

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年12月9日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

以下、上記５ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）」を「１安定重視型」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）」を「２やや安定型」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）」を「３バランス型」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）」を「４やや成長型」、「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）」を「５成長重視型」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」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	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2021年12月10日から2022年6月9日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」(ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること)による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ お申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

ホ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ヘ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)。

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

単字型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単字型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型		その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。
商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していま

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】

2017年9月14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け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

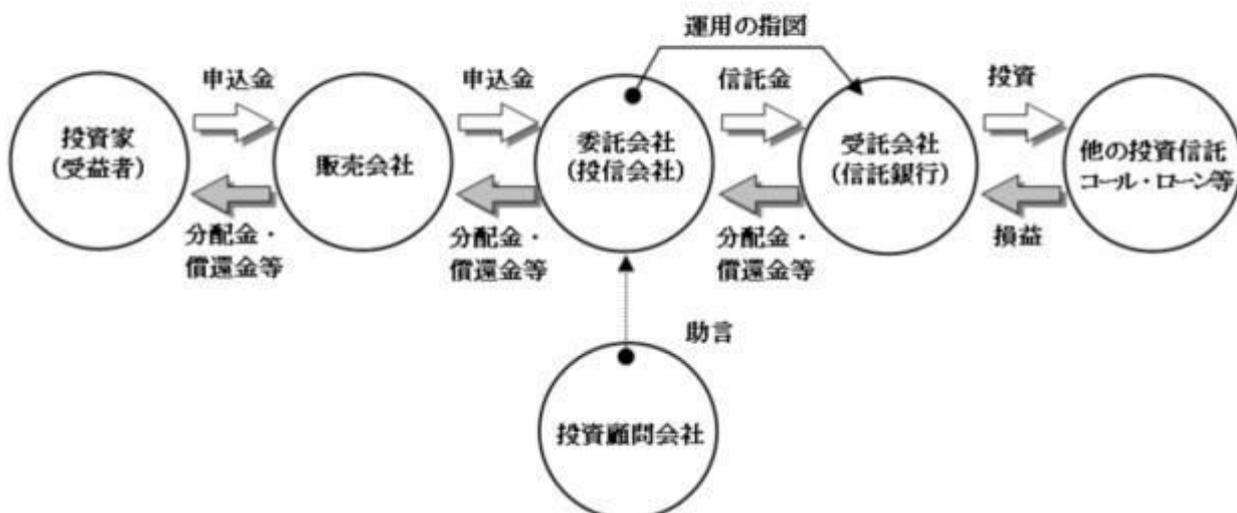
[参考情報：投資顧問会社]

以下の法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2021年9月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

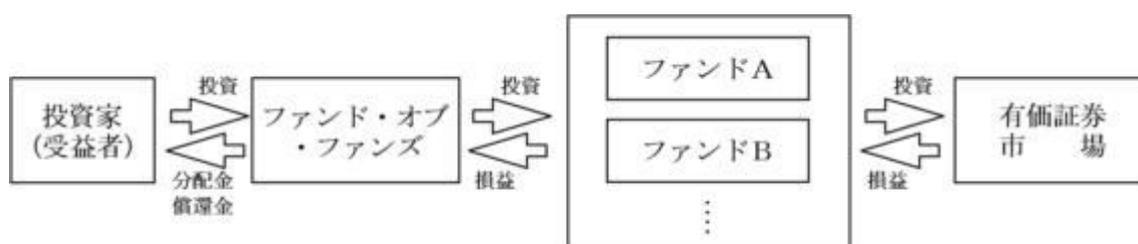
(2021年9月30日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



(1) 【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

(1 安定重視型) 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

(2 やや安定型) 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

(3 バランス型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

(4 やや成長型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

(5 成長重視型) 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

() 主として、国内株式、先進国株式(除く日本)、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券(除く日本)、為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)、新興国債券に投資します。

() 投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

(ロ) イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

() 基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク(標準偏差)および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

(ハ) 実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ニ) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

(ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

■投資対象とする投資信託の投資方針等

●すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶債券

国内債券

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

先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

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

為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)…為替ヘッジあり

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

新興国債券…為替ヘッジなし^{※1}

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックス(米ドルベース)をベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ● ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
取引通貨	米ドル
管理報酬等 ^{※2}	年0.39%
一般投資者の日本での購入の可否 ^{※3}	日本において一般投資者の購入が可能です。

※1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

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

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

▶ 株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式*に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 *2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

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

新興国株式…為替ヘッジなし

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

▶リート

国内リート

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

外国リート…為替ヘッジなし

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

ファンドの特色

1 投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

■ インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

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

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式（除く日本） ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

2 イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

■ イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

3 目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。

目標リスク水準とは

目標リスク水準は各ファンドのリスク（標準偏差）の目安を表示したものです。
一般にリスクの数値が大きいほどリターン（収益）の振れ幅が大きくなる傾向があります。

1 安定重視型 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

2 やや安定型 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

3 バランス型 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

4 やや成長型 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

5 成長重視型 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

■ 各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

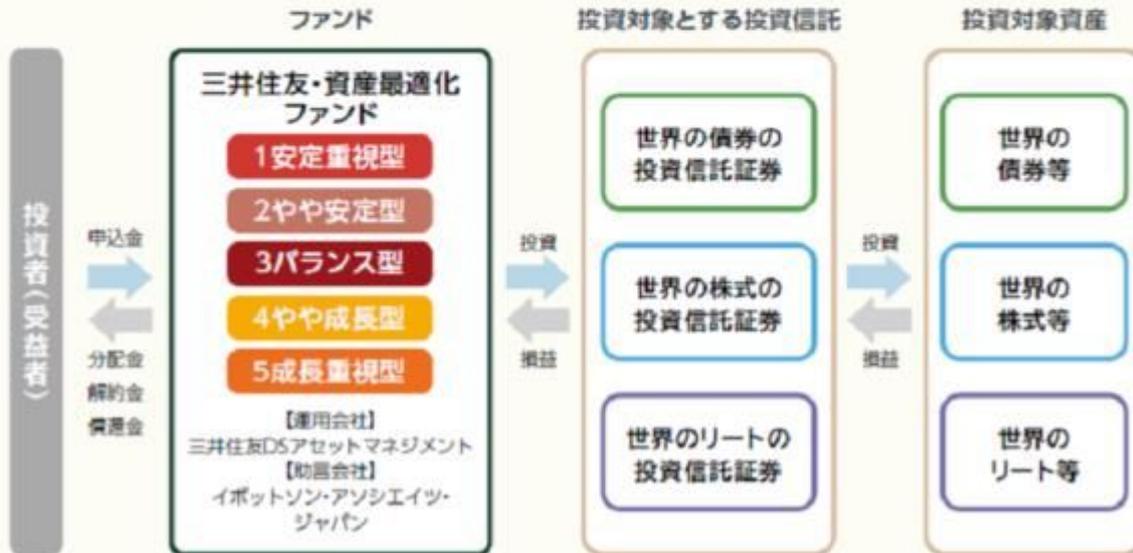
4

実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

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

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

■投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

[5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ]



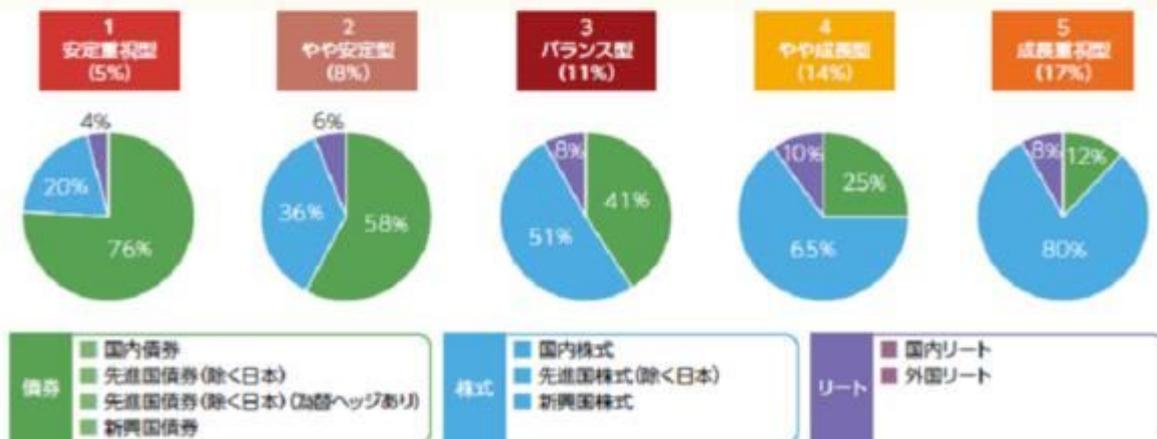
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※目標リスク水準は2021年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

ポートフォリオの基本資産配分イメージ

■目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。



※()内の数値は目標リスク水準です。

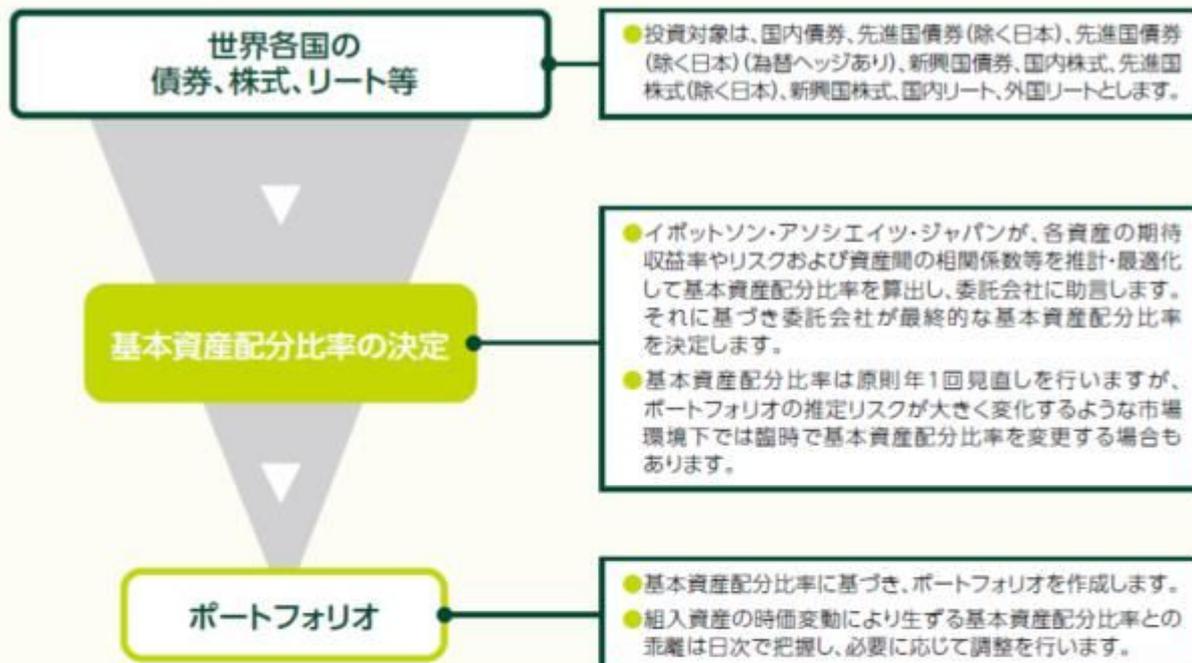
※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。

(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2021年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

- 世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象とし、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの助言に基づき基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2021年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について



- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。
- 1977年にロジャー・G・イボットソン(イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国 Ibbotson Associates, Inc. (現Morningstar Investment Management LLC) を設立しました。
- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、資本市場の長期的なリターンとリスクの調査研究に基づいて、中立的な立場から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

(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. 約束手形
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

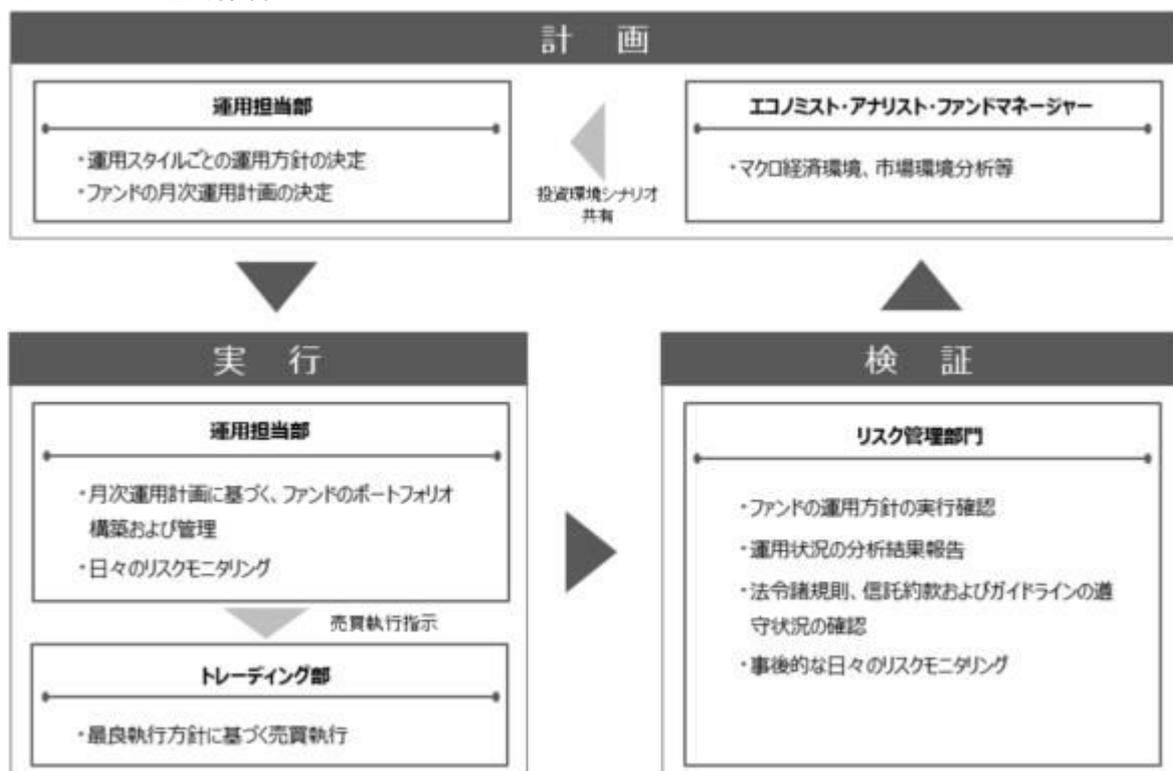
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年９月15日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

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

(二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ト 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。

チ 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ 資金の借入れ

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

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

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

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

(ニ) 信用リスク

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

(ホ) 為替変動リスク

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

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

(ヘ) カントリーリスク

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

(ト) 市場流動性リスク

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 換金制限等に関する留意点

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

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■1安定重視型



「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。



■2やや安定型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「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。

■3バランス型



「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。



■4やや成長型



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

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「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。

■5成長重視型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※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、東京証券取引所に上場している株式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	JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）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0.39%	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0.46%	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0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。 委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。		
投資対象とする投資信託	年0.39%程度（最大） [*] 管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年1.007%（最大）（税抜き0.919%）程度 [*] 実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。 ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。		

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

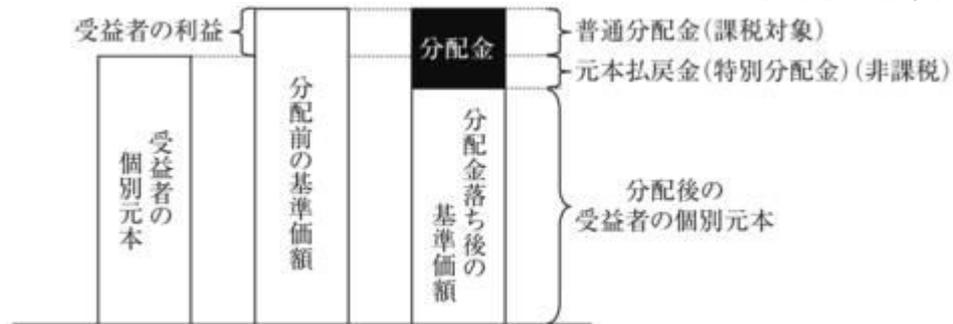
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、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。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年9月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	56,253,821	0.93
親投資信託受益証券	日本	5,954,029,943	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	69,992,798	1.15
合計(純資産総額)		6,080,276,562	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・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	56,032,058	1.87
親投資信託受益証券	日本	2,902,538,765	97.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	33,523,548	1.12
合計(純資産総額)		2,992,094,371	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	206,695,216	2.88
親投資信託受益証券	日本	6,885,599,461	96.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	76,532,869	1.07
合計（純資産総額）		7,168,827,546	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	110,129,853	3.71
親投資信託受益証券	日本	2,828,259,451	95.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	32,803,500	1.10
合計（純資産総額）		2,971,192,804	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	142,950,742	4.82
親投資信託受益証券	日本	2,780,170,572	93.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	42,345,305	1.43
合計（純資産総額）		2,965,466,619	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	日本	7,008,194	0.24

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

イ 主要投資銘柄

2021年9月30日 現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	1,513,203,093	1.5197	2,299,656,319	1.4987	2,267,837,475	37.30
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	1,653,252,104	1.2839	2,122,550,800	1.2804	2,116,823,993	34.81
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	109,074,818	5.4846	598,231,734	5.4560	595,112,207	9.79
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)	147,720,164	3.4743	513,224,165	3.3910	500,919,076	8.24
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	61,827,485	1.9695	121,771,897	1.9635	121,398,266	2.00
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	70,544,068	1.7127	120,820,825	1.6859	118,930,244	1.96
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	45,165,424	2.6194	118,306,620	2.6014	117,493,333	1.93
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	42,522,031	2.7671	117,662,617	2.7166	115,515,349	1.90
アメリカ	投資証 券	iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF	4,566	12,677.18	57,883,996	12,320.15	56,253,821	0.93

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	0.93
親投資信託受益証券	97.92
合計	98.85

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

イ 主要投資銘柄

2021年9月30日現在

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

日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	574,232,930	1.5195	872,549,696	1.4987	860,602,892	28.76
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	558,385,417	1.2838	716,882,582	1.2804	714,956,687	23.89
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	96,588,206	5.4844	529,726,479	5.4560	526,985,251	17.61
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)	131,901,828	3.4743	458,266,531	3.3910	447,279,098	14.95
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	45,801,161	1.9695	90,206,146	1.9635	89,930,579	3.01
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	52,317,201	1.7127	89,603,670	1.6859	88,201,569	2.95
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	33,658,907	2.6193	88,164,458	2.6014	87,560,280	2.93
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	32,033,575	2.7670	88,638,093	2.7166	87,022,409	2.91
アメリカ	投資証 券	iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF	4,548	12,677.18	57,655,807	12,320.15	56,032,058	1.87

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	1.87
親投資信託受益証券	97.01
合計	98.88

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

イ 主要投資銘柄

2021年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	321,966,930	5.4838	1,765,604,488	5.4560	1,756,651,570	24.50

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)	443,853,286	3.4743	1,542,079,506	3.3910	1,505,106,492	21.00
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	951,335,168	1.5195	1,445,579,987	1.4987	1,425,766,016	19.89
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	832,905,409	1.2839	1,069,351,023	1.2804	1,066,452,085	14.88
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	210,078,988	1.7122	359,701,537	1.6859	354,172,165	4.94
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	104,835,684	2.7660	289,971,783	2.7166	284,796,619	3.97
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	107,732,703	2.6193	282,185,624	2.6014	280,255,853	3.91
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	108,173,497	1.9696	213,056,936	1.9635	212,398,661	2.96
アメリカ	投資証 券	iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF	16,777	12,668.84	212,545,068	12,320.15	206,695,216	2.88

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	2.88
親投資信託受益証券	96.05
合計	98.93

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

イ 主要投資銘柄

2021年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	162,483,989	5.4847	891,176,809	5.4560	886,512,643	29.84

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)	224,862,665	3.4743	781,237,007	3.3910	762,509,297	25.66
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	216,924,357	1.5195	329,609,849	1.4987	325,104,533	10.94
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	156,482,628	1.7120	267,894,458	1.6859	263,814,062	8.88
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	185,530,465	1.2839	238,194,836	1.2804	237,553,207	8.00
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	54,734,731	2.7658	151,382,703	2.7166	148,692,370	5.00
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	55,832,766	2.6195	146,256,661	2.6014	145,243,357	4.89
アメリカ	投資証 券	iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 E T F	8,939	12,677.18	113,321,297	12,320.15	110,129,853	3.71
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	29,961,794	1.9696	59,013,758	1.9635	58,829,982	1.98

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	3.71
親投資信託受益証券	95.19
合計	98.90

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

イ 主要投資銘柄

2021年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	188,451,985	5.4842	1,033,514,365	5.4560	1,028,194,030	34.67

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)	260,317,035	3.4743	904,419,474	3.3910	882,735,065	29.77
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	258,633,497	1.7121	442,810,471	1.6859	436,030,212	14.70
アメリカ	投資証 券	i シェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 E T F	11,603	12,659.51	146,888,243	12,320.15	142,950,742	4.82
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	42,479,807	2.7655	117,477,714	2.7166	115,400,643	3.89
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	42,723,437	2.6195	111,914,043	2.6014	111,140,749	3.75
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	59,326,700	1.5192	90,130,241	1.4987	88,912,925	3.00
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	68,936,969	1.2839	88,507,628	1.2804	88,266,895	2.98
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	15,019,126	1.9696	29,581,827	1.9635	29,490,053	0.99

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	4.82
親投資信託受益証券	93.75
合計	98.57

【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

2021年9月30日現在

種類	資産の名称	買建 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	62,618.45	7,008,375	7,008,194	0.24

（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。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

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 (2018年 9月18日)	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
第2期 (2019年 9月17日)	1,356,985,451	1,356,985,451	10,327	10,327
第3期 (2020年 9月15日)	3,201,120,313	3,201,120,313	10,352	10,352
第4期 (2021年 9月15日)	6,014,936,981	6,014,936,981	10,987	10,987

2020年 9月末日	3,315,235,342	-	10,331	-
10月末日	3,520,186,485	-	10,243	-
11月末日	3,762,936,667	-	10,515	-
12月末日	3,997,736,761	-	10,584	-
2021年 1月末日	4,163,452,172	-	10,596	-
2月末日	4,241,072,603	-	10,534	-
3月末日	4,559,853,571	-	10,703	-
4月末日	4,769,542,744	-	10,738	-
5月末日	4,971,070,382	-	10,782	-
6月末日	5,315,667,517	-	10,848	-
7月末日	5,569,677,911	-	10,914	-
8月末日	5,912,661,809	-	10,965	-
9月末日	6,080,276,562	-	10,877	-

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

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 (2018年 9月18日)	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
第2期 (2019年 9月17日)	680,523,123	680,523,123	10,310	10,310
第3期 (2020年 9月15日)	1,423,870,207	1,423,870,207	10,504	10,504
第4期 (2021年 9月15日)	2,948,746,361	2,948,746,361	11,770	11,770
2020年 9月末日	1,466,625,447	-	10,459	-
10月末日	1,545,603,251	-	10,323	-
11月末日	1,711,824,334	-	10,796	-
12月末日	1,803,136,388	-	10,927	-
2021年 1月末日	1,889,811,091	-	10,982	-
2月末日	1,997,446,584	-	11,022	-
3月末日	2,162,797,093	-	11,313	-
4月末日	2,276,374,728	-	11,380	-
5月末日	2,348,581,518	-	11,455	-
6月末日	2,544,161,287	-	11,565	-
7月末日	2,699,075,626	-	11,603	-
8月末日	2,892,917,331	-	11,709	-
9月末日	2,992,094,371	-	11,640	-

三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

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 (2018年 9月18日)	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
第2期 (2019年 9月17日)	1,355,636,779	1,355,636,779	10,443	10,443
第3期 (2020年 9月15日)	3,340,276,783	3,340,276,783	10,752	10,752

第4期 (2021年 9月15日)	7,103,911,189	7,103,911,189	12,649	12,649
2020年 9月末日	3,461,308,520	-	10,677	-
10月末日	3,711,133,358	-	10,506	-
11月末日	4,109,896,072	-	11,176	-
12月末日	4,371,500,331	-	11,370	-
2021年 1月末日	4,525,904,638	-	11,484	-
2月末日	4,697,687,423	-	11,629	-
3月末日	5,135,110,935	-	12,035	-
4月末日	5,469,636,086	-	12,134	-
5月末日	5,782,513,939	-	12,240	-
6月末日	6,205,956,094	-	12,398	-
7月末日	6,532,415,280	-	12,387	-
8月末日	6,918,492,986	-	12,547	-
9月末日	7,168,827,546	-	12,497	-

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

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 (2018年 9月18日)	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
第2期 (2019年 9月17日)	635,299,500	635,299,500	10,455	10,455
第3期 (2020年 9月15日)	1,407,129,947	1,407,129,947	10,813	10,813
第4期 (2021年 9月15日)	2,920,936,967	2,920,936,967	13,299	13,299
2020年 9月末日	1,441,931,658	-	10,708	-
10月末日	1,484,995,945	-	10,516	-
11月末日	1,658,734,483	-	11,362	-
12月末日	1,743,550,861	-	11,613	-
2021年 1月末日	1,830,387,563	-	11,793	-
2月末日	1,926,853,020	-	12,042	-
3月末日	2,116,083,659	-	12,551	-
4月末日	2,239,256,890	-	12,684	-
5月末日	2,357,365,240	-	12,818	-
6月末日	2,556,624,843	-	13,024	-
7月末日	2,668,032,277	-	12,951	-
8月末日	2,826,718,004	-	13,157	-
9月末日	2,971,192,804	-	13,126	-

三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

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 (2018年 9月18日)	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
第2期 (2019年 9月17日)	758,503,160	758,503,160	10,399	10,399

