CORPORATION	189,179	23.54	4,453,273.66
	AMP LIMITED	223,504	1.38	308,435.52
	ASX LTD	11,180	69.78	780,140.40
	MACQUARIE GROUP LTD	17,336	145.67	2,525,335.12
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	47.49	274,634.67
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	5.14	602,341.18
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.82	363,001.68
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	85,523	8.76	749,181.48
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	10.24	654,673.92
	AFTERPAY LTD	11,190	147.77	1,653,546.30
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	14.18	396,572.06
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	31.69	250,636.21
	XERO LTD	6,090	127.86	778,667.40
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.31	718,081.33
	TPG TELECOM LTD	17,758	7.26	128,923.08
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	10.36	336,617.12
	AUSNET SERVICES	85,220	1.69	144,447.90
	オーストラリアドル 小計	3,521,391		71,384,873.29 (5,855,701,155)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	6.97	492,855.67
	A2 MILK CO LTD	37,422	10.98	410,893.56
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	32,833	32.25	1,058,864.25
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	16,347	15.80	258,282.60
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	89,712	4.64	416,712.24
	MERCURY NZ LTD	31,947	6.60	210,850.20
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,872	6.15	417,412.80
	ニュージーランドドル 小計	346,844		3,265,871.32 (248,434,831)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	150,924	55.55	8,383,828.20

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	130.20	9,179,100.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	64,000	22.50	1,440,000.00	
	MTR CORPORATION	84,500	44.95	3,798,275.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	69.80	8,236,400.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	36.15	4,193,400.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	10.20	816,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	14.92	1,056,336.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	26.95	2,414,720.00	
	WH GROUP LIMITED	534,500	6.53	3,490,285.00	
	BANK OF EAST ASIA	38,420	18.66	716,917.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	24.25	4,546,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	152.00	5,897,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,900	563.50	35,444,150.00	
	AIA GROUP LTD	635,000	105.60	67,056,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,924	41.20	5,764,868.80	
	ESR CAYMAN LTD	64,600	28.25	1,824,950.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	21.85	2,141,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	32.20	2,684,964.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	37.40	3,172,754.20	
	SINO LAND CO	118,200	11.62	1,373,484.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	111.00	7,548,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	55.20	1,490,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	23.75	1,258,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	48.85	4,982,700.00	
	PCCW LIMITED	256,000	4.53	1,159,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	42.95	1,288,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	72.20	6,144,220.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	125,000	7.58	947,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	607,514	11.06	6,719,104.84	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	41.45	2,963,675.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	19,300	125.00	2,412,500.00	
	香港ドル 小計	4,374,799		210,547,238.04 (2,871,864,326)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	5.12	357,888.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	76,100	3.77	286,897.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	4.39	342,270.74	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.85	278,375.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	5.49	566,568.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	95,000	26.00	2,470,000.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	171,500	10.65	1,826,475.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,700	23.95	1,405,865.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.95	425,860.00	

	CAPITALAND LTD	136,600	3.15	430,290.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.20	185,760.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.36	159,712.00	
	VENTURE CORP LTD	11,500	20.28	233,220.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,115	2.40	1,029,876.00	
	シンガポールドル 小計	1,647,381		9,999,056.74 (796,624,850)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	19.43	557,854.73	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	461.00	640,329.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	23.75	1,577,071.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	20.43	1,433,164.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	12.57	687,252.18	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	80.12	741,029.88	
	AZRIELI GROUP	2,140	204.00	436,560.00	
	NICE LTD	3,251	867.30	2,819,592.30	
	イスラエルシュケル 小計	235,967		8,892,853.84 (288,039,535)	
	合 計	56,578,229		267,313,435,920 (267,313,435,920)	

(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	69.6%	72.0%
カナダドル	株式 87銘柄	3.4%	3.5%
ユーロ	株式 233銘柄	10.3%	10.7%
英ポンド	株式 86銘柄	4.6%	4.8%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.0%	3.1%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	1.1%	1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	2.1%	2.2%
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 32銘柄	1.0%	1.1%
シンガポールドル	株式 14銘柄	0.3%	0.3%
イスラエルシュケル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	414,795.92	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,496	1,101,072.00	

AMERICAN TOWER CORP	23,040	5,214,182.40	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,936	542,864.96	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	1,314,576.00	
BOSTON PROPERTIES INC	7,835	726,696.25	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	515,004.12	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	22,634	3,692,284.42	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,002	1,936,196.56	
DUKE REALTY CORP	21,213	874,399.86	
EQUINIX INC	4,655	3,232,571.65	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	538,380.96	
EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,315,203.06	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	888,877.64	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,164	725,995.92	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	871,306.80	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	588,330.54	
INVITATION HOMES INC	27,735	841,757.25	
IRON MOUNTAIN INC	14,204	465,038.96	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	697,690.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	796,021.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,364	382,638.88	
PROLOGIS INC	38,832	4,109,590.56	
PUBLIC STORAGE	8,249	1,930,843.43	
REALTY INCOME CORPORATION	17,798	1,099,204.48	
REGENCY CENTERS CORP	8,289	441,057.69	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	1,535,556.96	
SIMON PROPERTY GROUP INC	17,748	1,920,866.04	
SUN COMMUNITIES INC	5,064	756,359.04	
UDR INC	16,633	703,575.90	
VENTAS INC	19,379	981,352.56	
VEREIT INC	10,854	404,094.42	
VICI PROPERTIES INC	30,786	840,765.66	
VORNADO REALTY TRUST	8,706	323,340.84	
WELLTOWER INC	21,015	1,414,099.35	
WEYERHAEUSER CO	38,940	1,330,190.40	
WP CAREY INC	8,640	592,876.80	
米ドル 小計	653,435	46,059,660.08	(4,870,348,456)
カナダドル			
CAN APARTMENT PROP	3,971	201,647.38	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	133,714.77	
カナダドル 小計	11,412	335,362.15	(27,932,313)