第3期 (2020年 9月15日)	1,374,244,182	1,374,244,182	10,821	10,821
第4期 (2021年 9月15日)	2,928,938,274	2,928,938,274	13,753	13,753
2020年 9月末日	1,399,620,696	-	10,683	-
10月末日	1,433,669,547	-	10,503	-
11月末日	1,587,798,702	-	11,499	-
12月末日	1,733,706,695	-	11,795	-
2021年 1月末日	1,828,030,400	-	12,051	-
2月末日	1,926,139,920	-	12,383	-
3月末日	2,101,526,959	-	12,951	-
4月末日	2,260,589,850	-	13,107	-
5月末日	2,398,676,111	-	13,260	-
6月末日	2,629,411,874	-	13,500	-
7月末日	2,700,254,849	-	13,328	-
8月末日	2,848,794,256	-	13,570	-
9月末日	2,965,466,619	-	13,566	-

【分配の推移】

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	-
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	-
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	-
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	-

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	-
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	-
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	-
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	-

三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	-
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	-
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	-
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	-

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	-
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	-
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	-
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	-

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	-
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	-
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	-
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	-

【収益率の推移】

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)

	収益率(%)
第1期	1.1
第2期	4.4
第3期	0.2
第4期	6.1

(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・資産最適化ファンド(2やや安定型)

	収益率(%)
第1期	0.2
第2期	2.9
第3期	1.9
第4期	12.1

(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・資産最適化ファンド(3バランス型)

	収益率(%)
第1期	2.7
第2期	1.7
第3期	3.0
第4期	17.6

(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・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	収益率(%)
第1期	3.7
第2期	0.9
第3期	3.4
第4期	23.0

(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・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

	収益率(%)
第1期	4.5
第2期	0.4
第3期	4.1
第4期	27.1

(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・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	197,260,985	6,814,601
第2期	1,242,016,819	118,444,252
第3期	2,142,530,997	364,184,551
第4期	3,074,461,766	692,313,957

(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・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	235,257,377	140,052,522
第2期	593,034,885	28,199,968
第3期	853,822,366	158,356,618
第4期	1,391,060,134	241,319,938

(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・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	426,008,460	139,473,752
第2期	1,111,549,352	100,006,600
第3期	2,085,818,899	277,142,914
第4期	2,996,875,916	487,585,479

（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・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	411,158,724	219,693,175
第2期	485,641,046	69,477,173
第3期	839,231,080	145,565,103
第4期	1,186,838,860	291,846,934

（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・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	762,271,388	307,261,790
第2期	481,502,084	207,078,502
第3期	843,783,098	303,192,666
第4期	1,274,331,650	414,699,900

（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9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
株式	日本	197,866,656,100	98.12
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,785,028,055	1.88
合計（純資産総額）		201,651,684,155	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （%）
株価指数先物取引	買建	日本	3,857,950,000	1.91
合計	買建	-	3,857,950,000	1.91

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	216,720,947,892	66.82
	イギリス	13,214,681,996	4.07
	カナダ	11,114,072,682	3.43
	スイス	10,272,647,708	3.17
	フランス	10,079,001,420	3.11
	ドイツ	8,907,372,436	2.75
	オランダ	6,577,996,694	2.03
	アイルランド	6,016,994,093	1.86
	オーストラリア	5,733,253,171	1.77
	スウェーデン	3,344,502,779	1.03
	デンマーク	2,588,486,142	0.80
	スペイン	2,405,531,316	0.74
	香港	2,152,228,003	0.66
	イタリア	1,810,982,419	0.56
	フィンランド	1,252,214,481	0.39
	ジャージー	1,249,872,338	0.39
	シンガポール	863,998,448	0.27
	ベルギー	793,614,240	0.24
	バミューダ	743,539,019	0.23
	ノルウェー	645,100,114	0.20
	ケイマン諸島	616,882,867	0.19
	イスラエル	610,789,627	0.19
	ニュージーランド	315,518,455	0.10
	ルクセンブルグ	314,666,495	0.10
	オランダ領キュラソー	249,308,125	0.08
	オーストリア	212,324,253	0.07
	ポルトガル	149,130,227	0.05
	リベリア	120,657,180	0.04
	パナマ	115,384,702	0.04
	マン島	94,007,806	0.03
パプアニューギニア	36,626,484	0.01	
小計	309,322,333,612	95.37	
投資証券	アメリカ	6,156,276,908	1.90
	オーストラリア	694,149,427	0.21
	イギリス	185,233,214	0.06
	香港	154,875,404	0.05
	フランス	151,106,746	0.05
	シンガポール	139,710,214	0.04
	カナダ	34,903,236	0.01

	小計	7,516,255,149	2.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	7,515,015,280	2.31
合計(純資産総額)		324,353,604,041	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	イギリス	329,930,598	0.10
合計	買建	-	329,930,598	0.10
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,166,042,808	0.36
合計	買建	-	1,166,042,808	0.36
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,720,182,235	1.76
合計	買建	-	5,720,182,235	1.76
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	245,386,908	0.08
合計	買建	-	245,386,908	0.08

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	日本	763,720,054	0.24

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	2,482,203,641	16.11
	台湾	1,690,879,113	10.98
	韓国	1,486,557,371	9.65
	インド	1,447,485,933	9.40
	中国	749,292,537	4.86
	ブラジル	503,318,666	3.27
	南アフリカ	355,568,866	2.31
	タイ	192,030,867	1.25
	メキシコ	162,643,981	1.06
	マレーシア	157,266,980	1.02
	インドネシア	151,765,067	0.99
	香港	131,588,259	0.85
	ポーランド	80,293,779	0.52
	フィリピン	76,075,960	0.49
	バミューダ	73,157,353	0.47
	チリ	51,226,111	0.33
	アメリカ	44,046,760	0.29
	トルコ	30,154,309	0.20
	ルクセンブルグ	29,922,436	0.19
	ハンガリー	29,905,894	0.19
ギリシャ	21,692,929	0.14	
コロンビア	19,543,536	0.13	

	チェコ	13,734,597	0.09
	エジプト	8,374,034	0.05
	マン島	4,528,084	0.03
	シンガポール	3,314,230	0.02
	ペルー	2,207,400	0.01
	アルゼンチン	1,334,417	0.01
	小計	10,000,113,110	64.91
投資信託受益証券	香港	592,848,749	3.85
投資証券	アメリカ	1,094,253,581	7.10
	メキシコ	61,687,758	0.40
	ブラジル	23,640,307	0.15
	南アフリカ	4,511,684	0.03
	小計	1,184,093,330	7.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,628,492,804	23.55
合計(純資産総額)		15,405,547,993	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,623,741,283	23.52
合計	買建	-	3,623,741,283	23.52

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	日本	2,504,291,009	16.26

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	7,390,142,200	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	146,997,253	1.95
合計(純資産総額)		7,537,139,453	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	41,280,000	0.55
合計	買建	-	41,280,000	0.55

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	11,425,757,340	75.01
	オーストラリア	1,027,647,851	6.75

	イギリス	835,567,126	5.49
	シンガポール	527,229,931	3.46
	カナダ	299,696,687	1.97
	フランス	295,815,328	1.94
	香港	217,653,810	1.43
	ベルギー	199,976,707	1.31
	スペイン	63,165,007	0.41
	ニュージーランド	62,072,829	0.41
	ドイツ	40,117,096	0.26
	ガーンジィ	26,178,209	0.17
	オランダ	24,550,173	0.16
	韓国	23,898,887	0.16
	アイルランド	16,018,243	0.11
	イスラエル	10,165,680	0.07
	イタリア	4,280,010	0.03
	小計	15,099,790,914	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	133,094,506	0.87
合計(純資産総額)		15,232,885,420	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	日本	5,310,692	0.03
為替予約取引	買建	日本	21,600,956	0.14

国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	111,055,056,960	80.93
地方債証券	日本	9,297,606,378	6.78
特殊債券	日本	11,042,969,959	8.05
社債券	日本	5,047,725,900	3.68
	フランス	201,163,400	0.15
	小計	5,248,889,300	3.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	582,358,323	0.42
合計(純資産総額)		137,226,880,920	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	73,164,827,897	45.86
	フランス	15,985,442,246	10.02
	イタリア	14,837,336,454	9.30

	ドイツ	11,753,702,814	7.37
	イギリス	9,552,797,056	5.99
	スペイン	9,487,950,206	5.95
	ベルギー	3,748,814,777	2.35
	カナダ	3,055,831,158	1.92
	オランダ	2,973,659,594	1.86
	オーストラリア	2,880,595,690	1.81
	オーストリア	2,318,152,676	1.45
	アイルランド	1,324,751,336	0.83
	メキシコ	1,100,905,347	0.69
	フィンランド	986,827,956	0.62
	ポーランド	893,905,641	0.56
	デンマーク	802,417,583	0.50
	マレーシア	753,780,072	0.47
	イスラエル	718,530,517	0.45
	シンガポール	704,021,340	0.44
	スウェーデン	458,980,202	0.29
	ノルウェー	388,433,326	0.24
	小計	157,891,663,888	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,661,550,952	1.04
合計(純資産総額)		159,553,214,840	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	11,974,415,764	45.86
	フランス	2,628,059,488	10.07
	イタリア	2,438,440,085	9.34
	ドイツ	1,940,462,684	7.43
	イギリス	1,562,994,491	5.99
	スペイン	1,533,828,689	5.87
	ベルギー	607,788,647	2.33
	カナダ	501,119,894	1.92
	オランダ	477,180,815	1.83
	オーストラリア	472,426,329	1.81
	オーストリア	379,313,826	1.45
	シンガポール	238,278,548	0.91
	アイルランド	211,647,788	0.81
	メキシコ	179,672,844	0.69
	フィンランド	164,545,826	0.63
	ポーランド	146,543,397	0.56
	デンマーク	131,228,326	0.50
	イスラエル	118,726,414	0.45
	スウェーデン	75,075,513	0.29
ノルウェー	62,405,051	0.24	

	小計	25,844,154,419	98.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	266,688,734	1.02
合計(純資産総額)		26,110,843,153	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	日本	26,331,222,915	100.84

(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9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,600,500	1,411.10	5,080,658,349	2,000.00	7,201,000,000	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	445,400	9,739.65	4,338,040,110	12,455.00	5,547,457,000	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	69,800	53,726.46	3,750,106,908	67,000.00	4,676,600,000	2.32
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	553,300	7,300.64	4,039,444,112	6,480.00	3,585,384,000	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	486,300	4,430.41	2,154,508,383	6,832.00	3,322,401,600	1.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,792,700	452.71	2,169,703,217	657.90	3,153,117,330	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	815,700	2,475.79	2,019,501,903	3,085.00	2,516,434,500	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	128,800	17,305.44	2,228,940,672	18,900.00	2,434,320,000	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	138,700	13,919.23	1,930,597,201	17,475.00	2,423,782,500	1.20
日本	株式	日立製作所	電気機器	341,900	4,023.36	1,375,586,784	6,640.00	2,270,216,000	1.13
日本	株式	ダイキン工業	機械	90,600	23,608.75	2,138,952,750	24,460.00	2,216,076,000	1.10
日本	株式	任天堂	その他製品	40,700	59,392.57	2,417,277,599	54,310.00	2,210,417,000	1.10
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	590,800	3,744.96	2,212,522,368	3,699.00	2,185,369,200	1.08
日本	株式	日本電産	電気機器	171,100	13,309.11	2,277,188,721	12,420.00	2,125,062,000	1.05
日本	株式	村田製作所	電気機器	208,800	9,136.78	1,907,759,664	9,960.00	2,079,648,000	1.03
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	41,600	35,734.78	1,486,566,848	49,670.00	2,066,272,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	558,500	3,018.25	1,685,692,625	3,691.00	2,061,423,500	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	559,800	2,884.33	1,614,647,934	3,455.00	1,934,109,000	0.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	485,200	3,056.27	1,482,902,204	3,944.00	1,913,628,800	0.95
日本	株式	第一三共	医薬品	558,300	3,661.16	2,044,025,628	2,979.50	1,663,454,850	0.82
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	489,600	2,774.88	1,358,581,248	3,277.00	1,604,419,200	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	62,400	25,394.51	1,584,617,424	24,565.00	1,532,856,000	0.76

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	952,600	1,336.47	1,273,121,322	1,584.50	1,509,394,700	0.75
日本	株式	三菱商事	卸売業	425,300	2,446.87	1,040,653,811	3,536.00	1,503,860,800	0.75
日本	株式	S M C	機械	20,800	66,320.31	1,379,462,448	70,080.00	1,457,664,000	0.72
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	273,700	3,359.69	919,547,153	5,085.00	1,391,764,500	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	230,700	5,191.16	1,197,600,612	6,021.00	1,389,044,700	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	543,000	1,797.02	975,781,860	2,464.00	1,337,952,000	0.66
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	72,200	17,701.45	1,278,044,690	18,130.00	1,308,986,000	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	64,000	14,615.10	935,366,400	20,310.00	1,299,840,000	0.64

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式（国内）	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.20
	建設業	2.27
	食料品	3.37
	繊維製品	0.47
	パルプ・紙	0.22
	化学	6.92
	医薬品	5.06
	石油・石炭製品	0.40
	ゴム製品	0.70
	ガラス・土石製品	0.75
	鉄鋼	0.80
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.59
	機械	5.27
	電気機器	18.25
	輸送用機器	7.56
	精密機器	2.92
	その他製品	2.16
	電気・ガス業	1.12
	陸運業	3.23
	海運業	0.47
	空運業	0.48
	倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	8.28	
卸売業	4.68	
小売業	4.42	
銀行業	4.91	
証券、商品先物取引業	0.72	
保険業	1.99	

	その他金融業	1.12
	不動産業	1.97
	サービス業	5.92
合計		98.12

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9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	871,554	13,098.00	11,415,612,200	15,985.53	13,932,255,751	4.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	373,728	24,208.30	9,047,318,047	31,785.28	11,879,049,123	3.66
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	23,690	359,732.99	8,522,074,494	369,461.35	8,752,539,390	2.70
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	125,292	31,188.75	3,907,700,413	38,009.15	4,762,242,572	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・娯楽	15,714	201,663.46	3,168,939,671	300,736.87	4,725,779,244	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS C	メディア・娯楽	15,230	202,124.16	3,078,350,993	301,111.81	4,585,932,811	1.41
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	42,736	67,239.86	2,873,562,527	87,444.22	3,737,015,980	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	130,062	14,982.62	1,948,669,783	22,962.63	2,986,565,114	0.92
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	157,992	13,700.13	2,164,510,496	18,573.12	2,934,405,007	0.90
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	137,048	16,197.12	2,219,782,528	18,357.12	2,515,806,362	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	88,428	23,636.11	2,090,094,042	25,370.03	2,243,420,623	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,467	37,909.65	1,875,276,835	44,813.89	2,216,808,558	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	69,189	26,020.28	1,800,317,208	31,034.30	2,147,231,961	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	55,494	30,959.31	1,718,055,971	37,709.21	2,092,634,655	0.65

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	128,383	15,498.07	1,989,688,477	15,894.88	2,040,632,173	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	150,863	12,293.95	1,854,702,672	13,481.70	2,033,890,431	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	402,525	3,275.90	1,318,631,003	4,820.39	1,940,329,255	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	21,953	48,109.40	1,056,145,610	84,110.32	1,846,473,898	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	46,455	37,962.23	1,763,535,540	39,529.02	1,836,320,847	0.57
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	94,639	16,556.05	1,566,848,093	19,326.35	1,829,026,021	0.56
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	58,324	23,862.70	1,391,768,070	28,987.28	1,690,654,118	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	25,076	53,531.34	1,342,351,781	64,656.18	1,621,318,469	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	23,263	55,086.06	1,281,466,978	67,046.80	1,559,709,596	0.48
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	50,706	27,399.52	1,389,320,193	30,274.36	1,535,091,698	0.47
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	239,809	5,810.15	1,393,327,197	6,259.69	1,501,128,944	0.46
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	36,777	36,396.50	1,338,554,000	40,525.43	1,490,403,886	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	220,715	4,559.62	1,006,376,469	6,701.77	1,479,181,077	0.46
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	290,792	4,172.41	1,213,303,853	4,871.88	1,416,703,031	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	221,654	4,817.16	1,067,743,188	6,209.32	1,376,320,969	0.42

アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	20,664	50,835.18	1,050,458,225	64,868.83	1,340,449,544	0.41
------	----	---------------------------------	--	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式（外国）	エネルギー	3.27
	素材	3.95
	資本財	6.17
	商業・専門サービス	1.23
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	2.09
	耐久消費財・アパレル	1.83
	消費者サービス	1.87
	小売	5.61
	食品・生活必需品小売り	1.40
	食品・飲料・タバコ	3.68
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエ ス	7.39
	銀行	6.08
	各種金融	4.63
	保険	2.96
	不動産	0.39
	ソフトウェア・サービス	12.17
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.82
半導体・半導体製造装置	4.56	
電気通信サービス	1.59	
公益事業	2.74	
メディア・娯楽	7.36	
投資証券	-	2.32
合計		97.68

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2021年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	330,000	2,040.54	673,377,954	2,335.31	770,652,960	5.00

香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	691,400	892.2263	616,885,283	857.4613	592,848,749	3.85
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	77,100	8,493.55	654,852,473	6,686.70	515,544,570	3.35
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	-	86,125	4,163.42	358,574,892	5,297.17	456,219,076	2.96
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	63,941	6,663.00	426,038,710	7,017.27	448,691,261	2.91
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	203,300	3,148.93	640,177,956	2,132.55	433,548,228	2.81
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ET	-	83,225	3,601.59	299,741,961	4,627.89	385,156,311	2.50
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	54,000	4,364.38	235,676,379	3,595.00	194,130,000	1.26
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	38,050	2,947.19	112,140,495	3,817.05	145,238,885	0.94
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	45,640	1,726.31	78,788,674	2,555.30	116,623,777	0.76
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,288,000	88.01	113,351,212	80.10	103,164,420	0.67
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	23,102	3,487.10	80,559,037	4,147.14	95,807,216	0.62
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	56,694	1,386.82	78,624,529	1,663.13	94,289,560	0.61
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	11,657	9,849.26	114,812,867	8,015.71	93,439,136	0.61
ケイマン諸島	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	48,000	1,232.13	59,142,386	1,809.00	86,832,192	0.56
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	38,065	2,005.61	76,343,407	2,260.78	86,056,742	0.56
ブラジル	株式	VALE SA	素材	53,100	1,747.70	92,803,028	1,566.65	83,189,091	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	11,017	6,034.28	66,479,706	6,676.35	73,553,347	0.48
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	20,000	2,995.52	59,910,416	3,676.10	73,522,064	0.48
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	68,018	758.49	51,590,843	1,071.35	72,870,744	0.47

ケイマン諸島	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	18,231	5,601.83	102,126,933	3,931.75	71,679,726	0.47
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,472	4,141.76	51,655,981	5,725.77	71,411,790	0.46
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	167,800	351.03	58,903,530	422.77	70,941,141	0.46
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	18,439	3,017.20	55,634,216	3,825.43	70,537,022	0.46
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,310	9,942.46	72,679,370	9,470.00	69,225,700	0.45
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	85,500	1,308.91	111,911,577	784.43	67,068,679	0.44
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,680	17,351.30	63,852,797	17,002.89	62,570,621	0.41
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	192,200	384.23	73,849,697	316.36	60,804,392	0.39
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,649	28,243.52	46,573,560	36,648.90	60,434,036	0.39
ケイマン諸島	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	5,914	15,782.31	93,336,573	9,967.60	58,948,358	0.38

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	2.68
	素材	4.87
	資本財	1.72
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.23
	自動車・自動車部品	2.65
	耐久消費財・アパレル	1.25
	消費者サービス	0.83
	小売	6.27
	食品・生活必需品小売り	0.84
	食品・飲料・タバコ	1.91
	家庭用品・パーソナル用品	0.78
	ヘルスケア機器・サービス	0.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.59
銀行	7.61	

	各種金融	1.62
	保険	1.88
	不動産	1.28
	ソフトウェア・サービス	2.19
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.29
	半導体・半導体製造装置	7.02
	電気通信サービス	1.66
	公益事業	1.53
	メディア・娯楽	5.44
投資信託受益証券	-	3.85
投資証券	-	7.69
合計		76.45

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド 投資法人	738	698,043.52	515,156,116	725,000.00	535,050,000	7.10
日本	投資証券	ジャパンリアルエ ステイト投資法人	651	658,118.81	428,435,345	668,000.00	434,868,000	5.77
日本	投資証券	G L P 投資法人	2,109	192,363.76	405,695,160	183,200.00	386,368,800	5.13
日本	投資証券	日本プロロジス リート投資法人	1,031	377,521.39	389,224,557	372,500.00	384,047,500	5.10
日本	投資証券	日本都市ファンド 投資法人	3,286	106,939.82	351,404,237	107,300.00	352,587,800	4.68
日本	投資証券	野村不動産マス ターファンド投資 法人	2,106	167,196.77	352,116,400	160,600.00	338,223,600	4.49
日本	投資証券	大和ハウスリート 投資法人	978	315,229.28	308,294,238	326,500.00	319,317,000	4.24
日本	投資証券	オリックス不動産 投資法人	1,298	196,898.16	255,573,814	194,000.00	251,812,000	3.34
日本	投資証券	アドバンス・レジ デンス投資法人	651	360,804.92	234,884,003	362,000.00	235,662,000	3.13
日本	投資証券	ユナイテッド・ アーバン投資法人	1,467	153,519.64	225,213,314	150,800.00	221,223,600	2.94
日本	投資証券	産業ファンド投資 法人	925	211,909.74	196,016,514	202,700.00	187,497,500	2.49
日本	投資証券	積水ハウス・リ ート投資法人	1,917	92,374.66	177,082,229	92,400.00	177,130,800	2.35
日本	投資証券	日本プライムリア ルティ投資法人	428	399,365.21	170,928,308	405,000.00	173,340,000	2.30
日本	投資証券	アクティブア・ブ ロパティーズ投資 法人	347	450,003.60	156,151,250	457,000.00	158,579,000	2.10
日本	投資証券	ケネディクス・オ フィス投資法人	201	771,870.41	155,145,953	767,000.00	154,167,000	2.05

日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	797	191,152.45	152,348,505	187,500.00	149,437,500	1.98
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	242	613,397.87	148,442,284	590,000.00	142,780,000	1.89
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	426	338,613.01	144,249,143	331,000.00	141,006,000	1.87
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	225	662,491.57	149,060,604	625,000.00	140,625,000	1.87
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,999	62,609.96	125,157,303	67,100.00	134,132,900	1.78
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	2,871	40,475.63	116,205,529	43,900.00	126,036,900	1.67
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	766	156,778.72	120,092,503	151,000.00	115,666,000	1.53
日本	投資証券	イオンリート投資法人	764	149,372.13	114,120,304	149,800.00	114,447,200	1.52
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	228	472,527.21	107,736,205	489,000.00	111,492,000	1.48
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	136	767,000.00	104,312,000	752,000.00	102,272,000	1.36
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	293	344,197.19	100,849,776	343,500.00	100,645,500	1.34
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	573	185,157.64	106,095,325	175,500.00	100,561,500	1.33
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	445	227,342.74	101,167,518	217,200.00	96,654,000	1.28
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	842	119,000.00	100,198,000	111,800.00	94,135,600	1.25
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	588	153,792.85	90,430,197	153,400.00	90,199,200	1.20

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.05
合計	98.05

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	66,174	14,648.47	969,347,759	14,151.16	936,439,179	6.15

アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	8,039	91,919.33	738,939,480	89,712.83	721,201,469	4.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	13,619	35,587.23	484,662,454	33,835.65	460,807,777	3.03
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,263	14,832.62	434,046,886	14,980.49	438,374,137	2.88
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,246	18,073.09	456,273,244	16,425.38	414,675,123	2.72
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	37,750	9,463.29	357,239,381	9,377.78	354,011,074	2.32
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,579	24,836.95	312,423,998	25,182.00	316,764,378	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	30,442	9,154.53	278,682,320	9,127.08	277,846,447	1.82
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,331	22,879.90	282,132,045	21,582.65	266,135,691	1.75
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	35,052	7,916.68	277,495,536	7,392.32	259,115,460	1.70
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	151,215	1,849.15	279,619,374	1,710.58	258,665,294	1.70
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,954	19,926.57	238,202,264	19,251.36	230,130,747	1.51
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	35,357	6,114.55	216,192,050	6,313.41	223,223,138	1.47
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	51,098	4,491.87	229,525,480	4,359.28	222,750,693	1.46
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	10,450	22,033.39	230,248,951	21,145.05	220,965,726	1.45
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,358	20,856.60	216,032,617	21,259.20	220,202,835	1.45
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,810	35,297.25	205,077,038	36,254.25	210,637,166	1.38
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	106,973	1,917.50	205,120,199	1,814.19	194,068,897	1.27
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	33,991	5,562.50	189,075,083	5,441.55	184,963,739	1.21
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,364	3,936.99	190,408,611	3,806.40	184,092,690	1.21
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	54,810	3,303.74	181,077,812	3,231.13	177,098,257	1.16
香港	投資証券	LINK REIT	186,200	1,045.86	194,739,229	938.30	174,710,529	1.15
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	12,626	12,775.36	161,301,721	12,447.74	157,165,195	1.03
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,903	15,978.61	142,257,538	16,798.07	149,553,242	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	24,928	5,841.32	145,612,386	5,991.08	149,345,582	0.98
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	16,563	8,583.15	142,162,732	8,276.48	137,083,404	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,268	9,199.98	140,465,334	8,888.69	135,712,463	0.89

アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	55,655	2,421.66	134,777,220	2,400.68	133,610,068	0.88
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	26,267	5,127.04	134,672,036	4,959.18	130,262,654	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	53,657	2,257.02	121,104,677	2,314.51	124,189,426	0.82

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13
合計	99.13

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9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 2 7 2 年国債	3,300,000,000	100.28	3,309,170,500	100.24	3,307,854,000	0.005	2023/08/01	2.41
日本	国債 証券	1 4 7 5 年国債	1,700,000,000	100.51	1,708,623,500	100.45	1,707,616,000	0.005	2026/03/20	1.24
日本	国債 証券	1 4 6 5 年国債	1,690,000,000	100.96	1,706,224,000	100.85	1,704,314,300	0.100	2025/12/20	1.24
日本	国債 証券	3 6 3 1 0年国債	1,660,000,000	100.78	1,672,967,600	100.34	1,665,594,200	0.100	2031/06/20	1.21
日本	国債 証券	4 2 5 2 年国債	1,590,000,000	100.23	1,593,663,000	100.22	1,593,434,400	0.005	2023/06/01	1.16
日本	国債 証券	3 6 0 1 0年国債	1,440,000,000	100.51	1,447,344,000	100.72	1,450,310,400	0.100	2030/09/20	1.06
日本	国債 証券	1 4 5 5 年国債	1,310,000,000	100.96	1,322,510,500	100.82	1,320,702,700	0.100	2025/09/20	0.96
日本	国債 証券	3 3 0 1 0年国債	1,285,000,000	102.18	1,312,961,600	101.81	1,308,207,100	0.800	2023/09/20	0.95
日本	国債 証券	1 4 4 5 年国債	1,230,000,000	100.89	1,240,947,000	100.78	1,239,630,900	0.100	2025/06/20	0.90
日本	国債 証券	3 5 8 1 0年国債	1,100,000,000	100.70	1,107,744,000	100.85	1,109,306,000	0.100	2030/03/20	0.81
日本	国債 証券	3 5 6 1 0年国債	1,070,000,000	100.93	1,079,932,400	100.92	1,079,811,900	0.100	2029/09/20	0.79
日本	国債 証券	3 5 7 1 0年国債	1,070,000,000	100.89	1,079,483,500	100.86	1,079,234,100	0.100	2029/12/20	0.79
日本	国債 証券	6 9 2 0 年国債	1,020,000,000	106.29	1,084,137,600	105.46	1,075,732,800	2.100	2024/03/20	0.78
日本	国債 証券	3 5 9 1 0年国債	1,060,000,000	100.68	1,067,207,300	100.78	1,068,299,800	0.100	2030/06/20	0.78
日本	国債 証券	6 4 2 0 年国債	1,025,000,000	104.72	1,073,421,000	103.98	1,065,774,500	1.900	2023/09/20	0.78
日本	国債 証券	6 5 2 0 年国債	1,020,000,000	105.22	1,073,244,000	104.47	1,065,604,200	1.900	2023/12/20	0.78

日本	国債証券	3 6 1 1 0年国債	990,000,000	100.38	993,762,000	100.60	995,910,300	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	3 2 9 1 0年国債	950,000,000	101.93	968,335,000	101.57	964,953,000	0.800	2023/06/20	0.70
日本	国債証券	3 6 2 1 0年国債	930,000,000	100.25	932,280,800	100.47	934,380,300	0.100	2031/03/20	0.68
日本	国債証券	8 4 2 0 年国債	850,000,000	109.69	932,373,500	108.90	925,624,500	2.000	2025/12/20	0.67
日本	国債証券	1 4 3 0 年国債	692,000,000	128.05	886,112,920	127.46	881,988,600	2.400	2034/03/20	0.64
日本	国債証券	1 4 8 5 年国債	840,000,000	100.55	844,655,500	100.43	843,578,400	0.005	2026/06/20	0.61
日本	国債証券	3 5 4 1 0年国債	835,000,000	100.93	842,765,500	100.97	843,116,200	0.100	2029/03/20	0.61
日本	国債証券	7 0 2 0 年国債	780,000,000	107.78	840,660,600	106.86	833,476,800	2.400	2024/06/20	0.61
日本	国債証券	3 3 3 1 0年国債	815,000,000	102.08	831,927,550	101.77	829,409,200	0.600	2024/03/20	0.60
日本	国債証券	8 8 2 0 年国債	742,000,000	112.20	832,501,740	111.30	825,823,740	2.300	2026/06/20	0.60
日本	国債証券	3 3 8 1 0年国債	805,000,000	102.01	821,204,650	101.77	819,280,700	0.400	2025/03/20	0.60
日本	国債証券	3 4 4 1 0年国債	811,000,000	101.02	819,231,650	100.92	818,485,530	0.100	2026/09/20	0.60
日本	国債証券	3 5 5 1 0年国債	810,000,000	100.88	817,128,000	100.97	817,824,600	0.100	2029/06/20	0.60
日本	国債証券	9 2 2 0 年国債	734,000,000	112.23	823,753,520	111.40	817,646,640	2.100	2026/12/20	0.60

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	80.93
地方債証券	6.78
特殊債券	8.05
社債券	3.82
合計	99.58

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9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.625 05/15/26	14,950,000	11,728.32	1,753,383,488	11,539.96	1,725,223,912	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債証券	T 2.25 03/31/26	13,300,000	12,014.79	1,597,967,092	11,850.31	1,576,091,687	2.250	2026/03/31	0.99
アメリカ	国債証券	T 2.875 05/15/28	9,000,000	12,734.23	1,146,080,596	12,329.55	1,109,659,939	2.875	2028/05/15	0.70

アメリカ	国債証券	T 2.5 02/28/26	8,500,000	12,114.68	1,029,747,549	11,971.41	1,017,569,924	2.500	2026/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.125 02/15/31	8,500,000	10,653.76	905,569,902	10,818.63	919,583,964	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.625 08/15/30	8,800,000	10,901.01	959,288,704	10,394.57	914,722,160	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.125 08/15/23	8,000,000	11,182.38	894,590,554	11,163.12	893,049,971	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25 06/15/23	7,700,000	11,217.36	863,736,483	11,191.55	861,749,528	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/15/24	7,700,000	11,130.11	857,018,334	11,127.65	856,828,742	0.125	2024/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.375 09/30/27	7,800,000	11,003.97	858,310,003	10,667.32	832,050,885	0.375	2027/09/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.625 05/15/30	7,500,000	10,932.31	819,923,301	10,428.59	782,144,526	0.625	2030/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.625 12/31/27	7,200,000	10,804.26	777,906,932	10,784.05	776,451,715	0.625	2027/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.125 03/31/24	6,500,000	11,899.37	773,459,012	11,667.66	758,397,900	2.125	2024/03/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25 11/15/24	6,300,000	12,061.13	759,851,110	11,780.81	742,191,100	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.875 11/15/30	7,000,000	10,763.74	753,461,942	10,601.73	742,121,374	0.875	2030/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75 01/31/28	6,700,000	10,727.53	718,744,644	10,857.47	727,450,565	0.750	2028/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 3 08/15/48	5,400,000	14,666.77	792,005,377	13,324.97	719,548,453	3.000	2048/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.75 06/30/24	6,200,000	11,794.13	731,236,035	11,583.27	718,162,883	1.750	2024/06/30	0.45
イタリア	国債証券	BTPS 3.5 03/01/30	4,400,000	16,596.11	730,228,752	16,062.77	706,762,011	3.500	2030/03/01	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.5 05/15/24	5,700,000	12,066.38	687,783,375	11,795.25	672,329,181	2.500	2024/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375 08/15/24	5,600,000	12,066.38	675,717,000	11,791.78	660,339,639	2.375	2024/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.125 10/15/23	5,700,000	11,177.14	637,096,733	11,152.60	635,698,437	0.125	2023/10/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875 02/15/51	5,800,000	10,512.65	609,733,444	10,656.35	618,068,351	1.875	2051/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.75 02/15/24	5,100,000	12,098.73	617,035,073	11,823.23	602,984,668	2.750	2024/02/15	0.38
フランス	国債証券	FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000	15,988.91	615,572,890	15,444.90	594,628,615	2.750	2027/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRTR 0 11/25/29	4,500,000	13,458.69	605,641,068	13,056.64	587,548,972	0.000	2029/11/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.75 02/15/28	4,800,000	12,830.58	615,867,780	12,230.73	587,075,016	2.750	2028/02/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2 11/15/26	5,000,000	12,168.68	608,433,846	11,733.58	586,679,044	2.000	2026/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.375 05/15/27	4,900,000	12,475.58	611,303,542	11,964.47	586,259,120	2.375	2027/05/15	0.37

アメリカ	国債証券	T 2.5 08/15/23	5,000,000	11,893.25	594,662,437	11,668.44	583,422,172	2.500	2023/08/15	0.37
------	------	-------------------	-----------	-----------	-------------	-----------	-------------	-------	------------	------

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.96
合計	98.96

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.125 01/31/23	1,650,000	11,186.32	184,574,223	11,184.05	184,536,885	0.125	2023/01/31	0.71
アメリカ	国債証券	T 0.125 05/15/23	1,600,000	11,179.32	178,869,143	11,173.20	178,771,159	0.125	2023/05/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 0.5 03/31/25	1,570,000	11,167.52	175,330,024	11,124.62	174,656,599	0.500	2025/03/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.25 03/15/24	1,460,000	11,161.40	162,956,394	11,152.60	162,828,020	0.250	2024/03/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.5 06/30/27	1,340,000	10,921.38	146,346,503	10,795.80	144,663,762	0.500	2027/06/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/15/24	1,300,000	11,133.85	144,740,102	11,127.65	144,659,398	0.125	2024/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.625 05/15/31	1,220,000	11,554.43	140,964,024	11,297.76	137,832,725	1.625	2031/05/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.875 11/15/30	1,300,000	10,835.69	140,863,997	10,601.73	137,822,540	0.875	2030/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/28/23	1,200,000	11,183.69	134,204,320	11,181.48	134,177,754	0.125	2023/02/28	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25 08/31/24	1,150,000	11,461.74	131,810,062	11,430.61	131,452,054	1.250	2024/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.5 03/31/23	1,150,000	11,427.21	131,412,879	11,408.79	131,201,073	1.500	2023/03/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625 08/15/30	1,190,000	10,611.42	126,275,838	10,394.57	123,695,383	0.625	2030/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.125 09/15/23	1,100,000	11,162.71	122,789,791	11,159.21	122,751,281	0.125	2023/09/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.125 02/29/28	1,100,000	11,268.07	123,948,776	11,110.63	122,216,975	1.125	2028/02/29	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875 02/15/41	1,110,000	11,321.84	125,672,475	10,928.76	121,309,282	1.875	2041/02/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125 02/15/31	1,120,000	11,059.97	123,871,655	10,818.63	121,168,710	1.125	2031/02/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.25 06/30/28	1,080,000	11,327.09	122,332,580	11,154.39	120,467,464	1.250	2028/06/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2 02/15/23	1,000,000	11,495.85	114,958,453	11,477.84	114,778,436	2.000	2023/02/15	0.44

アメリカ	国債証券	T 0.125 01/15/24	1,030,000	11,151.71	114,862,600	11,132.01	114,659,712	0.125	2024/01/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75 03/31/26	1,020,000	11,190.69	114,145,021	11,103.25	113,253,123	0.750	2026/03/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.375 04/30/25	1,010,000	11,105.00	112,160,494	11,057.70	111,682,729	0.375	2025/04/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875 06/30/26	1,000,000	11,239.22	112,392,162	11,140.40	111,404,048	0.875	2026/06/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.5 10/31/27	1,030,000	10,873.73	111,999,392	10,731.56	110,535,079	0.500	2027/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	11,190.69	109,668,744	11,177.56	109,540,110	0.375	2024/04/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375 06/30/23	950,000	11,432.45	108,608,305	11,412.71	108,420,709	1.375	2023/06/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875 11/30/23	900,000	11,838.60	106,547,402	11,807.90	106,271,061	2.875	2023/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75 11/15/23	900,000	11,801.44	106,212,954	11,770.29	105,932,615	2.750	2023/11/15	0.41
フランス	国債証券	FRTR 4.5 04/25/41	470,000	23,400.90	109,984,238	22,468.25	105,600,762	4.500	2041/04/25	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75 07/31/23	900,000	11,734.55	105,610,946	11,696.87	105,271,840	2.750	2023/07/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.125 04/30/23	940,000	11,180.63	105,097,951	11,174.43	105,039,628	0.125	2023/04/30	0.40

□ 種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.98
合計	98.98

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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9月30日現在

種類	地域	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	日本	大阪取引 所	TOPIX 先 物 0312 月 2021年 12月	買建	190	日本・円	3,900,979,200	3,857,950,000	1.91

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	ICE F T S - E U E 1 0 O I D X F U T D E C 2 1 2021年12 月		買建	31	イギリ ス・ポ ンド	2,173,907.00	327,020,830	2,193,250.00	329,930,597	0.10
	ドイ ツ	EUR EX EUR O S T O X X 5 0 D E C 2 1 2021年12 月		買建	221	ユーロ	9,176,572.00	1,191,669,639	8,979,230.00	1,166,042,807	0.36
	アメ リカ	シカゴ 商品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T D E C 2 1 2021年12 月	買建	235	アメリ カ・ド ル	52,115,707.50	5,832,789,983	51,109,562.50	5,720,182,235	1.76
	オー スト ラリ ア	シド ニー先 物取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S D E C 2 1 2021年 12月	買建	17	オー スト ラリ ア・ド ル	3,131,751.50	251,980,725	3,049,800.00	245,386,908	0.08

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年9月30日現在

種類	資産の名称	買建 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予 約取引	アメリカ・ド ル	買建	5,210,000.00	581,633,980	583,081,839	0.18

ユーロ	買建	570,000.00	74,328,684	74,022,537	0.02
イギリス・ポンド	買建	210,000.00	31,738,707	31,589,439	0.01
カナダ・ドル	買建	280,000.00	24,656,016	24,585,652	0.01
スイス・フラン	買建	180,000.00	21,618,378	21,579,390	0.01
スウェーデン・クローナ	買建	720,000.00	9,206,064	9,151,200	0.00
デンマーク・クローネ	買建	400,000.00	7,015,120	6,984,560	0.00
香港・ドル	買建	430,000.00	6,167,920	6,182,798	0.00
シンガポール・ドル	買建	30,000.00	2,467,488	2,465,916	0.00
ノルウェー・クローネ	買建	150,000.00	1,934,955	1,917,000	0.00
イスラエル・シケル	買建	40,000.00	1,392,004	1,390,292	0.00
ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	775,317	769,431	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	アメリ カ	I C E - U S	M S C I E 2 1 1 2 2021 年12月	買建	524	アメリ カ・ド ル	34,321,769.00	3,841,292,386	32,377,960.00	3,623,741,283	23.52

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年9月30日現在

種類	資産の名称	買建 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予 約取引	アメリカ・ ドル	買建	22,391,729.35	2,458,400,000	2,504,291,009	16.26

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	T R E I T 先 物 0 3 1 2 月 2 0 2 1 年 1 2 月	買建	20	日本・円	42,968,400	41,280,000	0.55

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	資産の名称	買建 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	40,308.86	4,500,000	4,511,202	0.03
	シンガポール・ドル	売建	9,726.49	800,000	799,490	0.01
	アメリカ・ドル	買建	165,312.15	18,500,000	18,500,876	0.12
	オーストラリア・ドル	買建	14,913.69	1,200,000	1,199,955	0.01
	イギリス・ポンド	買建	7,312.92	1,100,000	1,100,044	0.01
	ユーロ	買建	6,160.86	800,000	800,081	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	資産の名称	買建 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	108,680,000.00	11,975,159,024	12,162,563,556	46.58
	ユーロ	売建	81,320,000.00	10,582,515,583	10,560,890,156	40.45
	イギリス・ポンド	売建	10,810,000.00	1,636,445,041	1,626,058,577	6.23
	カナダ・ドル	売建	5,930,000.00	517,271,409	520,664,081	1.99
	オーストラリア・ドル	売建	6,020,000.00	485,561,160	484,369,200	1.86
	シンガポール・ドル	売建	2,950,000.00	241,569,305	242,473,775	0.93
	メキシコ・ペソ	売建	34,340,000.00	187,361,443	187,060,282	0.72
	ポーランド・ズロチ	売建	5,350,000.00	153,611,554	150,001,160	0.57
	デンマーク・クローネ	売建	7,710,000.00	134,909,117	134,638,188	0.52
	イスラエル・シケル	売建	3,520,000.00	120,802,017	122,344,640	0.47
	スウェーデン・クローナ	売建	6,010,000.00	76,726,905	76,387,100	0.29
	ノルウェー・クローネ	売建	4,990,000.00	63,160,376	63,772,200	0.24

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日: 2021年9月30日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■ 1 安定重視型

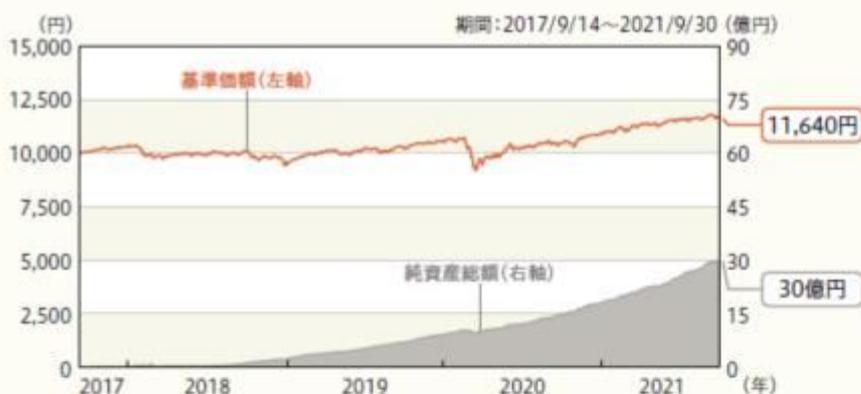


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■ 2 やや安定型

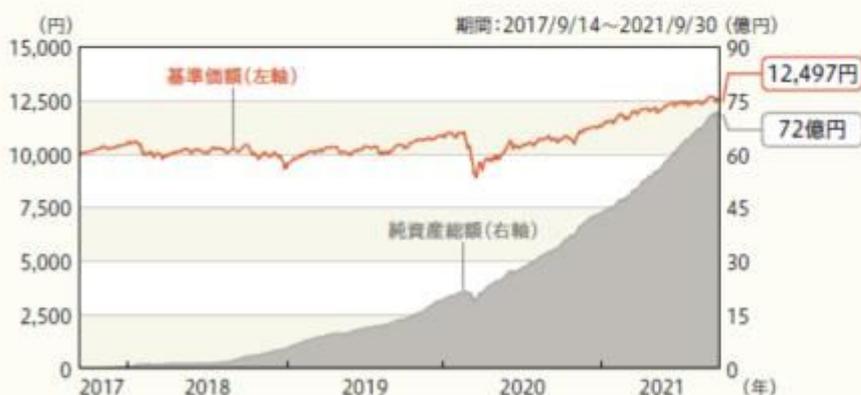


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■ 3 バランス型

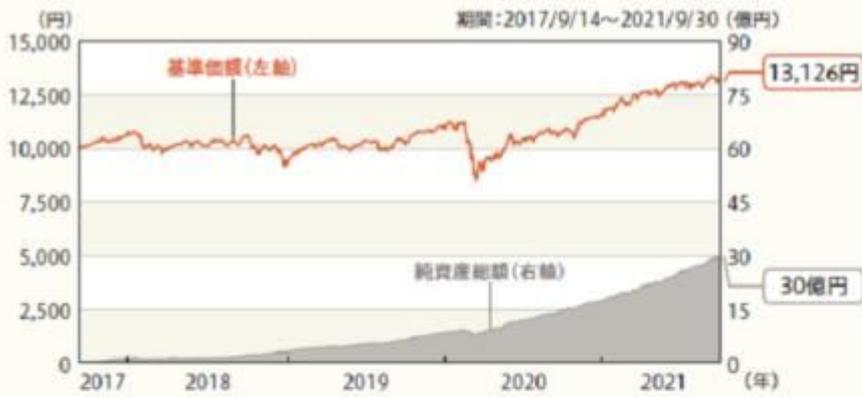


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■4 やや成長型

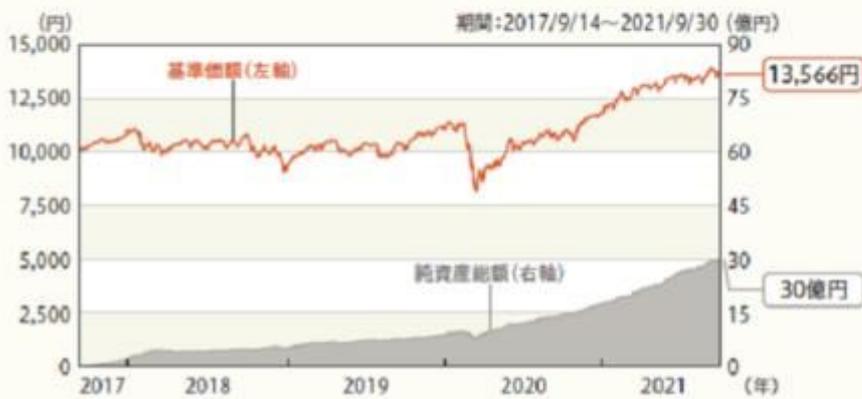


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■5 成長重視型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

■ 1 安定重視型

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	97.92
投資証券	アメリカ	0.93
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

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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	37.30
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	34.81
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	9.79
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)	8.24
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	2.00
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	1.96
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.93
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	1.90
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	0.93

■ 2 やや安定型

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	97.01
投資証券	アメリカ	1.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.12
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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	28.76
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	23.89
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	17.61
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)	14.95
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	3.01
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2.95
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	2.93
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	2.91
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	1.87

■ 3 バランス型

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	96.05
投資証券	アメリカ	2.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.07
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	24.50
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	21.00
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	19.89
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	14.88
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	4.94
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	3.97
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	3.91
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	2.96
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	2.88

※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。

■ 4 やや成長型

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	95.19
投資証券	アメリカ	3.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.10
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	外国株式インデックス・マザーファンド	29.84
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	25.66
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	10.94
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	8.88
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	8.00
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	5.00
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	4.89
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	3.71
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1.98

■ 5 成長重視型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	93.75
投資証券	アメリカ	4.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.43
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	34.67
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	29.77
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	14.70
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	4.82
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	3.89
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	3.75
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	3.00
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	2.98
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	0.99

※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。

■国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	427 2年国債	0.005	2023/08/01	2.41
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.24
日本	国債証券	146 5年国債	0.100	2025/12/20	1.24
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	1.21
日本	国債証券	425 2年国債	0.005	2023/06/01	1.16
日本	国債証券	360 10年国債	0.100	2030/09/20	1.06
日本	国債証券	145 5年国債	0.100	2025/09/20	0.96
日本	国債証券	330 10年国債	0.800	2023/09/20	0.95
日本	国債証券	144 5年国債	0.100	2025/06/20	0.90
日本	国債証券	358 10年国債	0.100	2030/03/20	0.81

■外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	0.52

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/01/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/05/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2025/03/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2024/03/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2027/06/30	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/02/28	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2024/08/31	0.50

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.32
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.25
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	1.20
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.13

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、指数先物取引の買建て(1.91%)を行っています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.30
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.66
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.70
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.41
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.15
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	0.92
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.90
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	0.78

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の買建て(2.30%)を行っています。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.00
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	3.85
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.35
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.96
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.91
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	2.81
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ET	—	2.50
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	1.26
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	0.94
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	0.76

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の買建て(23.52%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.10
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.77
日本	投資証券	GLP投資法人	5.13
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5.10
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.68
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.49
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.24
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.34
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.13
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.94

※上記のほか、Jリート・インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の買建て(0.55%)を行っています。

■外国リート・インデックス・マザーファンド

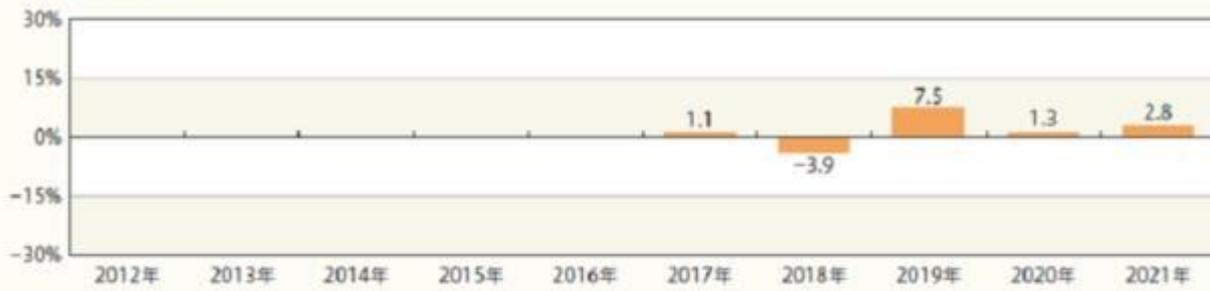
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.15
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.03
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.88
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.72
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.32
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	1.82
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.75
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1.70

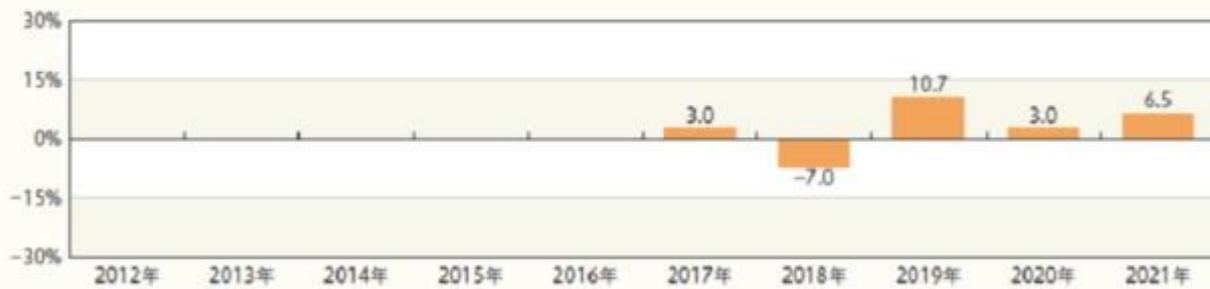
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