ユーロ	COVIVIO	2,388	154,742.40
	GECINA SA	2,189	262,242.20
	KLEPIERRE	9,305	172,142.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,962	459,407.40
ユーロ 小計		21,844	1,048,534.50 (133,593,780)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	211,231.47
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	253,595.68
	SEGRO PLC	59,874	579,340.82
英ポンド 小計		144,697	1,044,167.97 (153,168,999)
オーストラリアドル	APA GROUP	61,505	572,611.55
	DEXUS	54,256	467,144.16
	GOODMAN GROUP	86,301	1,501,637.40
	GPT GROUP	97,296	425,183.52
	LENLEASE GROUP	36,263	429,716.55
	MIRVAC GROUP	200,053	444,117.66
	SCENTRE GROUP	275,200	765,056.00
	STOCKLAND	127,393	574,542.43
	SYDNEY AIRPORT	73,899	419,746.32
	TRANSURBAN GROUP	149,743	1,922,700.12
	VICINITY CENTRES	250,926	396,463.08
オーストラリアドル 小計		1,412,835	7,918,918.79 (649,588,908)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,064,560.00
	LINK REIT	110,100	7,569,375.00
香港ドル 小計		307,100	9,633,935.00 (131,406,873)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	199,800	611,388.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	238,488	505,594.56
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	215,045.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	267,914.00
	SUNTEC REIT	102,700	151,996.00
シンガポールドル 小計		783,988	1,751,937.56 (139,576,865)
合計			6,105,616,194 (6,105,616,194)

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



通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 37銘柄	1.8%	79.8%
カナダドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.5%
ユーロ	投資証券 4銘柄	0.0%	2.2%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.5%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.2%	10.6%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 5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。

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（2020年 2月18日現在）	（2021年 2月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	658,479,599	564,581,811
金銭信託	251,210,849	-
コール・ローン	16,201,925	74,747,376
国債証券	168,803,691,286	161,033,197,180
派生商品評価勘定	-	1,645,127
未収入金	-	1,858,749,942
未収利息	1,350,042,152	966,326,020
前払費用	47,930,201	13,435,006
流動資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462
資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,061,835
未払金	-	1,323,659,485
未払解約金	160,434,330	188,195,974
未払利息	47	216
その他未払費用	15,491	-
流動負債合計	160,449,868	1,516,917,510
負債合計	160,449,868	1,516,917,510
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	92,850,628,728	85,310,011,496
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	78,116,477,416	77,685,753,456
元本等合計	170,967,106,144	162,995,764,952
純資産合計	170,967,106,144	162,995,764,952
負債純資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,850,628,728口	85,310,011,496口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8413円 (10,000口当たりの純資産額 18,413円)	1口当たり純資産額 1.9106円 (10,000口当たりの純資産額 19,106円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 2月18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)

(2020年 2月18日現在)

該当事項はありません。

(2021年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,332,734,038	-	1,327,984,352	4,749,686
	米ドル	665,806,534	-	664,418,628	1,387,906
	ユーロ	606,880,090	-	603,683,614	3,196,476
	英ポンド	60,047,414	-	59,882,110	165,304
	売建	525,389,746	-	524,056,768	1,332,978
	米ドル	257,373,062	-	257,682,112	309,050
	ユーロ	267,973,664	-	266,331,761	1,641,903
	英ポンド	43,020	-	42,895	125
	合計	1,858,123,784	-	1,852,041,120	3,416,708

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	90,123,282,996円
同期中における追加設定元本額	14,710,317,354円
同期中における一部解約元本額	11,982,971,622円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	21,534,751,681円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	664,752,688円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,805,039,664円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	904,627,912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)	102,371,639円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,195,766円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	32,751,972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)	93,743,791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)	132,988,962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)	74,508,384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)	158,082,820円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,698,330円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	198,310,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	215,945,347円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,467,429円
イオン・バランス戦略ファンド	54,374,494円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	6,620,827円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,973,419円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	60,740,528円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	115,914,254円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	44,168,094円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	20,348,679円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,682,823円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	578,915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)	124,199円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	59,106円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,345,111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>	1,695,045,476円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	66,234,760円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,180,484,834円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,428,874,945円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,285,103,255円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	39,245,451円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,496,233円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	572,400円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	744,253,727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>	121,214,505円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,877,296,919円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,043,606,193円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,627,146円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,979,645,464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)	406,885,833円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,273,388円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,471,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	38,632,744円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	128,196,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	505,626,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	154,651,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,809,310円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,272,010,412円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,121,083円
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>	2,401,949,169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>	1,365,567,210円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,716,314,439円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	582,852,083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>	58,758,346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>	77,534,671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>	254,148,937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>	238,480,125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 >	1,418,504,207円
合計	92,850,628,728円