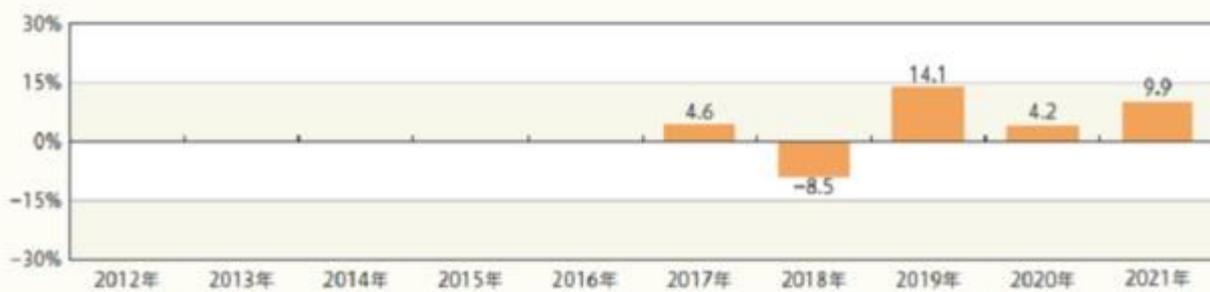
■ 1 安定重視型



■ 2 やや安定型



■ 3 バランス型



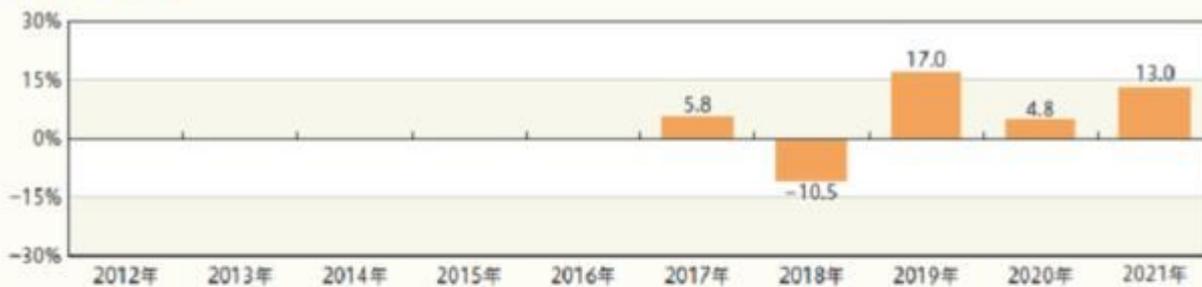
※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2021年のファンドの収益率は、年初から2021年9月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

■ 4 やや成長型



■ 5 成長重視型



※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2021年のファンドの収益率は、年初から2021年9月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

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。

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 申込不可日

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

- ・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

(ホ) 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DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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（借入れ公社債を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

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

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、「1安定重視型」は「最適安定重視」、「2やや安定型」は「最適やや安定」、「3バランス型」は「最適バランス」、「4やや成長型」は「最適やや成長」、「5成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2017年9月14日から2037年9月15日まで、もしくは下記「(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。

なお、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議の上、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年9月16日から翌年9月15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、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決

算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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、）に支払われます。

八 信託約款の変更等

（イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

（ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

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

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの

意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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。

二 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期(2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド(1 安定重視型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,891,875	712,078
金銭信託	-	69,555,463
コール・ローン	55,679,071	21,257,972
投資証券	31,620,878	56,709,973
親投資信託受益証券	3,136,841,464	5,900,624,977
流動資産合計	3,226,033,288	6,048,860,463
資産合計		
3,226,033,288		
負債の部		
流動負債		
未払金	995,773	-
未払解約金	11,282,503	8,504,664
未払受託者報酬	427,784	860,675
未払委託者報酬	12,120,451	24,385,732
未払利息	133	54
その他未払費用	86,331	172,357
流動負債合計	24,912,975	33,923,482
負債合計		
24,912,975		
純資産の部		
元本等		
元本	3,092,365,397	5,474,513,206
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	108,754,916	540,423,775
元本等合計	3,201,120,313	6,014,936,981
純資産合計		
3,201,120,313		
負債純資産合計		
3,226,033,288		
6,048,860,463		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日		自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		765,734		1,537,243
受取利息		188		-
有価証券売買等損益		40,153,642		310,121,613
為替差損益		665,996		1,651,391
営業収益合計		40,253,568		313,310,247
営業費用				
支払利息		18,878		55,168
受託者報酬		717,443		1,488,563
委託者報酬		20,327,448		42,175,874
その他費用		172,903		326,341
営業費用合計		21,236,672		44,045,946
営業利益又は営業損失()		19,016,896		269,264,301
経常利益又は経常損失()		19,016,896		269,264,301
当期純利益又は当期純損失()		19,016,896		269,264,301
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()		3,703,658		17,784,843
期首剰余金又は期首欠損金()		42,966,500		108,754,916
剰余金増加額又は欠損金減少額		54,626,229		208,602,748
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		54,626,229		208,602,748
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,558,367		28,413,347
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,558,367		28,413,347
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()		108,754,916		540,423,775

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>

（ 重要な会計上の見積りに関する注記 ）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（ 表示方法の変更 ）

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた31,620,878円は、「投資証券」31,620,878円として組替えております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項目	第3期 (2020年 9月15日現在)		第4期 (2021年 9月15日現在)	
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,092,365,397口		5,474,513,206口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.0352円 10,352円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.0987円 10,987円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日		第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
	分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,449,613円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,270,941円)、収益調整金(85,005,345円)、および分配準備積立金(38,160,422円)より、分配対象収益は145,886,321円(1万口当たり471.73円)であります。分配を行っておりません。		計算期間末における費用控除後の配当等収益(61,524,680円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(189,954,778円)、収益調整金(237,491,578円)、および分配準備積立金(51,452,739円)より、分配対象収益は540,423,775円(1万口当たり987.14円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
	1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク	

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2021年 9月15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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第3期（自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	932,086円
親投資信託受益証券	45,707,233円
合計	46,639,319円

第4期（自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	198,100円
親投資信託受益証券	291,778,466円
合計	291,976,566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4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
期首元本額	1,314,018,951円	3,092,365,397円

期中追加設定元本額	2,142,530,997円	3,074,461,766円
期中一部解約元本額	364,184,551円	692,313,957円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	4,566	517,190.82	
		米ドル 小計	4,566	517,190.82 (56,709,973)	
投資証券合計				56,709,973 (56,709,973)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	147,720,164	513,224,165	
		外国株式インデックス・マザーファンド	105,816,051	580,231,734	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,488,687,624	2,262,656,319	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	58,265,762	114,771,897	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	1,618,467,794	2,077,950,800	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	41,617,020	115,162,617	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	44,209,437	115,806,620	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	70,544,068	120,820,825	
親投資信託受益証券合計			3,575,327,920	5,900,624,977	
				5,957,334,950	

合計		(56,709,973)
----	--	--------------

(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 1銘柄	0.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,848,738	708,111
金銭信託	-	32,628,068
コール・ローン	21,455,680	9,971,992
投資証券	27,761,165	56,486,412
親投資信託受益証券	1,381,309,592	2,863,033,822
未収入金	-	1,000,000
流動資産合計	1,432,375,175	2,963,828,405
資産合計	1,432,375,175	2,963,828,405
負債の部		
流動負債		
未払金	995,773	-
未払解約金	1,780,457	2,898,436
未払受託者報酬	193,964	412,530
未払委託者報酬	5,495,616	11,688,481
未払利息	51	25
その他未払費用	39,107	82,572
流動負債合計	8,504,968	15,082,044
負債合計	8,504,968	15,082,044
純資産の部		
元本等		
元本	1,355,505,520	2,505,245,716
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	68,364,687	443,500,645
元本等合計	1,423,870,207	2,948,746,361
純資産合計	1,423,870,207	2,948,746,361
負債純資産合計	1,432,375,175	2,963,828,405

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日		自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		720,346		1,468,353
受取利息		190		-
有価証券売買等損益		34,089,296		252,693,601
為替差損益		605,212		1,566,353
営業収益合計		34,204,620		255,728,307
営業費用				
支払利息		8,417		24,210
受託者報酬		336,930		698,421
委託者報酬		9,546,207		19,788,684
その他費用		92,159		167,051
営業費用合計		9,983,713		20,678,366
営業利益又は営業損失()		24,220,907		235,049,941
経常利益又は経常損失()		24,220,907		235,049,941
当期純利益又は当期純損失()		24,220,907		235,049,941
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()		874,157		13,603,966
期首剰余金又は期首欠損金()		20,483,351		68,364,687
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,957,395		169,409,323
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		27,957,395		169,409,323
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,171,123		15,719,340
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,171,123		15,719,340
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()		68,364,687		443,500,645

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2 . デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>

（ 重要な会計上の見積りに関する注記 ）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（ 表示方法の変更 ）

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた27,761,165円は、「投資証券」27,761,165円として組替えております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,355,505,520口	2,505,245,716口
2. 1単位当たり純資産の額	1.0504円 (10,000口当たりの純資産額 10,504円)	1.1770円 (10,000口当たりの純資産額 11,770円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,016,186円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(12,078,878円)、収益調整金(37,030,348円)、および分配準備積立金(18,335,651円)より、分配対象収益は80,461,063円(1万口当たり593.56円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,666,558円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(187,779,417円)、収益調整金(183,865,476円)、および分配準備積立金(38,189,194円)より、分配対象収益は443,500,645円(1万口当たり1,770.26円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2021年 9月15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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第3期（自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	674,778円
親投資信託受益証券	32,701,782円
合計	33,376,560円

第4期（自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	269,371円
親投資信託受益証券	239,985,568円
合計	240,254,939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4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
期首元本額	660,039,772円	1,355,505,520円

期中追加設定元本額	853,822,366円	1,391,060,134円
期中一部解約元本額	158,356,618円	241,319,938円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	4,548	515,151.96	
		米ドル 小計	4,548	515,151.96 (56,486,412)	
投資証券合計				56,486,412 (56,486,412)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	132,908,125	461,762,698	
		外国株式インデックス・マザーファンド	93,505,212	512,726,479	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	556,977,233	846,549,696	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	42,748,577	84,206,146	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	543,175,156	697,382,582	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	30,947,562	85,638,093	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	32,511,723	85,164,458	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	52,317,201	89,603,670	
親投資信託受益証券合計			1,485,090,789	2,863,033,822	
				2,919,520,234	

合計		(56,486,412)	
----	--	--------------	--

(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 1銘柄	1.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	4,486,396	2,227,085
金銭信託	-	79,433,439
コール・ローン	46,319,976	24,276,941
投資証券	99,093,936	203,328,728
親投資信託受益証券	3,208,150,156	6,833,517,740
未収入金	-	500,000
流動資産合計	3,358,050,464	7,143,283,933
資産合計		
	3,358,050,464	7,143,283,933
負債の部		
流動負債		
未払金	2,903,337	-
未払解約金	1,799,066	9,891,453
未払受託者報酬	442,569	998,227
未払委託者報酬	12,539,315	28,283,084
未払利息	110	62
その他未払費用	89,284	199,918
流動負債合計	17,773,681	39,372,744
負債合計		
	17,773,681	39,372,744
純資産の部		
元本等		
元本	3,106,753,445	5,616,043,882
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	233,523,338	1,487,867,307
元本等合計	3,340,276,783	7,103,911,189
純資産合計		
	3,340,276,783	7,103,911,189
負債純資産合計		
	3,358,050,464	7,143,283,933

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2019年 9月18日	至 2020年 9月15日	自 2020年 9月16日	至 2021年 9月15日
営業収益				
受取配当金		2,360,316		5,300,491
受取利息		411		-
有価証券売買等損益		125,756,116		839,020,719
為替差損益		2,096,816		5,766,697
営業収益合計		126,020,027		850,087,907
営業費用				
支払利息		19,579		59,036
受託者報酬		737,982		1,681,215
委託者報酬		20,909,388		47,634,192
その他費用		194,909		384,244
営業費用合計		21,861,858		49,758,687
営業利益又は営業損失()		104,158,169		800,329,220
経常利益又は経常損失()		104,158,169		800,329,220
当期純利益又は当期純損失()		104,158,169		800,329,220
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()		955,449		43,955,365
期首剰余金又は期首欠損金()		57,559,319		233,523,338
剰余金増加額又は欠損金減少額		85,367,528		544,667,038
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		85,367,528		544,667,038
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,606,229		46,696,924
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,606,229		46,696,924
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()		233,523,338		1,487,867,307

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（ 重要な会計上の見積りに関する注記 ）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（ 表示方法の変更 ）

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた99,093,936円は、「投資証券」99,093,936円として組替えております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,106,753,445口	5,616,043,882口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0752円 10,752円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2649円 12,649円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(36,084,050円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(67,118,670円)、収益調整金(93,181,145円)、および分配準備積立金(39,033,845円)より、分配対象収益は235,417,710円(1万口当たり757.74円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(88,138,489円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(668,235,366円)、収益調整金(604,580,099円)、および分配準備積立金(126,913,353円)より、分配対象収益は1,487,867,307円(1万口当たり2,649.29円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2021年 9月15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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第3期（自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	2,854,171円
親投資信託受益証券	118,114,430円
合計	120,968,601円

第4期（自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,163,135円
親投資信託受益証券	814,932,786円
合計	816,095,921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4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
期首元本額	1,298,077,460円	3,106,753,445円

期中追加設定元本額	2,085,818,899円	2,996,875,916円
期中一部解約元本額	277,142,914円	487,585,479円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	16,371	1,854,343.17	
		米ドル 小計	16,371	1,854,343.17 (203,328,728)	
投資証券合計				203,328,728 (203,328,728)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	447,303,446	1,554,066,362	
		外国株式インデックス・マザーファンド	314,513,712	1,724,604,488	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	926,758,331	1,408,579,987	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	104,100,384	205,056,936	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	815,757,476	1,047,351,023	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	98,284,108	271,971,783	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	103,143,968	270,185,624	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	205,349,178	351,701,537	
親投資信託受益証券合計			3,015,210,603	6,833,517,740	
				7,036,846,468	

合計	(203,328,728)
----	---------------

(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 1銘柄	2.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2020年 9月15日現在）	第4期 （2021年 9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,406,285	1,313,521
金銭信託	-	37,882,378
コール・ローン	21,317,416	11,577,847
投資証券	55,642,198	111,022,876
親投資信託受益証券	1,336,906,211	2,780,667,172
流動資産合計	1,415,272,110	2,942,463,794
資産合計		
1,415,272,110		
負債の部		
流動負債		
未払金	491,888	-
未払解約金	2,266,244	9,482,951
未払受託者報酬	182,289	407,802
未払委託者報酬	5,164,887	11,554,398
未払利息	50	29
その他未払費用	36,805	81,647
流動負債合計	8,142,163	21,526,827
負債合計		
8,142,163		
純資産の部		
元本等		
元本	1,301,295,399	2,196,287,325
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	105,834,548	724,649,642
元本等合計	1,407,129,947	2,920,936,967
純資産合計		
1,407,129,947		
負債純資産合計		
1,415,272,110		
2,942,463,794		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日		自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		1,338,015		2,887,297
受取利息		283		-
有価証券売買等損益		63,558,442		423,520,779
為替差損益		1,161,854		3,059,981
営業収益合計		63,734,886		429,468,057
営業費用				
支払利息		8,226		24,472
受託者報酬		311,866		685,655
委託者報酬		8,836,277		19,426,802
その他費用		96,528		175,738
営業費用合計		9,252,897		20,312,667
営業利益又は営業損失()		54,481,989		409,155,390
経常利益又は経常損失()		54,481,989		409,155,390
当期純利益又は当期純損失()		54,481,989		409,155,390
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()		212,399		33,953,834
期首剰余金又は期首欠損金()		27,670,078		105,834,548
剰余金増加額又は欠損金減少額		30,569,810		275,638,977
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		30,569,810		275,638,977
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,674,930		32,025,439
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,674,930		32,025,439
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()		105,834,548		724,649,642

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(表示方法の変更)

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた55,642,198円は、「投資証券」55,642,198円として組替えております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,301,295,399口	2,196,287,325口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0813円 (10,000口当たりの純資産額 10,813円)	1口当たり純資産額 1.3299円 (10,000口当たりの純資産額 13,299円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,042,149円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(37,227,441円)、収益調整金(36,116,006円)、および分配準備積立金(15,560,364円)より、分配対象収益は105,945,960円(1万口当たり814.13円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(38,272,378円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(336,929,178円)、収益調整金(290,740,936円)、および分配準備積立金(58,707,150円)より、分配対象収益は724,649,642円(1万口当たり3,299.39円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2021年 9月15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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第3期（自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,470,865円
親投資信託受益証券	59,090,506円
合計	60,561,371円

第4期（自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	609,818円
親投資信託受益証券	407,400,818円
合計	408,010,636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4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
期首元本額	607,629,422円	1,301,295,399円

期中追加設定元本額	839,231,080円	1,186,838,860円
期中一部解約元本額	145,565,103円	291,846,934円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	8,939	1,012,520.53	
		米ドル 小計	8,939	1,012,520.53 (111,022,876)	
投資証券合計				111,022,876 (111,022,876)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	224,977,146	781,638,098	
		外国株式インデックス・マザーファンド	156,139,769	856,176,809	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	209,296,565	318,109,849	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	28,182,434	55,513,758	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	178,903,993	229,694,836	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	51,092,333	141,382,703	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	53,161,543	139,256,661	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	151,161,592	258,894,458	
親投資信託受益証券合計			1,052,915,375	2,780,667,172	
				2,891,690,048	

合計		(111,022,876)
----	--	---------------

(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 1銘柄	3.8%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,079,774	1,646,876
金銭信託	-	35,363,860
コール・ローン	19,141,984	10,808,122
投資証券	68,096,365	137,042,892
親投資信託受益証券	1,292,663,947	2,762,355,763
未収入金	1,000,000	4,000,000
流動資産合計	1,382,982,070	2,951,217,513
資産合計	1,382,982,070	2,951,217,513
負債の部		
流動負債		
未払金	899,795	-
未払解約金	2,372,482	10,066,584
未払受託者報酬	185,054	413,521
未払委託者報酬	5,243,199	11,716,331
未払利息	45	27
その他未払費用	37,313	82,776
流動負債合計	8,737,888	22,279,239
負債合計	8,737,888	22,279,239
純資産の部		
元本等		
元本	1,270,023,612	2,129,655,362
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	104,220,570	799,282,912
元本等合計	1,374,244,182	2,928,938,274
純資産合計	1,374,244,182	2,928,938,274
負債純資産合計	1,382,982,070	2,951,217,513

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日		自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		1,754,120		3,603,100
受取利息		373		-
有価証券売買等損益		80,838,725		477,319,628
為替差損益		1,389,758		3,947,992
営業収益合計		81,203,460		484,870,720
営業費用				
支払利息		9,243		26,581
受託者報酬		323,447		686,219
委託者報酬		9,164,260		19,442,794
その他費用		106,826		188,815
営業費用合計		9,603,776		20,344,409
営業利益又は営業損失()		71,599,684		464,526,311
経常利益又は経常損失()		71,599,684		464,526,311
当期純利益又は当期純損失()		71,599,684		464,526,311
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()		3,449,518		54,458,805
期首剰余金又は期首欠損金()		29,069,980		104,220,570
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,337,916		335,253,054
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		18,337,916		335,253,054
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,337,492		50,258,218
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,337,492		50,258,218
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()		104,220,570		799,282,912

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>

（ 重要な会計上の見積りに関する注記 ）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（ 表示方法の変更 ）

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた68,096,365円は、「投資証券」68,096,365円として組替えております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,270,023,612口	2,129,655,362口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0821円 (10,000口当たりの純資産額 10,821円)	1口当たり純資産額 1.3753円 (10,000口当たりの純資産額 13,753円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,467,875円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(49,682,291円)、収益調整金(27,452,521円)、および分配準備積立金(8,617,883円)より、分配対象収益は104,220,570円(1万口当たり820.60円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(38,425,492円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(371,642,014円)、収益調整金(329,686,829円)、および分配準備積立金(59,528,577円)より、分配対象収益は799,282,912円(1万口当たり3,753.09円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 (2021年 9月15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（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第3期(自 2019年 9月18日 至 2020年 9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,721,700円
親投資信託受益証券	77,815,210円
合計	79,536,910円

第4期(自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	667,812円
親投資信託受益証券	456,935,062円
合計	457,602,874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4期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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3期 (2020年 9月15日現在)	第4期 (2021年 9月15日現在)
期首元本額	729,433,180円	1,270,023,612円

期中追加設定元本額	843,783,098円	1,274,331,650円
期中一部解約元本額	303,192,666円	414,699,900円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	11,034	1,249,821.18	
		米ドル 小計	11,034	1,249,821.18 (137,042,892)	
投資証券合計				137,042,892 (137,042,892)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	260,317,035	904,419,474	
		外国株式インデックス・マザーファンド	182,918,329	1,003,014,365	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	57,326,299	87,130,241	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	14,002,349	27,581,827	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	66,210,475	85,007,628	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	40,646,760	112,477,714	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	42,723,437	111,914,043	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	251,538,782	430,810,471	
親投資信託受益証券合計			915,683,466	2,762,355,763	
				2,899,398,655	

合計	(137,042,892)
----	---------------

(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 1銘柄	4.7%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)」「三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)」「三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)」「三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位:円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	501,238	1,369,477,101
コール・ローン	2,233,641,214	418,494,954
株式	172,945,807,630	206,353,778,940
派生商品評価勘定	21,661,900	-
未収入金	5,938,800	2,073,632,542
未収配当金	69,902,433	73,575,334
前払金	-	5,175,000
差入委託証拠金	-	64,260,000
流動資産合計	175,277,453,215	210,358,393,871
資産合計	175,277,453,215	210,358,393,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	829,800	5,195,900
前受金	20,930,000	-

未払金	14,890,000	4,997,200
未払解約金	487,337,774	1,690,662,689
未払利息	5,343	1,080
その他未払費用	44,248	6,624
流動負債合計	524,037,165	1,700,863,493
負債合計	524,037,165	1,700,863,493
純資産の部		
元本等		
元本	65,691,116,604	60,058,250,145
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	109,062,299,446	148,599,280,233
元本等合計	174,753,416,050	208,657,530,378
純資産合計	174,753,416,050	208,657,530,378
負債純資産合計	175,277,453,215	210,358,393,871

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	株式 2,826,400,000円	-
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,691,116,604口	60,058,250,145口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6602円 (10,000口当たりの純資産額 26,602円)	1口当たり純資産額 3.4743円 (10,000口当たりの純資産額 34,743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 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100
	東証株価指数先物	1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100
合計		1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100

(2021年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900
	東証株価指数先物	1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900
合計		1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900

(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 9月16日 至 2021年 9月15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9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,708,868,107円
同期中における追加設定元本額	16,723,756,826円
同期中における一部解約元本額	17,741,508,329円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,803,407,938円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	956,781,736円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,557,926,901円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,246,692,882円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	79,199,185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）	6,261,625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）	24,034,515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）	67,454,138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）	129,701,004円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	94,275,180円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	193,204,597円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,465,770,896円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,476,719,660円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	556,078,457円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	630,495,924円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	399,246,054円
イオン・バランス戦略ファンド	79,845,037円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	18,359,609円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	108,239,510円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	85,447,414円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	276,242,392円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	143,054,941円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	159,884,358円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,176,370円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	84,644,782円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	4,979,462円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	28,188,783円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	20,796,599円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,094,930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）	3,481,332,533円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	19,671,842円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	186,206,344円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,810,248,964円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,203,664,791円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,216,704,531円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	51,276,484円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	205,573,161円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	540,428円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	875,023,385円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	57,132,852円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	353,640,333円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,043,896,738円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	829,812,974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 >	2,633,231,481円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	804,861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 >	56,635,977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 >	68,958,833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 >	43,825,793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 >	21,322,488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 >	169,050,752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 >	333,937,474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 >	96,790,701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 >	51,654,165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 >	9,439,355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 >	62,370,920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 >	834,474,721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)	192,328,030円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	5,357,793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 >	643,792,295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 >	170,212,578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 >	1,464,565,051円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	112,200,588円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	16,640,426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 >	57,544,240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 >	77,260,127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 >	512,787,716円
合計	65,691,116,604円

(2021年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	65,691,116,604円
同期中における追加設定元本額	9,882,098,470円
同期中における一部解約元本額	15,514,964,929円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,376,871,564円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	887,766,025円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	4,301,188,303円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	3,260,072,245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)	143,139,510円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4 資産タイプ)	4,736,179円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4 資産タイプ)	20,511,740円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4 資産タイプ)	62,883,753円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4 資産タイプ)	141,195,904円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4 資産タイプ)	115,860,274円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4 資産タイプ)	212,417,736円
国内株式指数ファンド (T O P I X)	1,169,108,063円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	17,489,497,601円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	200,770,021円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	251,210,761円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,416,229円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	28,367,994円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	147,720,164円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	132,908,125円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	447,303,446円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	224,977,146円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	260,317,035円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,472,204円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	384,768,338円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	13,864,916円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	66,276,238円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	63,520,057円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,863,277円
日興FWS・日本株インデックス	310,888円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	396,551円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,864,988,898円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	18,136,333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〉	115,503,299円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,916,026,395円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,714,171,545円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	6,580,694,503円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	42,196,059円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	170,114,126円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	757,184,109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〉	46,145,335円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	273,743,343円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	867,199,080円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	631,383,707円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,975,752,149円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	380,313円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	45,653,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	49,427,347円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	34,294,216円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	16,660,949円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	120,349,891円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	260,118,018円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	66,750,857円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	40,296,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	7,401,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	46,604,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	636,038,201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)	187,838,271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〉	248,544,531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〉	114,606,601円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	309,813,284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 >	68,313,365円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	27,701,727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 >	58,420,144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 >	63,463,668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 >	72,621,282円
合計	60,058,250,145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	3,200	3,095.00	9,904,000	
日本水産	88,300	636.00	56,158,800	
マルハニチロ	15,100	2,664.00	40,226,400	
雪国まいたけ	8,500	1,658.00	14,093,000	
カネコ種苗	4,900	1,580.00	7,742,000	
サカタのタネ	11,400	3,595.00	40,983,000	
ホクト	8,100	1,992.00	16,135,200	
日鉄鉱業	2,400	6,930.00	16,632,000	
I N P E X	393,700	774.00	304,723,800	
石油資源開発	13,800	1,903.00	26,261,400	
K & O エナジーグループ	6,100	1,396.00	8,515,600	
ヒノキヤグループ	3,300	2,390.00	7,887,000	
ショーボンドホールディングス	14,000	5,110.00	71,540,000	
ミライト・ホールディングス	32,500	2,328.00	75,660,000	
タマホーム	6,300	2,871.00	18,087,300	
ベステラ	3,900	1,510.00	5,889,000	
スペースバリューホールディングス	14,600	843.00	12,307,800	
安藤・間	61,900	847.00	52,429,300	
東急建設	28,800	806.00	23,212,800	
コムシスホールディングス	34,300	3,065.00	105,129,500	
ピーアールホールディングス	13,600	521.00	7,085,600	

高松コンストラクショングループ	6,200	2,102.00	13,032,400	
東建コーポレーション	2,900	10,460.00	30,334,000	
オリエンタル白石	39,700	269.00	10,679,300	
大成建設	69,700	3,685.00	256,844,500	
大林組	222,400	953.00	211,947,200	
清水建設	209,600	844.00	176,902,400	
飛島建設	9,400	1,143.00	10,744,200	
長谷工コーポレーション	72,800	1,571.00	114,368,800	
松井建設	11,800	828.00	9,770,400	
銭高組	1,700	4,445.00	7,556,500	
鹿島建設	163,800	1,508.00	247,010,400	
不動テトラ	6,900	1,825.00	12,592,500	
大末建設	5,100	1,009.00	5,145,900	
鉄建建設	6,500	1,844.00	11,986,000	
西松建設	16,300	3,640.00	59,332,000	
三井住友建設	54,500	497.00	27,086,500	
大豊建設	5,200	3,955.00	20,566,000	
前田建設工業	58,300	874.00	50,954,200	
奥村組	12,100	3,155.00	38,175,500	
東鉄工業	8,500	2,519.00	21,411,500	
浅沼組	3,200	4,690.00	15,008,000	
戸田建設	93,600	825.00	77,220,000	
熊谷組	10,200	2,808.00	28,641,600	
北野建設	2,500	2,193.00	5,482,500	
矢作建設工業	13,000	825.00	10,725,000	
ピーエス三菱	10,400	667.00	6,936,800	
日本ハウスホールディングス	20,200	449.00	9,069,800	
大東建託	24,700	13,660.00	337,402,000	
新日本建設	10,200	921.00	9,394,200	
N I P P O	18,300	3,985.00	72,925,500	
東亜道路工業	1,900	4,695.00	8,920,500	
前田道路	14,500	1,993.00	28,898,500	
日本道路	2,200	8,560.00	18,832,000	
東亜建設工業	6,300	2,462.00	15,510,600	
日本国土開発	22,200	615.00	13,653,000	
若築建設	5,500	2,178.00	11,979,000	

東洋建設	26,200	576.00	15,091,200	
五洋建設	97,300	762.00	74,142,600	
世紀東急工業	12,600	889.00	11,201,400	
福田組	2,800	5,200.00	14,560,000	
住友林業	58,300	2,232.00	130,125,600	
巴コーポレーション	15,200	496.00	7,539,200	
大和ハウス工業	207,900	3,836.00	797,504,400	
ライト工業	11,700	1,973.00	23,084,100	
積水ハウス	243,800	2,367.50	577,196,500	
北陸電気工事	4,900	1,348.00	6,605,200	
ユアテック	14,100	756.00	10,659,600	
日本リーテック	5,800	1,774.00	10,289,200	
中電工	9,900	2,373.00	23,492,700	
関電工	33,300	954.00	31,768,200	
きんでん	46,100	1,942.00	89,526,200	
東京エネシス	9,600	1,116.00	10,713,600	
トーエネック	2,900	3,800.00	11,020,000	
住友電設	6,300	2,422.00	15,258,600	
日本電設工業	11,300	1,862.00	21,040,600	
協和エクシオ	33,200	2,884.00	95,748,800	
新日本空調	6,400	2,553.00	16,339,200	
九電工	15,900	4,110.00	65,349,000	
三機工業	14,700	1,566.00	23,020,200	
日揮ホールディングス	76,000	991.00	75,316,000	
中外炉工業	4,300	1,906.00	8,195,800	
ヤマト	10,000	792.00	7,920,000	
太平電業	5,400	2,962.00	15,994,800	
高砂熱学工業	19,500	2,202.00	42,939,000	
朝日工業社	2,500	3,570.00	8,925,000	
明星工業	16,800	788.00	13,238,400	
大気社	10,600	3,485.00	36,941,000	
ダイダン	5,000	2,785.00	13,925,000	
日比谷総合設備	7,400	1,975.00	14,615,000	
テスホールディングス	4,800	2,548.00	12,230,400	
東洋エンジニアリング	10,000	943.00	9,430,000	
レイズネクスト	12,100	1,240.00	15,004,000	

ニッポン	19,000	1,672.00	31,768,000
日清製粉グループ本社	80,500	1,922.00	154,721,000
昭和産業	5,500	2,836.00	15,598,000
鳥越製粉	8,500	797.00	6,774,500
中部飼料	9,200	1,150.00	10,580,000
フィード・ワン	10,500	783.00	8,221,500
日本甜菜製糖	5,100	1,670.00	8,517,000
D M三井製糖ホールディングス	4,500	1,999.00	8,995,500
日新製糖	3,300	1,737.00	5,732,100
森永製菓	17,100	4,070.00	69,597,000
中村屋	2,000	3,940.00	7,880,000
江崎グリコ	19,500	4,365.00	85,117,500
名糖産業	3,800	1,817.00	6,904,600
井村屋グループ	4,600	2,430.00	11,178,000
不二家	4,100	2,446.00	10,028,600
山崎製パン	54,300	1,943.00	105,504,900
モロゾフ	1,700	5,590.00	9,503,000
亀田製菓	4,100	4,610.00	18,901,000
寿スピリッツ	7,100	7,220.00	51,262,000
カルビー	33,000	2,856.00	94,248,000
森永乳業	13,500	7,230.00	97,605,000
六甲バター	6,200	1,676.00	10,391,200
ヤクルト本社	49,700	5,730.00	284,781,000
明治ホールディングス	47,300	7,330.00	346,709,000
雪印メグミルク	17,300	2,331.00	40,326,300
プリマハム	9,600	3,080.00	29,568,000
日本ハム	27,300	4,490.00	122,577,000
丸大食品	6,700	1,818.00	12,180,600
S Foods	6,500	3,190.00	20,735,000
柿安本店	2,800	2,655.00	7,434,000
伊藤ハム米久ホールディングス	40,500	757.00	30,658,500
サッポロホールディングス	24,900	2,515.00	62,623,500
アサヒグループホールディングス	169,600	5,445.00	923,472,000
キリンホールディングス	265,200	2,063.50	547,240,200
宝ホールディングス	53,500	1,601.00	85,653,500
オエノンホールディングス	25,200	394.00	9,928,800

養命酒製造	3,400	1,904.00	6,473,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	50,900	1,596.00	81,236,400	
サントリー食品インターナショナル	48,000	4,755.00	228,240,000	
ダイドーグループホールディングス	3,900	5,870.00	22,893,000	
伊藤園	21,900	7,680.00	168,192,000	
キーコーヒー	6,600	2,267.00	14,962,200	
日清オイリオグループ	8,100	3,145.00	25,474,500	
不二製油グループ本社	17,900	2,622.00	46,933,800	
かどや製油	1,300	4,250.00	5,525,000	
J - オイルミルズ	6,300	1,859.00	11,711,700	
キッコーマン	51,800	9,290.00	481,222,000	
味の素	172,100	3,542.00	609,578,200	
ブルドックソース	4,300	2,248.00	9,666,400	
キュービー	40,300	2,776.00	111,872,800	
ハウス食品グループ本社	26,600	3,685.00	98,021,000	
カゴメ	27,400	2,991.00	81,953,400	
焼津水産化学工業	7,000	1,044.00	7,308,000	
アリアケジャパン	6,700	6,690.00	44,823,000	
ニチレイ	34,700	2,951.00	102,399,700	
東洋水産	36,900	5,090.00	187,821,000	
イトアンドホールディングス	4,200	2,320.00	9,744,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,500	787.00	4,328,500	
日清食品ホールディングス	28,100	9,040.00	254,024,000	
永谷園ホールディングス	4,500	2,194.00	9,873,000	
一正蒲鉾	5,600	946.00	5,297,600	
フジッコ	7,000	1,942.00	13,594,000	
ロック・フィールド	8,300	1,688.00	14,010,400	
日本たばこ産業	385,400	2,177.50	839,208,500	
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,628.00	8,791,200	
わらべや日洋ホールディングス	5,600	2,538.00	14,212,800	
なとり	5,200	2,028.00	10,545,600	
ピクルスコーポレーション	4,400	2,156.00	9,486,400	
ファーマフーズ	7,000	2,695.00	18,865,000	
北の達人コーポレーション	25,600	496.00	12,697,600	
ユーグレナ	37,800	895.00	33,831,000	

ミヨシ油脂	4,800	1,357.00	6,513,600	
理研ビタミン	8,100	1,925.00	15,592,500	
片倉工業	7,600	1,586.00	12,053,600	
ゲンゼ	5,100	4,490.00	22,899,000	
東洋紡	29,200	1,433.00	41,843,600	
ユニチカ	24,700	390.00	9,633,000	
富士紡ホールディングス	3,800	4,500.00	17,100,000	
倉敷紡績	6,600	2,067.00	13,642,200	
シキボウ	6,900	947.00	6,534,300	
日本毛織	20,100	1,048.00	21,064,800	
帝国繊維	8,400	2,144.00	18,009,600	
帝人	65,800	1,646.00	108,306,800	
東レ	511,800	739.70	378,578,460	
住江織物	2,800	1,899.00	5,317,200	
アツギ	10,200	648.00	6,609,600	
ダイニック	6,000	789.00	4,734,000	
セーレン	17,600	2,118.00	37,276,800	
小松マテーレ	13,000	1,036.00	13,468,000	
ワコールホールディングス	18,200	2,380.00	43,316,000	
ホギメディカル	9,500	3,360.00	31,920,000	
T S Iホールディングス	28,900	341.00	9,854,900	
マツオカコーポレーション	3,300	1,488.00	4,910,400	
ワールド	10,200	1,481.00	15,106,200	
オンワードホールディングス	46,900	329.00	15,430,100	
ゴールドウイン	11,900	7,350.00	87,465,000	
デサント	12,300	4,315.00	53,074,500	
特種東海製紙	4,400	4,675.00	20,570,000	
王子ホールディングス	314,200	592.00	186,006,400	
日本製紙	31,300	1,238.00	38,749,400	
北越コーポレーション	50,800	674.00	34,239,200	
中越パルプ工業	5,400	1,242.00	6,706,800	
大王製紙	33,600	2,191.00	73,617,600	
レンゴー	72,800	922.00	67,121,600	
トーモク	5,400	1,988.00	10,735,200	
ザ・パック	5,800	3,130.00	18,154,000	
クラレ	102,200	1,075.00	109,865,000	

旭化成	466,900	1,253.50	585,259,150	
昭和電工	50,700	2,736.00	138,715,200	
住友化学	548,500	597.00	327,454,500	
住友精化	3,600	3,765.00	13,554,000	
日産化学	38,600	6,910.00	266,726,000	
ラサ工業	2,800	2,057.00	5,759,600	
クレハ	6,000	8,700.00	52,200,000	
多木化学	3,000	7,050.00	21,150,000	
テイカ	6,100	1,423.00	8,680,300	
石原産業	13,700	1,340.00	18,358,000	
日本曹達	9,800	3,720.00	36,456,000	
東ソー	108,100	2,179.00	235,549,900	
トクヤマ	21,200	2,274.00	48,208,800	
セントラル硝子	13,900	2,198.00	30,552,200	
東亜合成	40,500	1,365.00	55,282,500	
大阪ソーダ	6,900	2,887.00	19,920,300	
関東電化工業	17,300	1,133.00	19,600,900	
デンカ	25,800	4,185.00	107,973,000	
信越化学工業	130,100	21,140.00	2,750,314,000	
堺化学工業	5,500	2,374.00	13,057,000	
第一稀元素化学工業	8,000	1,720.00	13,760,000	
エア・ウォーター	72,100	1,872.00	134,971,200	
日本酸素ホールディングス	57,900	3,020.00	174,858,000	
日本化学工業	2,500	3,540.00	8,850,000	
日本パーカライジング	36,800	1,250.00	46,000,000	
高圧ガス工業	13,300	781.00	10,387,300	
四国化成工業	9,400	1,461.00	13,733,400	
ステラ ケミファ	4,200	3,120.00	13,104,000	
保土谷化学工業	2,400	5,350.00	12,840,000	
日本触媒	12,900	6,090.00	78,561,000	
大日精化工業	5,600	2,764.00	15,478,400	
カネカ	18,200	4,935.00	89,817,000	
三菱瓦斯化学	70,300	2,477.00	174,133,100	
三井化学	60,500	3,985.00	241,092,500	
J S R	70,700	4,215.00	298,000,500	
東京応化工業	12,200	8,020.00	97,844,000	

大阪有機化学工業	6,400	4,225.00	27,040,000	
三菱ケミカルホールディングス	470,400	1,051.50	494,625,600	
K Hネオケム	11,800	3,230.00	38,114,000	
ダイセル	95,900	898.00	86,118,200	
住友ベークライト	11,300	5,650.00	63,845,000	
積水化学工業	147,600	2,042.00	301,399,200	
日本ゼオン	64,200	1,649.00	105,865,800	
アイカ工業	19,800	3,940.00	78,012,000	
宇部興産	35,000	2,339.00	81,865,000	
積水樹脂	10,500	2,305.00	24,202,500	
タキロンシーアイ	17,000	667.00	11,339,000	
旭有機材	5,100	1,550.00	7,905,000	
ニチバン	4,800	1,848.00	8,870,400	
リケンテクノス	19,800	606.00	11,998,800	
大倉工業	3,800	2,321.00	8,819,800	
積水化成品工業	12,000	621.00	7,452,000	
群栄化学工業	2,600	3,170.00	8,242,000	
ダイキョーニシカワ	16,300	691.00	11,263,300	
森六ホールディングス	4,600	2,218.00	10,202,800	
恵和	1,600	4,765.00	7,624,000	
日本化薬	44,000	1,286.00	56,584,000	
カーリットホールディングス	9,500	964.00	9,158,000	
日本精化	6,100	2,443.00	14,902,300	
扶桑化学工業	5,400	5,170.00	27,918,000	
トリケミカル研究所	6,700	3,755.00	25,158,500	
A D E K A	32,600	2,726.00	88,867,600	
日油	26,500	6,720.00	178,080,000	
新日本理化	18,000	356.00	6,408,000	
ハリマ化成グループ	7,100	939.00	6,666,900	
花王	158,900	6,789.00	1,078,772,100	
第一工業製薬	2,700	3,435.00	9,274,500	
ニイタカ	2,400	2,408.00	5,779,200	
三洋化成工業	4,100	6,120.00	25,092,000	
大日本塗料	10,100	901.00	9,100,100	
日本ペイントホールディングス	264,900	1,468.00	388,873,200	
関西ペイント	79,200	3,025.00	239,580,000	

中国塗料	18,000	940.00	16,920,000	
日本特殊塗料	6,700	1,098.00	7,356,600	
藤倉化成	12,600	563.00	7,093,800	
太陽ホールディングス	5,200	6,180.00	32,136,000	
D I C	29,600	3,310.00	97,976,000	
サカタインクス	13,700	1,219.00	16,700,300	
東洋インキ S C ホールディングス	13,300	2,162.00	28,754,600	
T & K T O K A	8,200	890.00	7,298,000	
富士フイルムホールディングス	126,200	10,015.00	1,263,893,000	
資生堂	134,000	8,109.00	1,086,606,000	
ライオン	87,100	1,856.00	161,657,600	
高砂香料工業	4,600	3,080.00	14,168,000	
マンダム	15,400	1,626.00	25,040,400	
ミルボン	8,900	6,880.00	61,232,000	
ファンケル	26,400	3,815.00	100,716,000	
コーセー	13,600	13,300.00	180,880,000	
コタ	6,000	1,683.00	10,098,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	31,200	2,636.00	82,243,200	
ノエビアホールディングス	6,100	6,020.00	36,722,000	
新日本製薬	2,700	2,008.00	5,421,600	
エステー	5,600	1,845.00	10,332,000	
アグロ カネショウ	3,800	1,631.00	6,197,800	
コニシ	11,900	1,848.00	21,991,200	
長谷川香料	12,400	3,035.00	37,634,000	
小林製薬	20,100	8,860.00	178,086,000	
荒川化学工業	7,000	1,320.00	9,240,000	
メック	5,200	3,825.00	19,890,000	
タカラバイオ	18,900	3,255.00	61,519,500	
J C U	8,000	4,690.00	37,520,000	
デクセリアルズ	20,300	2,410.00	48,923,000	
アース製薬	5,400	6,950.00	37,530,000	
北興化学工業	7,800	1,233.00	9,617,400	
大成ラミック	3,300	2,966.00	9,787,800	
クミアイ化学工業	27,500	924.00	25,410,000	
日本農薬	16,800	571.00	9,592,800	
アキレス	6,200	1,382.00	8,568,400	

有沢製作所	11,500	929.00	10,683,500	
日東電工	43,200	8,740.00	377,568,000	
レック	9,800	1,134.00	11,113,200	
三光合成	11,500	479.00	5,508,500	
藤森工業	6,100	5,010.00	30,561,000	
未来工業	3,700	1,700.00	6,290,000	
J S P	5,200	1,687.00	8,772,400	
エフピコ	13,600	4,380.00	59,568,000	
天馬	5,300	3,070.00	16,271,000	
信越ポリマー	11,900	1,080.00	12,852,000	
東リ	26,000	243.00	6,318,000	
ニフコ	26,700	3,650.00	97,455,000	
バルカー	6,100	2,290.00	13,969,000	
ユニ・チャーム	138,700	4,940.00	685,178,000	
協和キリン	83,900	4,080.00	342,312,000	
武田薬品工業	597,000	3,723.00	2,222,631,000	
アステラス製薬	622,100	1,860.00	1,157,106,000	
大日本住友製薬	53,200	2,053.00	109,219,600	
塩野義製薬	90,400	7,500.00	678,000,000	
日本新薬	20,500	9,440.00	193,520,000	
中外製薬	224,100	4,168.00	934,048,800	
科研製薬	12,400	4,885.00	60,574,000	
エーザイ	79,700	8,336.00	664,379,200	
ロート製薬	34,300	3,495.00	119,878,500	
小野薬品工業	165,100	2,640.00	435,864,000	
久光製薬	20,900	4,400.00	91,960,000	
持田製薬	10,200	3,565.00	36,363,000	
参天製薬	124,900	1,661.00	207,458,900	
扶桑薬品工業	3,400	2,598.00	8,833,200	
日本ケミファ	1,700	2,336.00	3,971,200	
ツムラ	24,200	3,880.00	93,896,000	
日医工	20,800	918.00	19,094,400	
キッセイ薬品工業	12,900	2,568.00	33,127,200	
生化学工業	12,800	1,135.00	14,528,000	
栄研化学	12,900	2,281.00	29,424,900	
鳥居薬品	4,000	3,035.00	12,140,000	

J C R ファーマ	20,600	2,973.00	61,243,800
東和薬品	10,100	3,385.00	34,188,500
富士製薬工業	6,500	1,223.00	7,949,500
ゼリア新薬工業	12,800	2,182.00	27,929,600
第一三共	564,200	2,723.50	1,536,598,700
キョーリン製薬ホールディングス	15,300	1,884.00	28,825,200
大幸薬品	10,000	952.00	9,520,000
ダイト	4,800	3,505.00	16,824,000
大塚ホールディングス	148,800	4,867.00	724,209,600
大正製薬ホールディングス	17,200	6,580.00	113,176,000
ペプチドリーム	37,700	3,880.00	146,276,000
あすか製薬ホールディングス	9,200	1,114.00	10,248,800
サワイグループホールディングス	15,600	5,220.00	81,432,000
日本コークス工業	80,300	132.00	10,599,600
ニチレキ	9,300	1,355.00	12,601,500
ユシロ化学工業	7,200	1,253.00	9,021,600
MORESCO	6,100	1,238.00	7,551,800
出光興産	78,800	2,790.00	219,852,000
E N E O S ホールディングス	1,075,600	457.20	491,764,320
コスモエネルギーホールディングス	23,000	2,400.00	55,200,000
横浜ゴム	41,700	1,995.00	83,191,500
TOYO TIRE	38,500	1,995.00	76,807,500
ブリヂストン	206,700	5,273.00	1,089,929,100
住友ゴム工業	64,900	1,399.00	90,795,100
オカモト	4,500	4,515.00	20,317,500
ニッタ	7,400	2,882.00	21,326,800
住友理工	15,300	749.00	11,459,700
三ツ星ベルト	9,100	2,100.00	19,110,000
バンドー化学	14,700	979.00	14,391,300
日東紡績	11,100	3,795.00	42,124,500
A G C	66,000	5,810.00	383,460,000
日本板硝子	19,000	591.00	11,229,000
日本電気硝子	27,100	2,461.00	66,693,100
オハラ	3,700	1,589.00	5,879,300
住友大阪セメント	13,700	3,115.00	42,675,500
太平洋セメント	41,200	2,491.00	102,629,200

日本ヒューム	11,000	764.00	8,404,000
日本コンクリート工業	24,200	319.00	7,719,800
三谷セキサン	3,600	6,850.00	24,660,000
アジアパイルホールディングス	16,900	512.00	8,652,800
東海カーボン	59,100	1,607.00	94,973,700
日本カーボン	4,000	4,410.00	17,640,000
東洋炭素	4,900	3,250.00	15,925,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,610.00	19,823,000
T O T O	51,200	6,550.00	335,360,000
日本碍子	78,800	1,942.00	153,029,600
日本特殊陶業	55,200	1,792.00	98,918,400
M A R U W A	2,500	11,860.00	29,650,000
品川リフラクトリーズ	2,200	4,100.00	9,020,000
黒崎播磨	1,600	5,220.00	8,352,000
ヨータイ	6,200	1,412.00	8,754,400
東京窯業	14,800	346.00	5,120,800
フジインコーポレーテッド	5,800	6,760.00	39,208,000
ニチアス	18,400	2,989.00	54,997,600
ニチハ	10,100	3,480.00	35,148,000
日本製鉄	339,000	2,307.00	782,073,000
神戸製鋼所	131,000	750.00	98,250,000
中山製鋼所	9,000	452.00	4,068,000
合同製鐵	4,700	1,592.00	7,482,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	205,100	1,902.00	390,100,200
東京製鐵	28,200	1,292.00	36,434,400
共英製鋼	8,800	1,503.00	13,226,400
大和工業	15,400	4,010.00	61,754,000
東京鐵鋼	3,900	1,656.00	6,458,400
大阪製鐵	5,000	1,226.00	6,130,000
淀川製鋼所	8,700	2,563.00	22,298,100
丸一鋼管	22,800	2,869.00	65,413,200
モリ工業	2,800	2,526.00	7,072,800
大同特殊鋼	11,800	5,180.00	61,124,000
日本冶金工業	6,100	2,851.00	17,391,100
山陽特殊製鋼	9,000	1,922.00	17,298,000
愛知製鋼	4,200	2,843.00	11,940,600

日立金属	65,500	2,149.00	140,759,500
大太平洋金属	5,500	1,997.00	10,983,500
新日本電工	48,600	345.00	16,767,000
栗本鐵工所	4,400	1,702.00	7,488,800
三菱製鋼	7,100	1,427.00	10,131,700
日本精線	1,500	5,240.00	7,860,000
大紀アルミニウム工業所	10,600	1,812.00	19,207,200
日本軽金属ホールディングス	19,600	2,106.00	41,277,600
三井金属鉱業	19,200	3,470.00	66,624,000
東邦亜鉛	4,600	2,903.00	13,353,800
三菱マテリアル	46,200	2,343.00	108,246,600
住友金属鉱山	90,900	4,365.00	396,778,500
D O W Aホールディングス	17,700	4,945.00	87,526,500
古河機械金属	11,200	1,311.00	14,683,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,100	820.00	8,282,000
東邦チタニウム	13,400	1,230.00	16,482,000
U A C J	10,800	3,005.00	32,454,000
C Kサンエツ	2,000	3,480.00	6,960,000
古河電気工業	22,400	2,433.00	54,499,200
住友電気工業	246,700	1,527.00	376,710,900
フジクラ	86,700	684.00	59,302,800
昭和電線ホールディングス	7,500	2,367.00	17,752,500
タツタ電線	14,900	561.00	8,358,900
平河ヒューテック	5,400	1,284.00	6,933,600
リョービ	9,400	1,357.00	12,755,800
アサヒホールディングス	27,000	2,231.00	60,237,000
稲葉製作所	4,500	1,434.00	6,453,000
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,688.00	8,601,600
トーカロ	18,300	1,479.00	27,065,700
アルファC o	5,300	1,300.00	6,890,000
S U M C O	91,000	2,538.00	230,958,000
川田テクノロジーズ	1,900	3,845.00	7,305,500
R S Technologies	2,400	6,420.00	15,408,000
東洋製罐グループホールディングス	46,000	1,384.00	63,664,000
ホッカンホールディングス	5,300	1,515.00	8,029,500
横河ブリッジホールディングス	12,000	2,427.00	29,124,000