(2021年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,850,628,728円
同期中における追加設定元本額	12,353,840,879円
同期中における一部解約元本額	19,894,458,111円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	23,244,502,535円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	710,157,374円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,958,794,306円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,005,548,820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)	142,748,560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)	6,951,183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)	31,512,688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)	99,066,057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)	170,376,094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)	108,781,695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)	199,736,211円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,233,080円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	127,038,109円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,476,615円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	11,846,262円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,816,122円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,042,933円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	95,085,277円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	29,864,584円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,560,013円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	71,850,656円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	109,843,469円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	6,805,603円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	17,506,667円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	11,099,081円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	1,626,248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>	2,043,593,613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>	53,057,364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>	8,531,760,680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>	4,860,208,256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>	11,164,801,965円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	35,450,962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>	95,266,461円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	344,673円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,669,331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>	120,185,798円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,122,042,188円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,679,976,562円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,316,768,149円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	734,643円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,809,268,355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)	352,953,733円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	156,272,027円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	91,137,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,246,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,901,519円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	110,101,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	452,050,893円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	125,311,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,682,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,169,886円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,120,491,404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>	899,220,307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>	1,115,496,800円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,187,233,763円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	494,516,397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>	77,084,706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>	57,990,730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>	188,235,066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>	157,799,081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>	1,158,898,055円
合計	85,310,011,496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	1,800,000.00	1,800,140.63	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,296,304.70	



US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,991,875.04
US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,691,539.09
US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,012,109.40
US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,716,242.22
US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	3,004,921.89
US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,378,250.00
US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,267,773.45
US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,976,718.76
US TREASURY N/B 0.375	1,500,000.00	1,504,335.94
US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,993,203.14
US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,984,687.50
US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,558,265.62
US TREASURY N/B 0.375	9,100,000.00	8,800,695.35
US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,505,390.62
US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,944,687.50
US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,940,468.75
US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,308,562.50
US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,485,117.19
US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	980,859.38
US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	7,100,976.60
US TREASURY N/B 0.625	9,800,000.00	9,241,859.42
US TREASURY N/B 0.875	3,400,000.00	3,273,296.89
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	4,041,875.00
US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,543,593.75
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,041,250.00
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,079,218.75
US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	4,170,445.33
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,083,125.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,074,296.89
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	514,335.94
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,575,585.95
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,093,515.64
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,038,906.25
US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,698,515.63
US TREASURY N/B 1.375	4,900,000.00	4,139,734.37
US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,576,015.62
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,083,203.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,086,250.00
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,085,781.26
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,567,031.25
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,043,281.25
US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,617,421.87

US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,045,156.26
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,478,093.75
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,591,601.58
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,110,000.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,097,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,101,015.64
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,116,250.00
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,523,937.51
US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,361,480.49
US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,099,265.62
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,153,046.89
US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,626,609.37
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	900,546.87
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,050,625.00
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,832,765.63
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,447,062.51
US TREASURY N/B 1.75	1,600,000.00	1,632,750.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,062,578.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,067,031.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,078,984.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,094,921.89
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,796,609.37
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,377,093.75
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	892,632.81
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,539,500.00
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,198,125.00
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,440,312.51
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,039,218.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,063,281.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,067,734.39
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,743,296.87
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,928,625.02
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,089,062.50
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,899,000.00
US TREASURY N/B 1.875	1,400,000.00	1,491,109.38
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,408,250.01
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,158,851.57
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,081,796.89
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,611,289.08
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,167,187.50
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,941,015.64
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,110,937.50
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,485,625.00

US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,643,554.70
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,724,218.75
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,591,929.70
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,360,546.90
US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,762,812.50
US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,562,304.70
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,082,265.64
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,149,062.52
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,266,140.62
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,114,062.50
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,878,828.12
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,718,750.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,258,125.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,918,687.50
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,249,125.00
US TREASURY N/B 2.125	900,000.00	970,171.87
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,406,156.25
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,175,546.89
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,331,656.25
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,041,062.50
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,605,351.57
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,745,429.71
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,324,265.62
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,323,125.00
US TREASURY N/B 2.25	2,700,000.00	2,924,859.37
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,783,281.27
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,571,437.50
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,790,843.77
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,976,914.06
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,652,304.70
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,687,187.50
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,252,500.00
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,939,343.75
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	6,003,812.52
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,369,328.12
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,389,234.37
US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	2,034,929.69
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,583,125.00
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,290,234.40
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,112,359.37
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,683,687.50
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,533,218.75

US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,493,664.08
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,179,125.00
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,493,343.75
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,201,875.00
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,507,898.44
US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,838,968.77
US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,971,687.50
US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,257,757.83
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,065,617.20
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,059,296.88
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,126,406.26
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,047,000.00
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,493,671.89
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,485,289.08
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,188,281.26
US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	5,057,125.00
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,312,789.07
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,391,000.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,292,500.00
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	343,710.93
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,367,328.14
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,724,296.87
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,072,343.75
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,148,906.26
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,423,609.38
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,213,695.31
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,776,171.87
US TREASURY N/B 2.875	5,000,000.00	5,666,015.65
US TREASURY N/B 2.875	5,500,000.00	6,242,070.34
US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,807,062.51
US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,331,312.50
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,224,937.50
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,652,984.38
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,456,562.52
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,457,226.57
US TREASURY N/B 3	800,000.00	953,750.00
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,176,210.95
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,585,234.39
US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,232,406.25
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,003,710.95
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,644,640.63
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,731,867.20
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,513,750.00