駒井ハルテック	2,900	1,814.00	5,260,600	
三和ホールディングス	67,100	1,551.00	104,072,100	
文化シャッター	20,500	1,169.00	23,964,500	
三協立山	11,300	807.00	9,119,100	
アルインコ	7,000	1,071.00	7,497,000	
L I X I L	97,700	3,280.00	320,456,000	
ノーリツ	14,200	1,960.00	27,832,000	
長府製作所	6,600	2,184.00	14,414,400	
リンナイ	13,700	13,390.00	183,443,000	
日東精工	12,300	717.00	8,819,100	
岡部	14,900	709.00	10,564,100	
ジーテクト	9,100	1,557.00	14,168,700	
東プレ	13,700	1,412.00	19,344,400	
高周波熱錬	16,500	690.00	11,385,000	
東京製綱	6,600	1,027.00	6,778,200	
パイオラックス	9,900	1,607.00	15,909,300	
エイチワン	9,100	754.00	6,861,400	
日本発條	71,700	830.00	59,511,000	
立川ブラインド工業	4,500	1,345.00	6,052,500	
三益半導体工業	5,500	2,677.00	14,723,500	
日本製鋼所	22,100	3,050.00	67,405,000	
三浦工業	30,700	5,170.00	158,719,000	
タクマ	24,000	1,710.00	41,040,000	
ツガミ	14,700	2,010.00	29,547,000	
オークマ	8,300	5,830.00	48,389,000	
芝浦機械	7,500	2,808.00	21,060,000	
アマダ	103,200	1,246.00	128,587,200	
アイダエンジニアリング	18,600	1,170.00	21,762,000	
F U J I	28,000	3,140.00	87,920,000	
牧野フライス製作所	8,400	4,640.00	38,976,000	
オーエスジー	33,700	2,136.00	71,983,200	
旭ダイヤモンド工業	19,500	551.00	10,744,500	
D M G 森精機	42,300	2,228.00	94,244,400	
ソディック	17,500	975.00	17,062,500	
ディスコ	9,600	36,200.00	347,520,000	
日東工器	4,300	2,100.00	9,030,000	

日進工具	6,300	1,479.00	9,317,700
豊和工業	5,500	873.00	4,801,500
石川製作所	2,700	1,725.00	4,657,500
島精機製作所	10,500	2,443.00	25,651,500
オプトラン	9,100	2,354.00	21,421,400
フリュー	8,300	1,764.00	14,641,200
ヤマシンフィルタ	15,100	689.00	10,403,900
日阪製作所	10,600	924.00	9,794,400
やまびこ	13,800	1,333.00	18,395,400
平田機工	3,400	7,320.00	24,888,000
マルマエ	3,500	2,288.00	8,008,000
タツモ	3,800	1,730.00	6,574,000
ナブテスコ	40,600	4,860.00	197,316,000
三井海洋開発	7,700	1,753.00	13,498,100
レオン自動機	7,800	1,585.00	12,363,000
S M C	21,000	78,800.00	1,654,800,000
ホソカワミクロン	2,600	7,370.00	19,162,000
ユニオンツール	2,900	4,110.00	11,919,000
オイレス工業	9,400	1,756.00	16,506,400
日精エー・エス・ピー機械	2,600	4,395.00	11,427,000
サトーホールディングス	9,500	2,868.00	27,246,000
技研製作所	6,400	4,905.00	31,392,000
日本エアテック	3,900	1,328.00	5,179,200
日精樹脂工業	7,000	1,223.00	8,561,000
ワイエイシイホールディングス	4,800	972.00	4,665,600
小松製作所	325,200	2,821.50	917,551,800
住友重機械工業	40,600	3,175.00	128,905,000
日立建機	33,700	3,375.00	113,737,500
日工	13,600	695.00	9,452,000
巴工業	3,700	2,464.00	9,116,800
井関農機	8,300	1,811.00	15,031,300
T O W A	7,000	2,971.00	20,797,000
北川鉄工所	4,300	1,683.00	7,236,900
ローツェ	3,100	9,260.00	28,706,000
クボタ	350,200	2,511.50	879,527,300
荏原実業	4,000	2,885.00	11,540,000

三菱化工機	3,000	2,573.00	7,719,000	
月島機械	13,600	1,225.00	16,660,000	
帝国電機製作所	6,200	1,408.00	8,729,600	
新東工業	17,600	822.00	14,467,200	
澁谷工業	6,400	3,270.00	20,928,000	
アイチ コーポレーション	13,200	783.00	10,335,600	
小森コーポレーション	18,200	910.00	16,562,000	
鶴見製作所	6,200	1,859.00	11,525,800	
酒井重工業	2,100	2,656.00	5,577,600	
荏原製作所	29,900	6,150.00	183,885,000	
西島製作所	10,300	959.00	9,877,700	
北越工業	9,100	1,028.00	9,354,800	
ダイキン工業	91,500	29,055.00	2,658,532,500	
オルガノ	2,300	7,220.00	16,606,000	
トーヨーカネツ	3,500	2,698.00	9,443,000	
栗田工業	38,800	5,950.00	230,860,000	
榑本チエイン	9,900	3,670.00	36,333,000	
大同工業	5,100	1,150.00	5,865,000	
木村化工機	7,500	796.00	5,970,000	
アネスト岩田	12,500	1,021.00	12,762,500	
ダイフク	39,500	11,360.00	448,720,000	
サムコ	2,300	3,055.00	7,026,500	
加藤製作所	6,000	920.00	5,520,000	
タダノ	34,300	1,239.00	42,497,700	
フジテック	25,100	2,934.00	73,643,400	
C K D	16,700	2,536.00	42,351,200	
キトー	7,200	1,883.00	13,557,600	
平和	20,000	2,057.00	41,140,000	
理想科学工業	6,100	2,521.00	15,378,100	
S A N K Y O	17,400	2,830.00	49,242,000	
日本金銭機械	11,900	598.00	7,116,200	
マースグループホールディングス	5,600	1,695.00	9,492,000	
フクシマガリレイ	5,000	5,160.00	25,800,000	
竹内製作所	12,000	2,651.00	31,812,000	
アマノ	19,000	2,969.00	56,411,000	
J U K I	12,000	854.00	10,248,000	

蛇の目マシン工業	8,300	756.00	6,274,800	
マックス	9,700	1,997.00	19,370,900	
グローリー	18,700	2,437.00	45,571,900	
新晃工業	6,800	2,342.00	15,925,600	
大和冷機工業	10,800	1,310.00	14,148,000	
セガサミーホールディングス	66,000	1,592.00	105,072,000	
リケン	4,100	2,940.00	12,054,000	
T P R	9,900	1,555.00	15,394,500	
ツバキ・ナカシマ	14,200	1,600.00	22,720,000	
ホシザキ	21,000	10,840.00	227,640,000	
大豊工業	7,400	888.00	6,571,200	
日本精工	145,200	777.00	112,820,400	
N T N	167,600	259.00	43,408,400	
ジェイテクト	68,500	992.00	67,952,000	
不二越	6,200	4,745.00	29,419,000	
日本トムソン	23,100	582.00	13,444,200	
T H K	42,200	2,737.00	115,501,400	
ユーシン精機	7,100	858.00	6,091,800	
前澤給装工業	6,800	1,072.00	7,289,600	
イーグル工業	9,900	1,306.00	12,929,400	
日本ピラー工業	7,400	3,070.00	22,718,000	
キッツ	23,000	867.00	19,941,000	
マキタ	93,300	6,830.00	637,239,000	
日立造船	58,000	1,002.00	58,116,000	
三菱重工業	112,900	3,055.00	344,909,500	
I H I	48,800	2,697.00	131,613,600	
スター精密	11,400	1,584.00	18,057,600	
日清紡ホールディングス	44,500	842.00	37,469,000	
イビデン	34,600	6,780.00	234,588,000	
コニカミノルタ	147,900	598.00	88,444,200	
ブラザー工業	87,300	2,575.00	224,797,500	
ミネベアミツミ	122,900	3,020.00	371,158,000	
日立製作所	345,000	6,589.00	2,273,205,000	
東芝	142,400	4,700.00	669,280,000	
三菱電機	716,100	1,584.50	1,134,660,450	
富士電機	43,300	5,250.00	227,325,000	

安川電機	77,200	6,100.00	470,920,000
シンフォニアテクノロジー	10,300	1,261.00	12,988,300
明電舎	12,500	2,568.00	32,100,000
オリジン	4,300	1,313.00	5,645,900
山洋電気	3,600	7,680.00	27,648,000
デンヨー	6,600	2,274.00	15,008,400
東芝テック	7,800	4,860.00	37,908,000
芝浦メカトロニクス	1,500	7,750.00	11,625,000
マブチモーター	16,700	3,995.00	66,716,500
日本電産	172,800	13,865.00	2,395,872,000
トレックス・セミコンダクター	4,800	2,823.00	13,550,400
東光高岳	4,800	1,526.00	7,324,800
ダイヘン	7,700	5,120.00	39,424,000
ヤーマン	12,100	1,422.00	17,206,200
JVCケンウッド	65,900	214.00	14,102,600
ミマキエンジニアリング	10,100	948.00	9,574,800
I - P E X	4,300	2,175.00	9,352,500
日新電機	17,000	1,456.00	24,752,000
大崎電気工業	18,300	573.00	10,485,900
オムロン	59,600	11,720.00	698,512,000
日東工業	10,300	1,806.00	18,601,800
I D E C	10,000	2,340.00	23,400,000
正興電機製作所	3,000	1,511.00	4,533,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,300	2,651.00	69,721,300
メルコホールディングス	2,700	5,270.00	14,229,000
日本電気	91,000	6,220.00	566,020,000
富士通	64,600	21,855.00	1,411,833,000
沖電気工業	28,800	991.00	28,540,800
電気興業	4,000	2,341.00	9,364,000
サンケン電気	8,600	6,430.00	55,298,000
アイホン	5,100	2,464.00	12,566,400
ルネサスエレクトロニクス	388,900	1,420.00	552,238,000
セイコーエプソン	89,300	2,321.00	207,265,300
ワコム	53,100	758.00	40,249,800
アルバック	13,400	6,660.00	89,244,000
E I Z O	6,200	4,375.00	27,125,000

日本信号	16,500	981.00	16,186,500	
京三製作所	19,700	497.00	9,790,900	
能美防災	9,500	2,143.00	20,358,500	
ホーチキ	6,500	1,226.00	7,969,000	
エレコム	16,600	1,882.00	31,241,200	
パナソニック	765,300	1,442.00	1,103,562,600	
シャープ	96,100	1,452.00	139,537,200	
アンリツ	43,700	2,048.00	89,497,600	
富士通ゼネラル	22,400	2,966.00	66,438,400	
ソニーグループ	449,900	12,170.00	5,475,283,000	
T D K	34,600	12,910.00	446,686,000	
帝国通信工業	5,300	1,656.00	8,776,800	
タムラ製作所	27,400	764.00	20,933,600	
アルプスアルパイン	59,700	1,251.00	74,684,700	
鈴木	4,600	904.00	4,158,400	
メイコー	5,300	3,200.00	16,960,000	
日本トリム	2,300	3,900.00	8,970,000	
ローランド ディー . ジー .	4,500	3,270.00	14,715,000	
フォスター電機	8,900	948.00	8,437,200	
S M K	2,500	2,459.00	6,147,500	
ヨコオ	5,400	2,659.00	14,358,600	
ホシデン	18,800	958.00	18,010,400	
ヒロセ電機	11,100	19,790.00	219,669,000	
日本航空電子工業	16,900	1,755.00	29,659,500	
T O A	10,500	865.00	9,082,500	
マクセルホールディングス	15,000	1,340.00	20,100,000	
古野電気	10,500	1,160.00	12,180,000	
ユニデンホールディングス	2,600	2,835.00	7,371,000	
スミダコーポレーション	7,500	1,347.00	10,102,500	
アイコム	3,400	2,472.00	8,404,800	
リオン	3,700	2,793.00	10,334,100	
横河電機	71,900	2,015.00	144,878,500	
新電元工業	2,900	4,375.00	12,687,500	
アズビル	48,500	5,240.00	254,140,000	
東亜ディーケーケー	6,200	987.00	6,119,400	
日本光電工業	29,900	3,970.00	118,703,000	

共和電業	16,200	403.00	6,528,600	
日本電子材料	3,500	2,012.00	7,042,000	
堀場製作所	13,400	8,290.00	111,086,000	
アドバンテスト	53,300	11,450.00	610,285,000	
エスベック	6,900	2,409.00	16,622,100	
キーエンス	70,500	75,510.00	5,323,455,000	
日置電機	3,400	9,800.00	33,320,000	
シスメックス	56,200	14,205.00	798,321,000	
日本マイクロニクス	13,100	1,572.00	20,593,200	
メガチップス	7,500	3,620.00	27,150,000	
O B A R A G R O U P	3,400	4,155.00	14,127,000	
コーセル	10,400	1,137.00	11,824,800	
イリソ電子工業	6,200	5,060.00	31,372,000	
オブテックスグループ	12,400	1,612.00	19,988,800	
千代田インテグレ	4,400	2,129.00	9,367,600	
レーザーテック	31,500	28,940.00	911,610,000	
スタンレー電気	49,900	2,974.00	148,402,600	
岩崎電気	4,100	2,059.00	8,441,900	
ウシオ電機	37,500	2,181.00	81,787,500	
日本セラミック	7,000	3,145.00	22,015,000	
古河電池	5,700	1,620.00	9,234,000	
山一電機	5,500	1,787.00	9,828,500	
図研	5,000	4,215.00	21,075,000	
日本電子	13,200	9,100.00	120,120,000	
カシオ計算機	58,000	1,869.00	108,402,000	
ファナック	63,000	26,880.00	1,693,440,000	
日本シイエムケイ	20,300	428.00	8,688,400	
エンプラス	3,700	3,430.00	12,691,000	
大真空	3,000	4,295.00	12,885,000	
ローム	29,800	11,490.00	342,402,000	
浜松ホトニクス	51,200	7,100.00	363,520,000	
三井ハイテック	7,100	8,580.00	60,918,000	
新光電気工業	24,000	4,130.00	99,120,000	
京セラ	109,100	7,284.00	794,684,400	
太陽誘電	31,900	7,600.00	242,440,000	
村田製作所	210,800	10,235.00	2,157,538,000	

双葉電子工業	14,200	827.00	11,743,400
北陸電気工業	6,100	1,071.00	6,533,100
ニチコン	23,100	1,144.00	26,426,400
日本ケミコン	7,500	2,303.00	17,272,500
K O A	10,500	1,873.00	19,666,500
市光工業	11,400	654.00	7,455,600
小糸製作所	42,700	7,090.00	302,743,000
ミツバ	14,900	690.00	10,281,000
S C R E E Nホールディングス	12,600	10,770.00	135,702,000
キャノン電子	6,900	1,677.00	11,571,300
キャノン	357,100	2,710.00	967,741,000
リコー	183,300	1,116.00	204,562,800
象印マホービン	19,700	1,884.00	37,114,800
東京エレクトロン	42,000	56,470.00	2,371,740,000
トヨタ紡織	21,300	2,045.00	43,558,500
ユニプレス	13,300	935.00	12,435,500
豊田自動織機	58,000	9,790.00	567,820,000
モリタホールディングス	12,400	1,644.00	20,385,600
三櫻工業	10,900	1,116.00	12,164,400
デンソー	157,900	7,869.00	1,242,515,100
東海理化電機製作所	19,100	1,663.00	31,763,300
川崎重工業	56,300	2,558.00	144,015,400
日本車輛製造	3,800	2,158.00	8,200,400
三菱ロジスネクスト	10,900	1,134.00	12,360,600
日産自動車	848,700	572.40	485,795,880
いすゞ自動車	191,000	1,461.00	279,051,000
トヨタ自動車	727,300	9,876.00	7,182,814,800
日野自動車	91,100	1,014.00	92,375,400
三菱自動車工業	270,100	285.00	76,978,500
武蔵精密工業	16,500	2,023.00	33,379,500
日産車体	11,300	778.00	8,791,400
新明和工業	20,800	965.00	20,072,000
極東開発工業	12,800	1,739.00	22,259,200
トピー工業	7,700	1,266.00	9,748,200
タチエス	11,900	1,360.00	16,184,000
N O K	34,400	1,383.00	47,575,200

フタバ産業	21,400	490.00	10,486,000	
K Y B	8,300	3,140.00	26,062,000	
大同メタル工業	21,000	623.00	13,083,000	
プレス工業	37,600	352.00	13,235,200	
太平洋工業	15,900	1,261.00	20,049,900	
河西工業	16,400	399.00	6,543,600	
アイシン	52,400	4,270.00	223,748,000	
マツダ	226,700	960.00	217,632,000	
今仙電機製作所	10,000	726.00	7,260,000	
本田技研工業	565,300	3,382.00	1,911,844,600	
スズキ	142,600	5,097.00	726,832,200	
S U B A R U	207,200	2,093.00	433,669,600	
安永	5,400	1,245.00	6,723,000	
ヤマハ発動機	93,800	3,175.00	297,815,000	
T B K	16,700	421.00	7,030,700	
エクセディ	10,100	1,764.00	17,816,400	
豊田合成	23,400	2,342.00	54,802,800	
愛三工業	14,200	868.00	12,325,600	
ヨロズ	8,200	1,285.00	10,537,000	
エフ・シー・シー	12,100	1,596.00	19,311,600	
シマノ	29,000	34,790.00	1,008,910,000	
テイ・エス テック	33,300	1,504.00	50,083,200	
ジャムコ	7,000	1,020.00	7,140,000	
テルモ	219,900	5,331.00	1,172,286,900	
日機装	22,400	975.00	21,840,000	
日本エム・ディ・エム	4,700	2,333.00	10,965,100	
島津製作所	92,500	5,420.00	501,350,000	
J M S	8,100	863.00	6,990,300	
長野計器	6,500	1,197.00	7,780,500	
ブイ・テクノロジー	3,500	4,870.00	17,045,000	
東京計器	6,400	1,069.00	6,841,600	
インターアクション	4,000	2,891.00	11,564,000	
東京精密	12,200	5,120.00	62,464,000	
マニー	29,000	2,273.00	65,917,000	
ニコン	110,500	1,355.00	149,727,500	
トプコン	37,200	2,020.00	75,144,000	

オリンパス	377,100	2,395.50	903,343,050	
理研計器	6,300	3,135.00	19,750,500	
タムロン	5,700	2,791.00	15,908,700	
H O Y A	140,100	18,815.00	2,635,981,500	
ノーリツ鋼機	6,700	2,698.00	18,076,600	
エー・アンド・デイ	7,000	1,112.00	7,784,000	
朝日インテック	78,100	3,290.00	256,949,000	
シチズン時計	90,800	542.00	49,213,600	
メニコン	11,000	9,440.00	103,840,000	
松風	4,200	2,198.00	9,231,600	
セイコーホールディングス	10,100	2,249.00	22,714,900	
ニプロ	54,500	1,202.00	65,509,000	
スノーピーク	4,500	6,070.00	27,315,000	
パラマウントベッドホールディングス	13,600	2,267.00	30,831,200	
トランザクション	5,100	1,236.00	6,303,600	
ニホンフラッシュ	7,200	1,279.00	9,208,800	
前田工織	7,900	3,540.00	27,966,000	
永大産業	17,900	314.00	5,620,600	
アートネイチャー	8,600	743.00	6,389,800	
バンダイナムコホールディングス	59,500	8,740.00	520,030,000	
S H O E I	6,800	5,350.00	36,380,000	
フランスベッドホールディングス	11,900	966.00	11,495,400	
パイロットコーポレーション	12,100	4,415.00	53,421,500	
萩原工業	5,400	1,585.00	8,559,000	
トッパン・フォームズ	12,900	1,044.00	13,467,600	
フジシールインターナショナル	15,000	2,659.00	39,885,000	
タカラトミー	32,600	1,167.00	38,044,200	
廣濟堂	6,800	1,496.00	10,172,800	
プロネクサス	8,200	1,131.00	9,274,200	
大建工業	5,500	2,471.00	13,590,500	
凸版印刷	107,500	2,042.00	219,515,000	
大日本印刷	84,200	2,810.00	236,602,000	
共同印刷	3,100	2,765.00	8,571,500	
N I S S H A	15,300	1,906.00	29,161,800	
T A K A R A & C O M P A N Y	4,700	1,823.00	8,568,100	
アシックス	63,800	2,754.00	175,705,200	

ローランド	5,000	5,570.00	27,850,000
ヤマハ	42,600	7,350.00	313,110,000
河合楽器製作所	2,600	4,030.00	10,478,000
ピジョン	43,300	3,000.00	129,900,000
キングジム	8,400	904.00	7,593,600
リンテック	15,100	2,706.00	40,860,600
イトーキ	19,700	381.00	7,505,700
任天堂	41,100	53,890.00	2,214,879,000
三菱鉛筆	12,200	1,538.00	18,763,600
タカラスタANDARD	13,900	1,692.00	23,518,800
コクヨ	34,500	1,996.00	68,862,000
ナカバヤシ	11,400	613.00	6,988,200
グローブライド	3,600	9,300.00	33,480,000
オカムラ	24,900	1,741.00	43,350,900
美津濃	7,200	2,709.00	19,504,800
東京電力ホールディングス	610,600	301.00	183,790,600
中部電力	218,200	1,347.00	293,915,400
関西電力	273,100	1,115.00	304,506,500
中国電力	100,900	1,046.00	105,541,400
北陸電力	66,200	595.00	39,389,000
東北電力	162,700	855.00	139,108,500
四国電力	60,600	801.00	48,540,600
九州電力	154,400	859.00	132,629,600
北海道電力	67,900	528.00	35,851,200
沖縄電力	13,800	1,472.00	20,313,600
電源開発	57,300	1,666.00	95,461,800
エフオン	5,800	987.00	5,724,600
イーレックス	10,900	2,999.00	32,689,100
レノバ	12,400	5,970.00	74,028,000
東京瓦斯	139,200	2,158.00	300,393,600
大阪瓦斯	128,200	2,140.00	274,348,000
東邦瓦斯	35,300	5,290.00	186,737,000
北海道瓦斯	5,900	1,616.00	9,534,400
広島ガス	22,700	407.00	9,238,900
西部ガスホールディングス	8,300	2,510.00	20,833,000
静岡ガス	19,000	1,326.00	25,194,000

メタウォーター	8,300	1,986.00	16,483,800	
SBSホールディングス	5,300	4,195.00	22,233,500	
東武鉄道	73,200	2,873.00	210,303,600	
相鉄ホールディングス	25,100	2,148.00	53,914,800	
東急	178,200	1,529.00	272,467,800	
京浜急行電鉄	92,500	1,290.00	119,325,000	
小田急電鉄	114,100	2,485.00	283,538,500	
京王電鉄	39,800	5,780.00	230,044,000	
京成電鉄	53,800	3,465.00	186,417,000	
富士急行	10,000	4,460.00	44,600,000	
新京成電鉄	3,600	2,165.00	7,794,000	
東日本旅客鉄道	126,500	6,876.00	869,814,000	
西日本旅客鉄道	64,600	5,045.00	325,907,000	
東海旅客鉄道	59,800	15,695.00	938,561,000	
西武ホールディングス	87,700	1,305.00	114,448,500	
鴻池運輸	11,500	1,432.00	16,468,000	
西日本鉄道	19,900	2,764.00	55,003,600	
ハマキョウレックス	5,600	3,485.00	19,516,000	
サカイ引越センター	3,300	4,990.00	16,467,000	
近鉄グループホールディングス	66,800	3,575.00	238,810,000	
阪急阪神ホールディングス	90,400	3,415.00	308,716,000	
南海電気鉄道	32,800	2,328.00	76,358,400	
京阪ホールディングス	30,500	3,050.00	93,025,000	
神戸電鉄	2,900	3,630.00	10,527,000	
名古屋鉄道	55,900	1,955.00	109,284,500	
山陽電気鉄道	6,300	2,078.00	13,091,400	
日本通運	23,500	8,060.00	189,410,000	
ヤマトホールディングス	95,200	2,947.00	280,554,400	
山九	17,200	5,410.00	93,052,000	
丸全昭和運輸	5,800	3,730.00	21,634,000	
センコーグループホールディングス	36,600	1,043.00	38,173,800	
トナミホールディングス	1,900	5,120.00	9,728,000	
ニッコンホールディングス	23,000	2,439.00	56,097,000	
福山通運	8,600	4,905.00	42,183,000	
セイノーホールディングス	49,900	1,395.00	69,610,500	
神奈川中央交通	2,500	3,635.00	9,087,500	

日立物流	14,200	4,750.00	67,450,000	
丸和運輸機関	14,600	1,690.00	24,674,000	
C & F ロジホールディングス	7,700	1,926.00	14,830,200	
九州旅客鉄道	53,300	2,453.00	130,744,900	
S Gホールディングス	128,400	3,275.00	420,510,000	
日本郵船	56,700	10,350.00	586,845,000	
商船三井	40,300	9,400.00	378,820,000	
川崎汽船	21,100	7,210.00	152,131,000	
N S ユナイテッド海運	3,800	4,770.00	18,126,000	
飯野海運	35,000	565.00	19,775,000	
乾汽船	6,000	2,500.00	15,000,000	
日本航空	165,700	2,403.00	398,177,100	
A N A ホールディングス	184,000	2,612.00	480,608,000	
トランコム	2,200	8,990.00	19,778,000	
日新	6,700	1,723.00	11,544,100	
三菱倉庫	23,900	3,305.00	78,989,500	
三井倉庫ホールディングス	7,500	2,763.00	20,722,500	
住友倉庫	24,600	1,965.00	48,339,000	
澁澤倉庫	4,800	2,496.00	11,980,800	
東陽倉庫	20,900	355.00	7,419,500	
日本トランスシティ	18,000	679.00	12,222,000	
川西倉庫	4,000	1,470.00	5,880,000	
安田倉庫	7,600	1,020.00	7,752,000	
東洋埠頭	5,100	1,570.00	8,007,000	
上組	37,500	2,444.00	91,650,000	
近鉄エクスプレス	13,100	3,015.00	39,496,500	
エーアイティー	6,800	1,180.00	8,024,000	
N E C ネットズエスアイ	22,400	2,277.00	51,004,800	
システナ	25,000	2,428.00	60,700,000	
デジタルアーツ	4,200	9,220.00	38,724,000	
日鉄ソリューションズ	9,800	4,025.00	39,445,000	
キューブシステム	5,100	1,147.00	5,849,700	
コア	4,500	1,574.00	7,083,000	
ラクーンホールディングス	5,900	1,618.00	9,546,200	
ソリトンシステムズ	4,300	1,586.00	6,819,800	
ソフトクリエイトホールディングス	3,300	3,505.00	11,566,500	

T I S	70,100	3,210.00	225,021,000	
グリー	44,100	677.00	29,855,700	
G M O ペパボ	900	3,390.00	3,051,000	
コーエーテクモホールディングス	18,800	5,890.00	110,732,000	
三菱総合研究所	3,100	4,550.00	14,105,000	
ファインデックス	7,800	1,109.00	8,650,200	
ブレインパッド	2,100	6,240.00	13,104,000	
K L a b	14,300	636.00	9,094,800	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	10,500	1,054.00	11,067,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	4,020.00	6,030,000	
ネクソン	159,200	1,965.00	312,828,000	
アイスタイル	24,300	453.00	11,007,900	
エムアップホールディングス	2,200	3,320.00	7,304,000	
エイチーム	6,600	1,575.00	10,395,000	
エニグモ	7,500	1,334.00	10,005,000	
テクノスジャパン	8,900	636.00	5,660,400	
コロプラ	23,700	856.00	20,287,200	
ブロードリーフ	36,500	547.00	19,965,500	
デジタルハーツホールディングス	4,600	2,261.00	10,400,600	
システム情報	6,600	1,071.00	7,068,600	
メディアドゥ	2,900	5,430.00	15,747,000	
じげん	22,000	434.00	9,548,000	
ブイキューブ	7,400	1,719.00	12,720,600	
サイバーリンクス	3,100	1,551.00	4,808,100	
フィックスターズ	9,500	816.00	7,752,000	
C A R T A H O L D I N G S	4,000	2,600.00	10,400,000	
オブティム	5,600	2,013.00	11,272,800	
セレス	2,600	2,976.00	7,737,600	
S H I F T	3,600	28,010.00	100,836,000	
ティーガイア	7,100	2,047.00	14,533,700	
テクマトリックス	11,400	2,059.00	23,472,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	20,100	2,251.00	45,245,100	
G M O ペイメントゲートウェイ	13,700	15,950.00	218,515,000	
システムリサーチ	3,000	2,151.00	6,453,000	
インターネットイニシアティブ	18,900	4,110.00	77,679,000	

さくらインターネット	10,300	649.00	6,684,700	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,800	5,110.00	9,198,000	
SRAホールディングス	4,500	2,976.00	13,392,000	
朝日ネット	7,900	785.00	6,201,500	
eBASE	9,600	846.00	8,121,600	
アバント	8,000	1,653.00	13,224,000	
アドソル日進	3,400	2,336.00	7,942,400	
フリービット	6,400	1,084.00	6,937,600	
コムチュア	6,500	3,240.00	21,060,000	
アステリア	7,200	725.00	5,220,000	
アイル	4,700	1,979.00	9,301,300	
マークライنز	3,700	3,175.00	11,747,500	
メディカル・データ・ビジョン	8,500	1,678.00	14,263,000	
gumi	11,200	884.00	9,900,800	
テラスカイ	2,800	2,242.00	6,277,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	2,189.00	9,631,600	
PCIホールディングス	4,600	1,148.00	5,280,800	
ネオジャパン	2,200	1,700.00	3,740,000	
PR TIMES	1,800	3,190.00	5,742,000	
ラクス	21,400	4,685.00	100,259,000	
ダブルスタンダード	1,100	7,880.00	8,668,000	
オープンドア	4,900	2,264.00	11,093,600	
アカツキ	3,100	3,275.00	10,152,500	
Ubicomホールディングス	2,300	3,050.00	7,015,000	
カナミックネットワーク	10,000	648.00	6,480,000	
チェンジ	13,100	2,373.00	31,086,300	
オークネット	4,800	2,223.00	10,670,400	
エイトレッド	2,000	2,548.00	5,096,000	
マクロミル	16,700	817.00	13,643,900	
オロ	2,600	3,780.00	9,828,000	
ユーザーローカル	3,000	2,137.00	6,411,000	
マネーフォワード	10,000	8,970.00	89,700,000	
電算システムホールディングス	3,400	2,930.00	9,962,000	
プロトコーポレーション	9,400	1,667.00	15,669,800	
野村総合研究所	122,000	4,450.00	542,900,000	
サイバネットシステム	7,600	700.00	5,320,000	

インテージホールディングス	9,500	1,655.00	15,722,500	
ソースネクスト	38,400	246.00	9,446,400	
インフォコム	6,500	2,611.00	16,971,500	
HEROZ	2,300	2,011.00	4,625,300	
ラクスル	8,000	6,640.00	53,120,000	
I P S	2,200	2,208.00	4,857,600	
イーソル	5,100	1,142.00	5,824,200	
アルテリア・ネットワークス	8,400	1,750.00	14,700,000	
E d u L a b	900	2,800.00	2,520,000	
ウイングアーク1 s t	4,200	2,390.00	10,038,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	2,000	1,977.00	3,954,000	
S a n s a n	6,400	12,800.00	81,920,000	
ギフトィ	6,200	3,765.00	23,343,000	
ベース	1,000	5,130.00	5,130,000	
フォーカスシステムズ	6,200	1,059.00	6,565,800	
クレスコ	6,000	2,052.00	12,312,000	
フジ・メディア・ホールディングス	71,400	1,193.00	85,180,200	
オービック	22,100	23,640.00	522,444,000	
ジャストシステム	10,000	7,180.00	71,800,000	
T D C ソフト	7,600	1,458.00	11,080,800	
Zホールディングス	970,400	739.50	717,610,800	
トレンドマイクロ	37,800	6,430.00	243,054,000	
I Dホールディングス	5,700	975.00	5,557,500	
日本オラクル	14,400	9,690.00	139,536,000	
アルファシステムズ	2,100	4,150.00	8,715,000	
フューチャー	7,800	2,830.00	22,074,000	
C A C H o l d i n g s	5,300	1,799.00	9,534,700	
S Bテクノロジー	2,900	3,120.00	9,048,000	
オービックビジネスコンサルタント	6,700	5,820.00	38,994,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,800	3,830.00	121,794,000	
アイティフォー	11,200	879.00	9,844,800	
大塚商会	37,900	6,190.00	234,601,000	
サイボウズ	9,400	2,554.00	24,007,600	
電通国際情報サービス	10,200	4,690.00	47,838,000	
A C C E S S	10,900	1,098.00	11,968,200	
デジタルガレージ	11,900	5,290.00	62,951,000	

EMシステムズ	13,400	850.00	11,390,000	
ウェザーニューズ	2,100	6,680.00	14,028,000	
C I J	6,500	884.00	5,746,000	
WOWOW	2,800	2,513.00	7,036,400	
スカラ	8,600	778.00	6,690,800	
ネットワンシステムズ	29,100	4,010.00	116,691,000	
アルゴグラフィックス	5,500	3,510.00	19,305,000	
マーベラス	13,000	711.00	9,243,000	
エイベックス	12,600	1,507.00	18,988,200	
日本ユニシス	24,700	3,085.00	76,199,500	
兼松エレクトロニクス	3,600	4,020.00	14,472,000	
都築電気	3,800	1,890.00	7,182,000	
T B S ホールディングス	46,200	1,716.00	79,279,200	
日本テレビホールディングス	57,000	1,241.00	70,737,000	
朝日放送グループホールディングス	8,000	753.00	6,024,000	
テレビ朝日ホールディングス	21,500	1,745.00	37,517,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	47,100	437.00	20,582,700	
テレビ東京ホールディングス	5,100	2,183.00	11,133,300	
ビジョン	10,100	1,419.00	14,331,900	
USEN - NEXT HOLDINGS	7,100	3,795.00	26,944,500	
コネクシオ	4,000	1,613.00	6,452,000	
日本電信電話	822,700	3,237.00	2,663,079,900	
K D D I	564,300	3,897.00	2,199,077,100	
ソフトバンク	638,900	1,582.00	1,010,739,800	
光通信	8,300	20,610.00	171,063,000	
エムティーアイ	9,500	743.00	7,058,500	
GMOインターネット	25,500	3,120.00	79,560,000	
ファイバーゲート	3,400	1,524.00	5,181,600	
K A D O K A W A	18,400	5,620.00	103,408,000	
学研ホールディングス	9,800	1,237.00	12,122,600	
ゼンリン	13,900	1,104.00	15,345,600	
アイネット	5,100	1,440.00	7,344,000	
松竹	4,800	12,770.00	61,296,000	
東宝	41,600	5,260.00	218,816,000	
東映	2,300	21,850.00	50,255,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	186,600	2,225.00	415,185,000	

ピー・シー・エー	1,400	5,940.00	8,316,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,200	1,737.00	5,558,400	
D T S	13,300	2,727.00	36,269,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,200	6,680.00	201,736,000	
シーイーシー	8,500	1,405.00	11,942,500	
カブコン	60,600	3,460.00	209,676,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,319.00	5,539,800	
ジャステック	5,800	1,274.00	7,389,200	
S C S K	16,200	7,720.00	125,064,000	
日本システムウエア	3,000	2,519.00	7,557,000	
アイネス	8,500	1,619.00	13,761,500	
T K C	11,600	3,790.00	43,964,000	
富士ソフト	7,400	5,790.00	42,846,000	
N S D	22,000	2,138.00	47,036,000	
コナミホールディングス	25,700	6,990.00	179,643,000	
福井コンピュータホールディングス	3,600	4,445.00	16,002,000	
J B C Cホールディングス	6,000	1,681.00	10,086,000	
ミロク情報サービス	8,200	1,682.00	13,792,400	
ソフトバンクグループ	559,100	6,634.00	3,709,069,400	
伊藤忠食品	1,900	5,410.00	10,279,000	
エレマテック	7,500	1,220.00	9,150,000	
あらた	5,600	4,560.00	25,536,000	
東京エレクトロン デバイス	2,400	8,580.00	20,592,000	
フィールズ	10,500	541.00	5,680,500	
双日	389,200	360.00	140,112,000	
アルフレッサ ホールディングス	73,500	1,744.00	128,184,000	
横浜冷凍	19,700	921.00	18,143,700	
アルコニックス	8,400	1,788.00	15,019,200	
神戸物産	55,100	4,135.00	227,838,500	
あい ホールディングス	10,200	2,452.00	25,010,400	
ダイワボウホールディングス	32,100	2,100.00	67,410,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	16,800	2,899.00	48,703,200	
ラクト・ジャパン	3,400	2,899.00	9,856,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,900	833.00	12,411,700	
八洲電機	7,200	1,085.00	7,812,000	
レスターホールディングス	7,700	1,991.00	15,330,700	

ジューテックホールディングス	3,500	1,107.00	3,874,500	
TOKAIホールディングス	33,100	921.00	30,485,100	
三洋貿易	8,900	1,246.00	11,089,400	
ビューティガレージ	1,400	3,810.00	5,334,000	
ウイン・パートナーズ	6,200	997.00	6,181,400	
シップヘルスケアホールディングス	25,500	2,975.00	75,862,500	
コメダホールディングス	16,100	2,144.00	34,518,400	
アセンテック	3,400	1,222.00	4,154,800	
小野建	7,600	1,774.00	13,482,400	
佐島電機	7,800	931.00	7,261,800	
伯東	5,700	1,985.00	11,314,500	
コンドーテック	7,600	1,051.00	7,987,600	
ナガイレーベン	9,700	2,750.00	26,675,000	
三菱食品	7,100	3,010.00	21,371,000	
松田産業	5,700	3,145.00	17,926,500	
第一興商	13,500	3,835.00	51,772,500	
メディバルホールディングス	70,200	2,208.00	155,001,600	
S P K	4,600	1,421.00	6,536,600	
萩原電気ホールディングス	3,400	2,352.00	7,996,800	
アズワン	5,100	17,780.00	90,678,000	
尾家産業	4,700	1,144.00	5,376,800	
シモジマ	6,300	1,282.00	8,076,600	
ドウシシャ	7,300	1,812.00	13,227,600	
高速	5,200	1,640.00	8,528,000	
丸文	10,600	798.00	8,458,800	
ハビネット	7,100	1,519.00	10,784,900	
日本ライフライン	23,100	1,391.00	32,132,100	
タカショー	8,100	974.00	7,889,400	
マルカ	3,600	3,025.00	10,890,000	
I D O M	23,700	1,016.00	24,079,200	
進和	5,300	2,435.00	12,905,500	
ダイトロン	4,100	2,452.00	10,053,200	
シークス	9,800	1,256.00	12,308,800	
オーハシテクニカ	5,300	1,575.00	8,347,500	
伊藤忠商事	494,600	3,560.00	1,760,776,000	
丸紅	697,600	959.60	669,416,960	

長瀬産業	38,200	1,971.00	75,292,200	
蝶理	5,600	1,989.00	11,138,400	
豊田通商	70,400	4,900.00	344,960,000	
三共生興	16,400	550.00	9,020,000	
兼松	27,600	1,470.00	40,572,000	
三井物産	563,700	2,557.00	1,441,380,900	
日本紙パルプ商事	3,900	3,930.00	15,327,000	
カメイ	9,700	1,246.00	12,086,200	
スターゼン	5,900	2,309.00	13,623,100	
山善	26,200	1,145.00	29,999,000	
椿本興業	1,800	3,940.00	7,092,000	
住友商事	445,300	1,623.50	722,944,550	
内田洋行	3,100	5,630.00	17,453,000	
三菱商事	429,600	3,595.00	1,544,412,000	
第一実業	3,400	4,975.00	16,915,000	
キャノンマーケティングジャパン	17,800	2,592.00	46,137,600	
西華産業	5,600	1,715.00	9,604,000	
佐藤商事	7,800	1,201.00	9,367,800	
菱洋エレクトロ	5,500	2,439.00	13,414,500	
東京産業	10,100	770.00	7,777,000	
ユアサ商事	7,100	3,150.00	22,365,000	
阪和興業	14,100	3,720.00	52,452,000	
正栄食品工業	4,600	4,360.00	20,056,000	
カナデン	7,700	1,072.00	8,254,400	
菱電商事	5,700	1,877.00	10,698,900	
フルサト工業	5,000	2,339.00	11,695,000	
岩谷産業	17,000	6,660.00	113,220,000	
極東貿易	3,200	2,777.00	8,886,400	
アステナホールディングス	11,800	651.00	7,681,800	
三愛石油	17,600	1,529.00	26,910,400	
稲畑産業	16,200	1,825.00	29,565,000	
G S I クレオス	5,200	1,070.00	5,564,000	
ヤマエ久野	6,800	1,237.00	8,411,600	
ワキタ	14,400	1,069.00	15,393,600	
東邦ホールディングス	23,200	1,892.00	43,894,400	
サンゲツ	19,400	1,655.00	32,107,000	

ミツウロコグループホールディングス	10,600	1,422.00	15,073,200	
シナネンホールディングス	3,300	3,755.00	12,391,500	
伊藤忠エネクス	15,400	1,050.00	16,170,000	
サンリオ	20,600	2,462.00	50,717,200	
サンワテクノス	6,000	1,533.00	9,198,000	
リョーサン	8,200	2,314.00	18,974,800	
新光商事	12,600	905.00	11,403,000	
トーヨー	4,900	1,714.00	8,398,600	
三信電気	4,800	1,743.00	8,366,400	
東陽テクニカ	9,200	1,295.00	11,914,000	
モスフードサービス	10,200	3,315.00	33,813,000	
加賀電子	6,700	3,295.00	22,076,500	
ソーダニッカ	12,000	624.00	7,488,000	
立花エレテック	6,100	1,588.00	9,686,800	
PALTAC	11,400	4,965.00	56,601,000	
三谷産業	14,500	391.00	5,669,500	
太平洋興発	7,700	677.00	5,212,900	
西本Wismettacホールディングス	2,200	3,665.00	8,063,000	
国際紙パルプ商事	21,700	364.00	7,898,800	
ヤマタネ	4,700	1,662.00	7,811,400	
日鉄物産	4,900	5,480.00	26,852,000	
泉州電業	2,500	5,070.00	12,675,000	
トラスコ中山	14,600	3,070.00	44,822,000	
オートバックスセブン	26,400	1,549.00	40,893,600	
モリト	7,400	704.00	5,209,600	
加藤産業	9,400	3,490.00	32,806,000	
イノテック	5,500	1,491.00	8,200,500	
イエローハット	13,300	1,991.00	26,480,300	
J Kホールディングス	8,100	845.00	6,844,500	
日伝	6,100	2,558.00	15,603,800	
杉本商事	4,200	2,915.00	12,243,000	
因幡電機産業	17,800	2,868.00	51,050,400	
東テク	2,900	2,855.00	8,279,500	
ミスミグループ本社	88,700	4,855.00	430,638,500	
タキヒヨー	4,100	1,882.00	7,716,200	
スズケン	30,200	3,275.00	98,905,000	

ジェコス	7,100	915.00	6,496,500	
ローソン	18,000	5,790.00	104,220,000	
サンエー	4,500	4,130.00	18,585,000	
カワチ薬品	5,200	2,343.00	12,183,600	
エービーシー・マート	10,900	5,850.00	63,765,000	
アスクル	11,900	1,757.00	20,908,300	
ゲオホールディングス	9,900	1,237.00	12,246,300	
アダストリア	10,200	1,964.00	20,032,800	
くら寿司	7,800	4,010.00	31,278,000	
キャンドウ	4,900	1,904.00	9,329,600	
パルグループホールディングス	7,300	1,782.00	13,008,600	
エディオン	27,900	1,076.00	30,020,400	
サーラコーポレーション	15,100	645.00	9,739,500	
ハローズ	3,100	3,085.00	9,563,500	
フジオフードグループ本社	7,900	1,380.00	10,902,000	
あみやき亭	2,200	2,939.00	6,465,800	
大黒天物産	2,300	7,130.00	16,399,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,150.00	7,820,000	
アルペン	5,800	3,520.00	20,416,000	
クオールホールディングス	10,700	1,629.00	17,430,300	
ジーンズホールディングス	5,000	8,080.00	40,400,000	
ビックカメラ	41,700	1,085.00	45,244,500	
D C Mホールディングス	42,600	1,119.00	47,669,400	
MonotaRO	89,900	2,588.00	232,661,200	
アーランドサービスホールディングス	6,400	2,374.00	15,193,600	
J . フロント リテイリング	85,700	1,011.00	86,642,700	
ドトール・日レスホールディングス	11,200	1,707.00	19,118,400	
マツモトキヨシホールディングス	29,200	5,310.00	155,052,000	
ブロンコビリー	5,000	2,548.00	12,740,000	
Z O Z O	41,800	4,290.00	179,322,000	
物語コーポレーション	4,000	7,570.00	30,280,000	
ココカラファイン	6,100	9,010.00	54,961,000	
三越伊勢丹ホールディングス	124,300	808.00	100,434,400	
H a m e e	2,900	1,390.00	4,031,000	
ウエルシアホールディングス	37,500	4,030.00	151,125,000	
クリエイトSDホールディングス	10,000	3,880.00	38,800,000	

シュッピン	6,800	1,295.00	8,806,000	
オイシックス・ラ・大地	9,500	4,560.00	43,320,000	
ネクステージ	12,700	2,337.00	29,679,900	
ジョイフル本田	19,400	1,530.00	29,682,000	
ホットランド	7,000	1,361.00	9,527,000	
すかいらーくホールディングス	91,400	1,589.00	145,234,600	
SFPホールディングス	5,300	1,475.00	7,817,500	
綿半ホールディングス	6,700	1,327.00	8,890,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19,500	1,149.00	22,405,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,521.00	8,821,800	
B E E N O S	3,900	3,055.00	11,914,500	
あさひ	5,600	1,404.00	7,862,400	
日本調剤	5,500	1,774.00	9,757,000	
コスモス薬品	7,200	19,820.00	142,704,000	
セブン&アイ・ホールディングス	276,500	5,158.00	1,426,187,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	39,300	922.00	36,234,600	
ツルハホールディングス	15,400	14,120.00	217,448,000	
サンマルクホールディングス	7,300	1,589.00	11,599,700	
トリドールホールディングス	18,100	2,635.00	47,693,500	
JMホールディングス	5,700	2,347.00	13,377,900	
アレンザホールディングス	6,400	1,463.00	9,363,200	
パロックジャパンリミテッド	8,000	887.00	7,096,000	
クスリのアオキホールディングス	7,200	8,280.00	59,616,000	
FOOD & LIFE COMPANIE	41,700	5,060.00	211,002,000	
メディカルシステムネットワーク	8,300	789.00	6,548,700	
ノジマ	12,600	2,941.00	37,056,600	
カッパ・クリエイト	11,300	1,418.00	16,023,400	
良品計画	82,000	2,584.00	211,888,000	
アドヴァングループ	9,400	972.00	9,136,800	
アルピス	3,000	2,523.00	7,569,000	
コナカ	15,700	376.00	5,903,200	
G - 7ホールディングス	3,700	4,345.00	16,076,500	
イオン北海道	10,000	1,270.00	12,700,000	
コジマ	14,000	688.00	9,632,000	
コーナン商事	10,200	3,765.00	38,403,000	

エコス	3,400	1,999.00	6,796,600	
ワタミ	11,400	1,034.00	11,787,600	
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	141,200	2,044.00	288,612,800	
西松屋チェーン	15,900	1,447.00	23,007,300	
ゼンショーホールディングス	38,400	2,830.00	108,672,000	
幸楽苑ホールディングス	6,200	1,507.00	9,343,400	
サイゼリヤ	10,800	2,843.00	30,704,400	
V Tホールディングス	29,100	586.00	17,052,600	
フジ・コーポレーション	6,000	1,249.00	7,494,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	1,982.00	17,441,600	
ハイデイ日高	10,300	1,743.00	17,952,900	
コロワイド	24,400	1,772.00	43,236,800	
ピーシーデポコーポレーション	11,700	473.00	5,534,100	
壱番屋	4,900	4,870.00	23,863,000	
スギホールディングス	14,200	8,650.00	122,830,000	
薬王堂ホールディングス	3,500	2,585.00	9,047,500	
スクロール	11,400	903.00	10,294,200	
ヨンドシーホールディングス	7,200	1,863.00	13,413,600	
木曽路	9,700	2,514.00	24,385,800	
S R S ホールディングス	11,400	847.00	9,655,800	
千趣会	19,800	398.00	7,880,400	
リテールパートナーズ	9,500	1,297.00	12,321,500	
ケーヨー	16,000	855.00	13,680,000	
上新電機	7,800	2,641.00	20,599,800	
日本瓦斯	34,900	1,680.00	58,632,000	
ロイヤルホールディングス	12,600	2,109.00	26,573,400	
いなげや	8,100	1,465.00	11,866,500	
チヨダ	9,100	818.00	7,443,800	
ライフコーポレーション	6,700	4,835.00	32,394,500	
リンガーハット	9,400	2,360.00	22,184,000	
MrMaxHD	11,600	687.00	7,969,200	
AOKIホールディングス	17,400	693.00	12,058,200	
オークワ	11,600	1,203.00	13,954,800	
コメリ	10,600	2,685.00	28,461,000	
青山商事	18,100	786.00	14,226,600	

しまむら	8,200	10,040.00	82,328,000	
高島屋	52,300	1,153.00	60,301,900	
松屋	16,400	1,153.00	18,909,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,600	951.00	31,953,600	
近鉄百貨店	3,200	2,699.00	8,636,800	
丸井グループ	60,700	2,113.00	128,259,100	
アクシアル リテイリング	5,800	4,125.00	23,925,000	
イオン	271,600	3,066.00	832,725,600	
イズミ	14,600	3,620.00	52,852,000	
平和堂	12,300	2,341.00	28,794,300	
フジ	8,700	2,250.00	19,575,000	
ヤオコー	7,900	7,350.00	58,065,000	
ゼビオホールディングス	9,400	1,193.00	11,214,200	
ケーズホールディングス	60,000	1,196.00	71,760,000	
日産東京販売ホールディングス	20,900	247.00	5,162,300	
Genky DrugStores	3,400	5,180.00	17,612,000	
ブックオフグループホールディングス	6,100	990.00	6,039,000	
アインホールディングス	10,500	7,460.00	78,330,000	
元気寿司	2,900	2,732.00	7,922,800	
ヤマダホールディングス	237,700	491.00	116,710,700	
アークランドサカモト	11,400	1,814.00	20,679,600	
ニトリホールディングス	28,100	22,520.00	632,812,000	
グルメ杵屋	6,900	1,025.00	7,072,500	
吉野家ホールディングス	23,800	2,211.00	52,621,800	
松屋フーズホールディングス	3,400	3,660.00	12,444,000	
サガミホールディングス	12,900	1,044.00	13,467,600	
関西スーパーマーケット	6,100	1,901.00	11,596,100	
王将フードサービス	4,400	6,090.00	26,796,000	
プレナス	8,300	2,163.00	17,952,900	
ミニストップ	6,400	1,504.00	9,625,600	
アークス	12,900	2,370.00	30,573,000	
パローホールディングス	13,900	2,531.00	35,180,900	
ベルク	3,600	6,250.00	22,500,000	
ファーストリテイリング	9,500	75,940.00	721,430,000	
サンドラッグ	26,700	3,635.00	97,054,500	
ベルーナ	15,800	883.00	13,951,400	