	US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,587,312.50
	US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,851,656.25
	US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,335,640.62
	US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,215,781.25
	US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,794,679.69
	US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	4,016,718.75
	US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,956,125.00
	US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,792,187.50
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,997,062.50
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,018,187.50
	US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,143,437.51
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,722,750.00
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,984,921.87
	US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	933,460.94
	US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	669,335.94
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,392,656.25
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	842,156.25
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	700,390.62
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	991,921.87
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,989,859.38
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	429,187.50
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,044,667.97
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	284,359.37
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,434,531.25
	US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	876,750.00
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,239,570.32
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	741,093.75
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	658,046.87
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	444,950.00
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	663,750.00
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,269,062.50
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,345,078.13
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	921,562.50
	米ドル 小計	615,670,000.00	657,197,177.72 (69,492,029,572)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,007,100.00
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	597,840.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,038,070.00
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,321,203.00
	CANADA-GOV'T 1.25	3,400,000.00	3,460,078.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,057,400.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,038,540.00

	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	3,031,805.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,134,166.00
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,252,416.00
	CANADA-GOV'T 2	1,900,000.00	2,056,351.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,058,480.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,504,454.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,215,291.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,249,037.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,859,400.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,363,560.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	662,450.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,792,453.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,141,385.00
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,207,378.50
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	345,412.50
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	754,910.00
	カナダドル 小計	34,400,000.00	38,149,180.00 (3,177,445,202)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	38,195,840.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	20,858,000.00
	MEXICAN BONOS 6.5	28,000,000.00	28,880,194.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	28,354,130.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,954,042.00
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	20,835,333.00
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	29,647,350.00
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	27,790,996.60
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	48,358,192.00
	メキシコペソ 小計	219,000,000.00	249,874,077.60 (1,309,340,166)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	727,540.00
	BELGIAN 0.1	1,300,000.00	1,333,904.00
	BELGIAN 0.4	300,000.00	300,903.00
	BELGIAN 0.8	800,000.00	848,376.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,078,570.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,085,620.00
	BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,567,225.00
	BELGIAN 0304 5	1,400,000.00	2,364,124.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	736,295.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,091,480.00
	BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	882,217.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,836,085.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,603,545.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,551,183.00

BELGIAN 0333 3	700,000.00	971,684.00
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,041,310.00
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	741,735.00
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	476,848.00
BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,427,426.00
BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	640,700.00
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,514,100.00
BELGIAN 1	1,000,000.00	1,114,620.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	460,668.00
BELGIAN 1.6	850,000.00	1,056,720.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,272,820.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	751,760.00
BELGIAN 3.75	800,000.00	1,387,424.00
BTPS 0.35	2,700,000.00	2,752,353.00
BTPS 0.5	1,000,000.00	1,024,650.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,050,580.00
BTPS 0.85	1,700,000.00	1,772,505.00
BTPS 0.9	2,250,000.00	2,291,715.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,052,300.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,053,340.00
BTPS 0.95	800,000.00	838,576.00
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,873,170.00
BTPS 1	1,000,000.00	1,019,740.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,017,860.00
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,706,896.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,040,240.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,057,700.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,908,666.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,065,250.00
BTPS 1.45	600,000.00	642,252.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,884,275.00
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,299,480.00
BTPS 1.65	1,200,000.00	1,325,220.00
BTPS 1.65	1,800,000.00	1,989,252.00
BTPS 1.7	500,000.00	524,155.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,067,080.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,083,970.00
BTPS 2	1,300,000.00	1,426,932.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,793,088.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,679,025.00
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,110,480.00
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,593,388.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,422,648.00

BTPS 2.45	1,100,000.00	1,317,767.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,108,269.00	
BTPS 2.5	600,000.00	660,240.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,353,260.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,988,991.00	
BTPS 2.8	300,000.00	356,571.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,185,156.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,686,815.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,251,940.00	
BTPS 3.1	900,000.00	1,194,192.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	2,101,710.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,124,813.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	2,038,162.00	
BTPS 3.5	4,900,000.00	6,212,024.00	
BTPS 3.75	1,500,000.00	1,708,140.00	
BTPS 3.85	900,000.00	1,403,739.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,739,866.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,545,203.00	
BTPS 4.5	1,000,000.00	1,143,860.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,207,196.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,813,300.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,657,300.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,706,784.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,111,700.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,207,000.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,164,346.90	
BTPS 5	1,800,000.00	2,966,490.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,828,290.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,307,916.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,198,800.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,675,358.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,375,834.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,407,370.00	
BTPS 7.25	400,000.00	563,268.00	
BTPS 9	300,000.00	375,591.00	
BUNDESUBL-120 0	3,500,000.00	3,601,920.00	
BUNDESUBL-176 0	2,000,000.00	2,022,860.00	
BUNDESUBL-177 0	1,900,000.00	1,929,526.00	
BUNDESUBL-178 0	1,600,000.00	1,631,280.00	
BUNDESUBL-179 0	1,300,000.00	1,329,744.00	
BUNDESUBL-182 0	1,800,000.00	1,857,330.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,100,000.00	2,114,973.00	



DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,487,456.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,643,710.00
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,352,520.00
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	307,401.00
DEUTSCHLAND REP 0	2,300,000.00	2,211,082.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	4,003,908.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,075,160.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,017,477.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,622,275.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,900,000.00	2,013,107.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,648,336.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	4,100,000.00	4,414,265.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,379,235.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,208,014.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,164,189.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,193,576.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,365,234.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,145,760.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,273,964.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,365,418.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,137,160.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,489,420.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,600,000.00	4,217,590.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,052,528.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,012,858.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,721,998.50
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,243,648.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,000,000.00	3,374,720.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,217,351.50
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,440,225.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,438,500.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,444,236.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	807,365.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,464,560.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	403,088.00
FINNISH GOV'T 0.25	300,000.00	301,215.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	426,540.00
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	854,272.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	547,945.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	229,572.00
FINNISH GOV'T 1.375	300,000.00	381,042.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,047,460.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,036,620.00

FINNISH GOV'T 2	600,000.00	651,138.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	750,860.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	741,876.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,205,500.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,013,120.00
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,218,304.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,027,520.00
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,077,360.00
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,227,888.00
FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,585,905.00
FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,924,092.00
FRANCE O.A.T. 0.25	4,100,000.00	4,270,314.00
FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	773,451.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,032,617.00
FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000.00	4,740,345.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,977,968.00
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,701,775.00
FRANCE O.A.T. 0.75	3,200,000.00	3,466,112.00
FRANCE O.A.T. 0.75	1,000,000.00	1,024,430.00
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,201,823.00
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,726,675.00
FRANCE O.A.T. 1.25	2,700,000.00	3,113,640.00
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,784,216.00
FRANCE O.A.T. 1.5	3,850,000.00	4,488,907.50
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,969,472.00
FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,431,588.00
FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,832,206.00
FRANCE O.A.T. 1.75	2,400,000.00	3,025,848.00
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,094,408.00
FRANCE O.A.T. 2	2,200,000.00	2,997,918.00
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	1,993,746.00
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,722,014.00
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,381,720.00
FRANCE O.A.T. 2.75	3,850,000.00	4,673,900.00
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,216,850.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,602,588.00
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,028,425.00
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,301,600.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,762,742.00
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,962,414.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,533,000.00
FRANCE O.A.T. 4.5	2,600,000.00	4,707,586.00

FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,648,832.00
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,077,617.50
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,533,334.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	3,937,950.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	720,948.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	404,096.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	710,402.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	762,363.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,077,440.00
IRISH GOVT 1.1	1,600,000.00	1,776,416.00
IRISH GOVT 1.3	600,000.00	692,634.00
IRISH GOVT 1.35	500,000.00	573,655.00
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	495,340.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	369,900.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,350,090.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	743,232.00
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	561,850.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	547,340.00
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	995,312.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,020,090.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,900,000.00	1,955,043.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,038,740.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	500,000.00	526,510.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,799,943.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	800,000.00	868,888.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,300,000.00	1,406,301.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,089,740.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,694,944.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,092,090.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,561,845.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,325,800.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,001,180.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	759,794.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,299,817.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,600,000.00	2,642,768.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	995,036.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,874.00
REP OF AUSTRIA 0	500,000.00	510,425.00
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	849,944.00
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	906,346.50
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	965,448.00
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	757,785.00
REP OF AUSTRIA 0.75	800,000.00	874,928.00

REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	156,784.50
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,084,350.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	290,086.00
REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	900,725.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,192,895.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,064,100.00
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,189,791.00
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	992,496.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,178,573.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,050,260.00
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,553,699.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,000,000.00	1,653,350.00
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	639,835.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,437,730.00
SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,013,900.00
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,022,730.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,022,680.00
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	508,225.00
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,029,950.00
SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	423,416.00
SPANISH GOV'T 1	300,000.00	290,859.00
SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	532,050.00
SPANISH GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,196,160.00
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,933,766.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,207,240.00
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,768,928.00
SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,867,202.00
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,228,251.00
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,323,744.00
SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,840,046.00
SPANISH GOV'T 1.85	2,400,000.00	2,825,424.00
SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,900,014.00
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,980,976.00
SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,679,312.00
SPANISH GOV'T 2.35	1,300,000.00	1,601,665.00
SPANISH GOV'T 2.7	1,550,000.00	2,158,824.50
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,345,196.00
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,998,640.00
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,837,473.00
SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,591,184.00
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,550,322.50
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,265,180.00

	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,201,544.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,589,480.00
	SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,734,600.00
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,618,025.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,092,170.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,272,908.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,509,402.50
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,411,805.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,333,518.00
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	667,825.00
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,241,942.00
	ユーロ 小計	435,790,000.00	523,592,709.40 (66,710,947,104)
英bond	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	701,561.00
	UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,496,250.00
	UK TSY GILT 0.375	1,000,000.00	979,670.00
	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,814,292.00
	UK TSY GILT 0.625	2,000,000.00	2,044,700.00
	UK TSY GILT 0.625	500,000.00	479,645.00
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,698,786.50
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,031,350.00
	UK TSY GILT 1	1,600,000.00	1,649,472.00
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,061,400.00
	UK TSY GILT 1.25	400,000.00	411,572.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,070,870.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,838,431.00
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	688,160.00
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,187,360.00
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	568,200.00
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,233,492.00
	UK TSY GILT 1.75	2,400,000.00	2,679,600.00
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	859,327.50
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,193,907.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,854,953.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,405,040.00
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,424,826.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,290,704.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,471,502.00
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,767,049.50
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,707,200.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,563,780.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,268,471.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,393,084.00

	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,247,841.00
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,545,148.50
	UK TSY GILT 4.25	1,450,000.00	2,245,934.00
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,045,238.00
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,544,930.00
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,588,221.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,232,431.00
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,620,432.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,245,482.00
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,607,343.50
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,942,368.00
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,557,946.00
	UK TSY GILT 6	650,000.00	928,050.50
	英債券 小計	57,100,000.00	74,186,021.00 (10,882,347,420)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,197,280.00
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,197,320.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1	6,400,000.00	6,789,568.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,344,400.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,571,850.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,393,040.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,853,264.00
	スウェーデンクローナ 小計	39,000,000.00	43,346,722.00 (551,370,303)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,020,260.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,609,970.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,122,730.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,821,473.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,209,220.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,563,760.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,294,520.00
	ノルウェークローネ 小計	30,200,000.00	31,641,933.00 (394,258,485)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,284,140.00
	DENMARK - BULLET 0.5	11,100,000.00	11,739,360.00
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,258,000.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,277,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,633,000.00
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	19,080,600.00
	デンマーククローネ 小計	37,900,000.00	48,272,100.00 (826,901,073)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	6,000,000.00	5,998,714.47

	POLAND GOVT BOND 2.25	3,000,000.00	3,079,950.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	1,070,310.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,289,830.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,308,220.00
	POLAND GOVT BOND 2.75	4,500,000.00	5,082,570.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,732,209.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,619,864.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,700,000.00	3,701,781.00
	ポーランドズロチ 小計	32,500,000.00	35,883,448.47 (1,017,295,764)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	900,000.00	891,727.20
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	3,300,000.00	3,333,660.00
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	600,000.00	516,993.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,556,640.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,273,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,495,665.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,708,705.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,600,000.00	4,048,740.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,029,681.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	4,300,000.00	4,854,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	900,240.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,588,622.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,129,710.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,450,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	3,018,180.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,511,568.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,154,030.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,862,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	6,100,000.00	7,581,080.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,232,600.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,698,500.00	
	オーストラリアドル 小計	47,450,000.00	53,837,442.00 (4,416,285,367)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,105,285.00
	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	445,800.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,266,960.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	476,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	849,100.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	461,528.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	760,900.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	834,356.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	795,275.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,732,500.00

シンガポールドル 小計		7,750,000.00	8,727,704.00 (695,336,177)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,165,652.20
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,319,424.43
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,687,851.35
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,603,835.00
	MALAYSIA GOVT 4.736	4,500,000.00	4,960,516.95
マレーシアリングgit 小計		29,700,000.00	31,737,279.93 (831,834,106)
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.75	6,200,000.00	6,253,940.00
	ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	3,004,951.00
	ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,662,600.00
	ISRAEL FIXED 3.75	3,700,000.00	4,931,656.00
	ISRAEL FIXED 6.25	5,000,000.00	6,616,950.00
イスラエルシュケル 小計		19,300,000.00	22,470,097.00 (727,806,441)
合計			161,033,197,180 (161,033,197,180)

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 205銘柄	42.6%	43.2%
カナダドル	国債証券 23銘柄	1.9%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 280銘柄	40.9%	41.4%
英ポンド	国債証券 43銘柄	6.7%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 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	2.7%	2.7%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 5銘柄	0.4%	0.5%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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D S ・年金バランス30（債券重点型）

2021年 2月26日現在

資産総額	138,585,525円
負債総額	4,619円
純資産総額（ - ）	138,580,906円
発行済口数	129,240,474口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0723円
（1万口当たり純資産額）	（10,723円）

## 三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

2021年 2月26日現在

資産総額	345,169,009円
負債総額	346,670円
純資産総額（ - ）	344,822,339円
発行済口数	305,396,383口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1291円
（1万口当たり純資産額）	（11,291円）

## 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

2021年 2月26日現在

資産総額	220,784,379円
負債総額	593,136円
純資産総額（ - ）	220,191,243円
発行済口数	185,763,580口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1853円
（1万口当たり純資産額）	（11,853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。

## ヘ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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

	2021年2月26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。

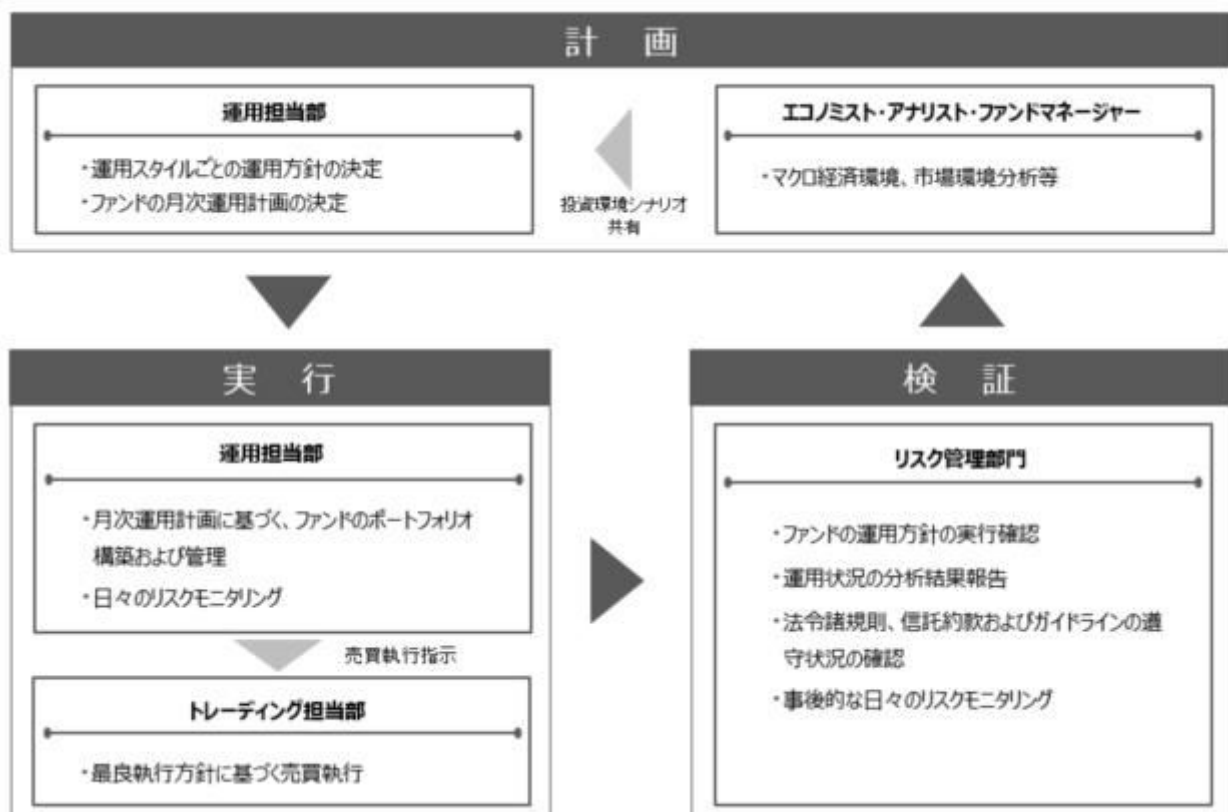
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2021年2月26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	736	8,626,084
単位型株式投資信託	115	616,880
追加型公社債投資信託	1	32,120
単位型公社債投資信託	194	471,251
合計	1,046	9,746,336

## 3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第35期（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、第36期中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785

未収投資助言報酬		285,668	299,826
未収収益		44,150	37,702
その他の流動資産		31,771	40,119
流動資産合計		22,771,504	45,664,712
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		173,517	101,609
器具備品		751,471	783,224
土地		-	710
リース資産		-	968
建設仮勘定		-	66,498
有形固定資産合計		924,988	953,010
無形固定資産			
ソフトウェア		479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定		183,528	508,733
のれん		-	34,397,824
顧客関連資産		-	17,785,166
電話加入権		44	12,739
商標権		60	54
無形固定資産合計		663,501	53,613,651
投資その他の資産			
投資有価証券		10,829,628	19,436,480
関係会社株式		10,252,067	11,246,398
長期差入保証金		2,004,451	2,523,637
長期前払費用		97,107	113,852
会員権		7,819	90,479
繰延税金資産		1,426,381	-
貸倒引当金		-	20,750
投資その他の資産合計		24,617,457	33,390,098
固定資産合計		26,205,946	87,956,760
資産合計		48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

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

その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

## (2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691

一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022
事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

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

法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				



株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
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ものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

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

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、記載していません。

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、記載していません。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839

(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
728,127	7,247	14,605

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842
確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
--	-------------------------	-------------------------



法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1
その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

## (セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2)地域ごとの情報

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位:千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

### (1株当たり情報)

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

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

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

1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

### (企業結合等関係)

#### (取得による企業結合)

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

## 1. 企業結合の概要

### (1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

### (2)企業結合を行った主な理由

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

### (3)企業結合日

2019年4月1日

### (4)企業結合の法的形式

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

### (5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

### (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

## 3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

## 4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

## (1) 合併比率

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

## (2) 合併比率の算定方法

当社は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

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	30,600,006
顧客分別金信託	300,033
前払費用	491,960
未収委託者報酬	8,462,795
未収運用受託報酬	2,637,333
未収投資助言報酬	403,508
未収収益	39,908
その他	127,104
流動資産合計	43,062,650
固定資産	
有形固定資産	2,622,154

無形固定資産		
のれん		33,074,831
顧客関連資産		16,728,528
その他		1,741,538
無形固定資産合計		51,544,898
投資その他の資産		
投資有価証券		21,128,629
関係会社株式		11,246,398
その他		2,228,340
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		34,582,618
固定資産合計		88,749,672
資産合計		131,812,323
負債の部		
流動負債		
リース債務		266
顧客からの預り金		2,366
その他の預り金		118,688
未払金		3,919,626
未払費用		4,532,572
未払法人税等		330,248
前受収益		28,358
賞与引当金		1,343,147
その他	2	25,119
流動負債合計		10,300,393
固定負債		
繰延税金負債		3,126,317
退職給付引当金		5,442,936
賞与引当金		7,383
その他		150,104
固定負債合計		8,726,742
負債合計		19,027,135
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		17,495,141
利益剰余金合計		19,316,346
株主資本合計		111,872,330
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		912,856
評価・換算差額等合計		912,856
純資産合計		112,785,187
負債純資産合計		131,812,323

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			23,512,538
運用受託報酬			4,131,413
投資助言報酬			637,750
その他の営業収益			115,543
営業収益計			28,397,245
営業費用			18,361,605
一般管理費	1		11,009,285
営業損失( )			973,645
営業外収益	2		130,819
営業外費用	3		22,619
経常損失( )			865,445
特別損失	4		179,016
税引前中間純損失( )			1,044,462
法人税、住民税及び事業税			223,963
法人税等調整額			110,573
法人税等合計			113,390
中間純損失( )			1,157,852

## (3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		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	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当中間期変動額								
剰余金の配当								711,271
中間純損失( )								1,157,852
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)								
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,869,124
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	17,495,141

	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	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

当中間期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
中間純損失( )	1,157,852	1,157,852			1,157,852
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)			535,001	535,001	535,001
当中間期変動額合計	1,869,124	1,869,124	535,001	535,001	1,334,122
当中間期末残高	19,316,346	111,872,330	912,856	912,856	112,785,187

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法

## 其他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

市場価格のない株式等

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中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (追加情報)

当社は「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準第31号 2019年7月4日）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

## (中間貸借対照表関係)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	991,194千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額109,041千円の支払保証を行っております。	

## (中間損益計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	288,293千円
無形固定資産	1,209,507千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	4,544千円
受取配当金	5,845千円
投資有価証券償還益	9,936千円
投資有価証券売却益	59,364千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	1千円
投資有価証券売却損	21,377千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	51,972千円
本社移転費用	127,044千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日



2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日
----------------------	------	---------	-------	----------------	----------------

## (リース取引関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,192,635千円
1年超	4,091,860千円
合 計	5,284,495千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第36期中間会計期間(2020年9月30日)

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	30,600,006	30,600,006	-
(2)顧客分別金信託	300,033	300,033	-
(3)未収委託者報酬	8,462,795	8,462,795	-
(4)未収運用受託報酬	2,637,333	2,637,333	-
(5)未収投資助言報酬	403,508	403,508	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	21,083,260	21,083,260	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,006,627	2,006,627	-
資産計	65,493,564	65,493,564	-
(1)顧客からの預り金	2,366	2,366	-
(2)未払金			
未払手数料	3,761,585	3,761,585	-
負債計	3,763,951	3,763,951	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

## (6)投資有価証券

    その他有価証券

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

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

## (7)投資その他の資産

    長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

## (注2)市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。  
子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしていません。

また時価をもって中間貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、時価の算定に関する会計基準の適用指針第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載していません。

（有価証券関係）

第36期中間会計期間（2020年9月30日）

## 1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載していません。

## 2. その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの 投資信託等	16,043,944	14,414,570	1,629,373
小計	16,043,944	14,414,570	1,629,373
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	5,039,315	5,294,354	255,038
小計	5,039,315	5,294,354	255,038
合計	21,083,260	19,708,925	1,374,335

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 45,369千円）については、市場価格がないことから、記載していません。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っていませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	23,512,538	4,131,413	637,750	115,543	28,397,245

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1 株当たり情報)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,329円93銭
1株当たり中間純損失( )	34円18銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純損失については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

## (参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

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

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

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

**強調事項**

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**（1）貸借対照表**

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

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



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

## 注記事項

## (重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券</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。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

## (追加情報)

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

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

## (貸借対照表関係)

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

## (損益計算書関係)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

第47期(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）金融商品に該当するものを表示しております。

### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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

## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(単位：千円)

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

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

第47期（平成31年3月31日）

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

## 2. その他有価証券

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

第47期（自平成30年4月1日 至平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(単位：千円)

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

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

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

(単位：千円)

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

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

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

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

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

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

## 関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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



## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

## 2.地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3.主要な顧客ごとの情報

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	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  
該当ありません。
  - (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9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9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## □ 販売会社

- （イ）名称 株式会社三井住友銀行
- （ロ）資本金の額 1,770,996百万円（2020年9月末現在）
- （ハ）事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

## □ 販売会社

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

## 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

## 第3【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
2020年 5月14日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 5月14日	有価証券報告書
2020年10月27日	有価証券届出書
2020年10月27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**

2021年3月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2020年2月19日から2021年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2021年2月18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。



**独立監査人の監査報告書**

2021年3月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス50(標準型)の2020年2月19日から2021年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス50(標準型)の2021年2月18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。

**独立監査人の監査報告書**

2021年3月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の2020年2月19日から2021年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の2021年2月18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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2020年11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  
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**中間監査意見**

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。