じもとホールディングス	6,000	733.00	4,398,000	
めぶきフィナンシャルグループ	366,400	259.00	94,897,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,500	1,663.00	15,798,500	
九州フィナンシャルグループ	141,200	432.00	60,998,400	
ゆうちょ銀行	198,800	989.00	196,613,200	
富山第一銀行	20,100	305.00	6,130,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	432,300	453.00	195,831,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	47,600	733.00	34,890,800	
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,506.00	10,090,200	
第四北越フィナンシャルグループ	11,600	2,733.00	31,702,800	
ひろぎんホールディングス	106,500	664.00	70,716,000	
新生銀行	58,100	1,890.00	109,809,000	
あおぞら銀行	42,200	2,799.00	118,117,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,842,700	639.50	3,096,906,650	
りそなホールディングス	820,700	450.00	369,315,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	132,900	3,859.00	512,861,100	
三井住友フィナンシャルグループ	490,200	3,992.00	1,956,878,400	
千葉銀行	235,900	734.00	173,150,600	
群馬銀行	145,100	364.00	52,816,400	
武蔵野銀行	11,000	1,942.00	21,362,000	
千葉興業銀行	23,000	294.00	6,762,000	
筑波銀行	29,400	185.00	5,439,000	
七十七銀行	22,400	1,302.00	29,164,800	
青森銀行	5,600	2,220.00	12,432,000	
秋田銀行	4,300	1,504.00	6,467,200	
山形銀行	7,700	897.00	6,906,900	
岩手銀行	5,500	1,782.00	9,801,000	
東邦銀行	67,000	217.00	14,539,000	
東北銀行	4,000	1,053.00	4,212,000	
みちのく銀行	4,500	893.00	4,018,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,800	2,094.00	133,597,200	
静岡銀行	169,300	929.00	157,279,700	
十六銀行	8,900	2,296.00	20,434,400	
スルガ銀行	64,200	395.00	25,359,000	
八十二銀行	153,900	400.00	61,560,000	
山梨中央銀行	9,000	860.00	7,740,000	

大垣共立銀行	14,200	1,979.00	28,101,800	
福井銀行	6,200	1,693.00	10,496,600	
北國銀行	7,000	2,211.00	15,477,000	
清水銀行	3,300	1,686.00	5,563,800	
富山銀行	1,500	2,410.00	3,615,000	
滋賀銀行	14,200	1,935.00	27,477,000	
南都銀行	10,500	2,060.00	21,630,000	
百五銀行	66,300	338.00	22,409,400	
京都銀行	25,400	5,250.00	133,350,000	
紀陽銀行	25,100	1,610.00	40,411,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	47,500	872.00	41,420,000	
山陰合同銀行	46,400	575.00	26,680,000	
中国銀行	60,000	918.00	55,080,000	
伊予銀行	91,500	603.00	55,174,500	
百十四銀行	8,000	1,606.00	12,848,000	
四国銀行	12,000	764.00	9,168,000	
阿波銀行	11,000	2,272.00	24,992,000	
大分銀行	4,500	1,890.00	8,505,000	
宮崎銀行	4,700	2,179.00	10,241,300	
佐賀銀行	4,500	1,525.00	6,862,500	
沖縄銀行	6,800	2,880.00	19,584,000	
琉球銀行	15,700	809.00	12,701,300	
セブン銀行	240,100	260.00	62,426,000	
みずほフィナンシャルグループ	961,600	1,612.50	1,550,580,000	
山口フィナンシャルグループ	89,000	681.00	60,609,000	
名古屋銀行	6,000	2,821.00	16,926,000	
北洋銀行	109,800	272.00	29,865,600	
愛知銀行	2,700	3,710.00	10,017,000	
中京銀行	3,000	1,439.00	4,317,000	
愛媛銀行	11,700	805.00	9,418,500	
京葉銀行	32,400	466.00	15,098,400	
栃木銀行	42,400	184.00	7,801,600	
北日本銀行	2,700	1,619.00	4,371,300	
東和銀行	12,300	542.00	6,666,600	
トモニホールディングス	55,000	332.00	18,260,000	
フィデアホールディングス	75,000	133.00	9,975,000	

池田泉州ホールディングス	82,200	172.00	14,138,400	
F P G	24,300	728.00	17,690,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,600	1,389.00	7,778,400	
S B I ホールディングス	87,100	2,850.00	248,235,000	
ジャフコ グループ	9,000	7,310.00	65,790,000	
大和証券グループ本社	531,100	696.10	369,698,710	
野村ホールディングス	1,081,700	570.30	616,893,510	
岡三証券グループ	61,500	435.00	26,752,500	
丸三証券	22,300	694.00	15,476,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	75,800	440.00	33,352,000	
水戸証券	22,400	325.00	7,280,000	
いちよし証券	16,600	713.00	11,835,800	
松井証券	36,200	853.00	30,878,600	
マネックスグループ	64,600	608.00	39,276,800	
極東証券	9,700	915.00	8,875,500	
岩井コスモホールディングス	8,100	1,474.00	11,939,400	
藍澤証券	13,900	1,186.00	16,485,400	
スパークス・グループ	35,200	306.00	10,771,200	
かんぽ生命保険	88,100	2,078.00	183,071,800	
S O M P O ホールディングス	124,400	5,206.00	647,626,400	
アニコム ホールディングス	23,200	910.00	21,112,000	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	171,500	3,901.00	669,021,500	
第一生命ホールディングス	348,300	2,445.00	851,593,500	
東京海上ホールディングス	233,200	5,985.00	1,395,702,000	
T & D ホールディングス	212,100	1,497.00	317,513,700	
アドバンスクリエイト	4,000	1,145.00	4,580,000	
全国保証	18,400	5,690.00	104,696,000	
日本モーゲージサービス	4,100	1,090.00	4,469,000	
アルヒ	11,800	1,354.00	15,977,200	
プレミアグループ	3,700	3,685.00	13,634,500	
クレディセゾン	41,500	1,360.00	56,440,000	
芙蓉総合リース	7,300	8,040.00	58,692,000	
みずほリース	11,100	3,770.00	41,847,000	
東京センチュリー	16,500	6,610.00	109,065,000	
日本証券金融	31,400	931.00	29,233,400	

アイフル	123,900	377.00	46,710,300
リコーリース	5,800	3,860.00	22,388,000
イオンフィナンシャルサービス	43,500	1,338.00	58,203,000
アコム	141,700	434.00	61,497,800
ジャックス	8,500	2,895.00	24,607,500
オリエントコーポレーション	199,800	156.00	31,168,800
オリックス	429,700	2,173.50	933,952,950
三菱H C キャピタル	241,100	601.00	144,901,100
日本取引所グループ	191,900	3,031.00	581,648,900
イー・ギャランティ	8,200	2,586.00	21,205,200
N E C キャピタルソリューション	3,600	2,210.00	7,956,000
いちご	82,300	370.00	30,451,000
日本駐車場開発	94,200	167.00	15,731,400
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,524.00	8,229,600
S R E ホールディングス	1,300	7,970.00	10,361,000
ヒューリック	149,700	1,353.00	202,544,100
三栄建築設計	3,500	1,991.00	6,968,500
野村不動産ホールディングス	40,700	2,985.00	121,489,500
三重交通グループホールディングス	18,800	539.00	10,133,200
サムティ	10,100	2,380.00	24,038,000
ディア・ライフ	16,100	510.00	8,211,000
日本商業開発	6,800	1,756.00	11,940,800
プレサンスコーポレーション	11,800	1,944.00	22,939,200
日本管理センター	5,900	1,269.00	7,487,100
フージャースホールディングス	13,600	697.00	9,479,200
オープンハウス	22,600	6,220.00	140,572,000
東急不動産ホールディングス	193,000	686.00	132,398,000
飯田グループホールディングス	59,200	2,945.00	174,344,000
ハウスドゥ	5,300	1,029.00	5,453,700
ケイアイスター不動産	2,400	5,680.00	13,632,000
グッドコムアセット	4,000	1,341.00	5,364,000
ジェイ・エス・ピー	1,800	3,320.00	5,976,000
パーク24	38,800	1,911.00	74,146,800
バラカ	3,900	1,844.00	7,191,600
三井不動産	322,500	2,624.50	846,401,250
三菱地所	464,900	1,810.50	841,701,450

平和不動産	12,200	4,245.00	51,789,000
東京建物	70,800	1,769.00	125,245,200
ダイビル	18,700	1,587.00	29,676,900
京阪神ビルディング	12,900	1,533.00	19,775,700
住友不動産	159,500	3,964.00	632,258,000
テオオーシー	16,100	676.00	10,883,600
東京楽天地	1,800	4,195.00	7,551,000
スターツコーポレーション	8,000	2,987.00	23,896,000
フジ住宅	11,800	729.00	8,602,200
空港施設	11,900	596.00	7,092,400
ゴールドクレスト	7,400	1,780.00	13,172,000
日神グループホールディングス	12,800	528.00	6,758,400
日本エスコン	14,100	806.00	11,364,600
タカラレーベン	35,000	324.00	11,340,000
A V A N T I A	7,800	903.00	7,043,400
イオンモール	36,100	1,726.00	62,308,600
カチタス	17,700	4,180.00	73,986,000
トーセイ	11,500	1,220.00	14,030,000
サンフロンティア不動産	11,000	1,200.00	13,200,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,100	1,083.00	8,772,300
ランドビジネス	13,800	271.00	3,739,800
日本空港ビルデング	25,100	4,955.00	124,370,500
日本工営	4,400	3,545.00	15,598,000
L I F U L L	29,900	371.00	11,092,900
ミクシィ	17,600	2,765.00	48,664,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,600	2,132.00	11,939,200
日本M & A センター	113,100	3,645.00	412,249,500
メンバーズ	2,600	3,380.00	8,788,000
UTグループ	10,100	3,160.00	31,916,000
アイティメディア	3,200	2,397.00	7,670,400
タケエイ	9,100	1,851.00	16,844,100
E・Jホールディングス	4,000	1,370.00	5,480,000
夢真ビーネックスグループ	18,700	1,347.00	25,188,900
コシダカホールディングス	19,800	592.00	11,721,600
パソナグループ	7,800	3,400.00	26,520,000
リンクアンドモチベーション	15,200	1,112.00	16,902,400

エス・エム・エス	23,500	4,325.00	101,637,500	
パーソルホールディングス	68,900	2,755.00	189,819,500	
リニカル	7,300	841.00	6,139,300	
クックパッド	29,600	237.00	7,015,200	
スタジオアリス	4,600	2,427.00	11,164,200	
シミックホールディングス	5,300	1,528.00	8,098,400	
総合警備保障	27,100	5,060.00	137,126,000	
カカコム	51,300	3,755.00	192,631,500	
アイロムグループ	3,300	2,328.00	7,682,400	
セントケア・ホールディング	6,400	1,022.00	6,540,800	
ルネサンス	7,300	1,203.00	8,781,900	
ディップ	11,000	4,280.00	47,080,000	
デジタルホールディングス	5,400	1,814.00	9,795,600	
新日本科学	11,100	944.00	10,478,400	
ベネフィット・ワン	25,300	5,510.00	139,403,000	
エムスリー	121,300	8,721.00	1,057,857,300	
アウトソーシング	39,700	2,057.00	81,662,900	
ウェルネット	11,700	537.00	6,282,900	
ワールドホールディングス	2,900	2,872.00	8,328,800	
ディー・エヌ・エー	29,700	2,092.00	62,132,400	
博報堂D Yホールディングス	95,200	1,916.00	182,403,200	
ぐるなび	15,600	541.00	8,439,600	
タカミヤ	13,400	485.00	6,499,000	
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	1,247.00	8,729,000	
ファンコミュニケーションズ	25,100	439.00	11,018,900	
ライク	2,700	1,905.00	5,143,500	
エスプール	18,300	1,064.00	19,471,200	
WDBホールディングス	3,700	3,670.00	13,579,000	
手間いらず	1,100	5,960.00	6,556,000	
アドウェイズ	12,400	737.00	9,138,800	
バリューコマース	4,800	4,855.00	23,304,000	
インフォマート	71,200	1,090.00	77,608,000	
J Pホールディングス	27,700	279.00	7,728,300	
プレステージ・インターナショナル	26,800	791.00	21,198,800	
アミューズ	4,600	2,391.00	10,998,600	
クイック	6,300	1,437.00	9,053,100	

電通グループ	70,900	4,320.00	306,288,000	
イオンファンタジー	3,600	2,020.00	7,272,000	
シーティーエス	8,900	823.00	7,324,700	
H . U . グループホールディングス	19,400	3,245.00	62,953,000	
アルプス技研	6,800	2,118.00	14,402,400	
日本空調サービス	11,200	737.00	8,254,400	
オリエンタルランド	73,000	17,040.00	1,243,920,000	
ダスキン	15,700	2,696.00	42,327,200	
明光ネットワークジャパン	13,600	628.00	8,540,800	
ファルコホールディングス	4,700	1,791.00	8,417,700	
ラウンドワン	24,400	1,374.00	33,525,600	
リゾートトラスト	32,300	2,049.00	66,182,700	
ビー・エム・エル	8,900	4,485.00	39,916,500	
りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,285.00	13,749,500	
リソー教育	38,000	434.00	16,492,000	
ユー・エス・エス	76,900	1,998.00	153,646,200	
東京個別指導学院	9,400	665.00	6,251,000	
サイバーエージェント	170,200	2,286.00	389,077,200	
楽天グループ	353,300	1,129.00	398,875,700	
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,881.00	9,405,000	
モーニングスター	15,400	532.00	8,192,800	
山田コンサルティンググループ	5,800	1,168.00	6,774,400	
セントラルスポーツ	4,100	2,555.00	10,475,500	
フルキャストホールディングス	6,600	2,326.00	15,351,600	
エン・ジャパン	12,500	4,145.00	51,812,500	
テクノプロ・ホールディングス	41,700	3,370.00	140,529,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,900	15,370.00	44,573,000	
Keeper 技研	5,000	4,170.00	20,850,000	
Gunosy	6,100	722.00	4,404,200	
イー・ガーディアン	3,300	3,325.00	10,972,500	
ジャパンマテリアル	21,600	1,367.00	29,527,200	
ベクトル	10,000	1,144.00	11,440,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,900	1,667.00	9,835,300	
キャリアリンク	2,800	1,903.00	5,328,400	
I B J	7,800	1,057.00	8,244,600	
アサンテ	4,200	1,850.00	7,770,000	

バリューHR	4,100	1,814.00	7,437,400
M&Aキャピタルパートナーズ	5,700	5,880.00	33,516,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,628.00	6,349,200
シグマクシス	4,500	2,948.00	13,266,000
ウィルグループ	6,600	1,320.00	8,712,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,800	223.00	3,969,400
メドピア	5,400	4,355.00	23,517,000
リクルートホールディングス	491,300	6,966.00	3,422,395,800
エラン	9,500	1,290.00	12,255,000
日本郵政	516,500	981.80	507,099,700
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,698.00	20,545,800
鎌倉新書	8,200	944.00	7,740,800
アトラエ	5,400	2,637.00	14,239,800
ストライク	2,800	4,350.00	12,180,000
ソラスト	17,200	1,576.00	27,107,200
セラク	2,800	2,355.00	6,594,000
インソース	7,000	2,125.00	14,875,000
ベйкаレント・コンサルティング	4,500	58,100.00	261,450,000
Orchestra Holdings	2,000	3,800.00	7,600,000
アイモバイル	2,900	1,414.00	4,100,600
グレイステクノロジー	7,600	1,147.00	8,717,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	20,000	2,692.00	53,840,000
ミダックホールディングス	3,500	5,590.00	19,565,000
日総工産	7,500	759.00	5,692,500
キュービーネットホールディングス	5,000	1,883.00	9,415,000
RPAホールディングス	9,700	613.00	5,946,100
マネジメントソリューションズ	4,000	3,470.00	13,880,000
プロレド・パートナーズ	1,600	2,120.00	3,392,000
カーブスホールディングス	20,200	906.00	18,301,200
ダイレクトマーケティングミックス	4,100	4,465.00	18,306,500
ポピンズホールディングス	2,200	3,350.00	7,370,000
LITALICO	2,800	6,870.00	19,236,000
リログループ	38,300	2,357.00	90,273,100
東祥	5,300	1,844.00	9,773,200
エイチ・アイ・エス	16,100	2,345.00	37,754,500

ラックランド	3,200	2,887.00	9,238,400	
共立メンテナンス	11,700	3,875.00	45,337,500	
イチネンホールディングス	8,600	1,330.00	11,438,000	
建設技術研究所	5,000	2,700.00	13,500,000	
長大	3,500	2,483.00	8,690,500	
燦ホールディングス	4,800	1,538.00	7,382,400	
東京テアトル	5,800	1,302.00	7,551,600	
ナガワ	2,200	13,410.00	29,502,000	
東京都競馬	4,700	4,210.00	19,787,000	
カナモト	12,400	2,714.00	33,653,600	
西尾レントオール	6,400	3,045.00	19,488,000	
トランス・コスモス	6,900	3,750.00	25,875,000	
乃村工藝社	30,700	1,005.00	30,853,500	
日本管財	6,400	2,730.00	17,472,000	
トーカイ	6,700	2,426.00	16,254,200	
セコム	67,300	8,541.00	574,809,300	
セントラル警備保障	3,800	2,837.00	10,780,600	
丹青社	15,500	871.00	13,500,500	
メイテック	8,600	6,800.00	58,480,000	
応用地質	7,700	1,469.00	11,311,300	
船井総研ホールディングス	14,600	2,916.00	42,573,600	
オオバ	8,700	882.00	7,673,400	
ベネッセホールディングス	25,700	2,465.00	63,350,500	
イオンディライト	8,400	3,685.00	30,954,000	
ダイセキ	14,000	4,815.00	67,410,000	
合 計	74,955,700		206,353,778,940	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	3,302,839,817	4,313,832,947
金銭信託	-	263,022,914
コール・ローン	288,473,943	80,386,695
株式	228,238,332,343	310,949,577,383
投資証券	5,709,112,254	7,648,181,672
派生商品評価勘定	57,520,150	3,425,769
未収入金	74,226,113	17,605,461
未収配当金	357,214,595	509,702,066
前払金	-	17,491,341
差入委託証拠金	2,060,491,861	2,262,987,707
流動資産合計	240,088,211,076	326,066,213,955
資産合計	240,088,211,076	326,066,213,955
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,403,886	20,178,445
前受金	56,418,040	-
未払金	31,480,138	15,861,568
未払解約金	112,690,000	388,119,296
未払利息	690	207
その他未払費用	7,560	1,134
流動負債合計	202,000,314	424,160,650
負債合計	202,000,314	424,160,650
純資産の部		
元本等		
元本	60,178,911,589	59,387,331,594
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	179,707,299,173	266,254,721,711
元本等合計	239,886,210,762	325,642,053,305
純資産合計	239,886,210,762	325,642,053,305
負債純資産合計	240,088,211,076	326,066,213,955

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 9月15日現在)		(2021年 9月15日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,178,911,589口		59,387,331,594口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	3.9862円 39,862円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	5.4834円 54,834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 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	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	5,969,131,547	-	6,025,549,587	56,418,040
	SPMINI 2012	4,473,148,034	-	4,528,520,635	55,372,601
	DJ EUR 2012	1,013,627,906	-	1,012,588,849	1,039,057
	FTSE 2012	268,614,157	-	268,981,414	367,257
	SPI200 2012	213,741,450	-	215,458,689	1,717,239
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	189,406,676	-	189,104,900	301,776
	米ドル	128,183,903	-	127,933,300	250,603
	カナダドル	6,427,380	-	6,415,200	12,180
	ユーロ	25,107,144	-	25,098,000	9,144
	英ポンド	12,219,054	-	12,218,400	654

	スイスフラン	6,992,253	-	6,983,400	8,853
	スウェーデンク ローナ	1,930,861	-	1,926,400	4,461
	ノルウェークロー ネ	350,967	-	350,400	567
	デンマーククロー ネ	1,349,984	-	1,349,600	384
	オーストラリアド ル	4,623,822	-	4,614,600	9,222
	香港ドル	1,913,553	-	1,908,200	5,353
	イスラエルシュケ ル	307,755	-	307,400	355
	合計	6,158,538,223	-	6,214,654,487	56,116,264

(2021年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,971,844,203	-	6,954,352,862	17,491,341
	SPMINI 2112	5,317,139,028	-	5,300,406,438	16,732,590
	DJ EUR 2112	1,110,283,579	-	1,108,972,695	1,310,884
	FTSE 2112	307,863,676	-	307,453,409	410,267
	SPI200 2112	236,557,920	-	237,520,320	962,400
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	22,531,200	-	22,509,910	21,290
	スウェーデンク ローナ	19,095,000	-	19,095,000	-
	イスラエルシュケ ル	3,436,200	-	3,414,910	21,290
	売建	198,111,910	-	197,351,955	759,955
	米ドル	148,554,000	-	148,025,745	528,255
	カナダドル	6,957,920	-	6,908,696	49,224
	ユーロ	20,789,600	-	20,715,408	74,192
	英ポンド	9,137,040	-	9,083,322	53,718
	スイスフラン	5,963,550	-	5,960,065	3,485

オーストラリアドル	4,051,100	-	4,009,965	41,135
香港ドル	1,838,980	-	1,832,961	6,019
シンガポールドル	819,720	-	815,793	3,927
合計	7,192,487,313	-	7,174,214,727	16,752,676

(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 9月16日 至 2021年 9月15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 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,965,014,742円
同期中における追加設定元本額	27,756,459,532円
同期中における一部解約元本額	18,542,562,685円

2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,069,924,502円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	314,398,291円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,275,622,210円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	844,314,413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)	77,679,574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)	1,726,629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)	7,270,280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)	21,350,419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)	51,016,249円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	45,221,146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)	92,825,557円
外国株式指数ファンド	559,672,380円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	7,284,680,963円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	312,818,715円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	352,729,063円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	222,103,058円
イオン・バランス戦略ファンド	68,938,211円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	10,942,676円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	78,845,428円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	63,156,998円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	197,287,832円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	100,119,280円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	111,835,149円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	27,789,535円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	83,304,398円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	1,598,623円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	7,880,104円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	5,467,099円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,791,304円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	384,546円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,030,735,635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>	6,398,828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>	59,688,739円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,190,194,032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>	1,255,200,561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>	5,345,107,978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>	16,031,634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>	86,614,229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>	274,725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>	651,864,841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>	54,595,763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>	154,273,858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>	678,822,097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>	530,085,597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>	1,278,255,149円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	516,296円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	268,676,965円

S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	111,780,799円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	14,738,214円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	11,292,139円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	5,922,681円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	35,545,255円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	90,634,725円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	418,153,613円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 >	110,332,710円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	4,911,651,620円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	210,853,707円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	1,761,001,918円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	10,193,688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 >	36,957,323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 >	50,795,778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 >	499,025,860円
合計	60,178,911,589円

(2021年 9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,178,911,589円
同期中における追加設定元本額	14,652,419,625円
同期中における一部解約元本額	15,443,999,620円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,168,209,998円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	270,701,936円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,123,977,197円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	788,686,197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)	65,349,620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)	1,226,514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)	6,216,175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)	18,459,040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)	47,352,076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)	49,401,868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)	95,449,243円
外国株式指数ファンド	712,103,617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	11,378,684,425円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	81,898,533円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	125,860,224円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	83,678,542円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,097,278円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	105,816,051円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	93,505,212円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	314,513,712円

三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	156,139,769円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	182,918,329円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	37,153,110円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	409,870,740円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,261,791円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	17,197,702円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	15,615,166円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,122,327円
S M B C ・ D C インデックスファンド(M S C I コクサイ)	84,750,468円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	182,530円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	183,976円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	844,553円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	656,464,154円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	5,585,981円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	32,980,346円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	777,058,391円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	898,186,841円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,873,800,818円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	13,223,432円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	68,583,205円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	524,369,742円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	42,750,063円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	111,968,960円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	530,244,129円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	378,468,665円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	886,984,440円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	232,559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)	235,317,339円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	82,477,988円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	9,862,293円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	8,314,514円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,471,755円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	23,803,987円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	66,591,171円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	149,638,035円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	68,493,967円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,054,599,325円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	136,159,930円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,044,221,401円
S M A M ・ 年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,459,810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>	48,604,306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>	52,827,375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>	120,158,753円
合計	59,387,331,594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	37,418	24.34	910,754.12	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	88.54	1,040,079.38	
	CHEVRON CORPORATION	100,995	96.20	9,715,719.00	
	CONOCOPHILLIPS	70,648	56.94	4,022,697.12	
	DEVON ENERGY CORPORATION	31,182	28.27	881,515.14	
	EOG RESOURCES INC	30,830	69.52	2,143,301.60	
	EXXON MOBIL CORPORATION	220,715	54.58	12,046,624.70	
	HALLIBURTON CO	44,317	20.07	889,442.19	
	HESS CORPORATION	14,344	68.91	988,445.04	
	KINDER MORGAN INC	105,940	16.01	1,696,099.40	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,933	57.56	1,953,183.48	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	26.28	1,276,682.40	
	ONEOK INC	24,725	53.05	1,311,661.25	
	PHILLIPS 66	22,492	65.24	1,467,378.08	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,184	152.95	1,863,542.80	
	SCHLUMBERGER LTD	73,444	27.67	2,032,195.48	
	VALERO ENERGY CORP	21,447	64.70	1,387,620.90	
	WILLIAMS COS INC	64,802	24.75	1,603,849.50	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,818	268.86	3,177,387.48	
	ALBEMARLE CORPORATION	6,560	230.47	1,511,883.20	
	AMCOR PLC	82,302	12.32	1,013,960.64	
	AVERY DENNISON CORP	4,232	221.82	938,742.24	
	BALL CORPORATION	17,166	92.65	1,590,429.90	
	CELANESE CORPORATION	5,598	149.71	838,076.58	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	46.12	553,532.24		
CORTEVA INC	39,348	42.26	1,662,846.48		
CROWN HOLDINGS INC	6,863	105.59	724,664.17		
DOW INC	38,654	59.65	2,305,711.10		

DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	68.47	1,913,325.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	104.50	734,321.50
ECOLAB INC	13,341	223.56	2,982,513.96
FMC CORPORATION	6,676	96.85	646,570.60
FREEPORT-MCMORAN INC	75,431	34.79	2,624,244.49
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	57.75	1,105,335.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,767	143.75	1,835,256.25
LINDE PLC	27,447	311.94	8,561,817.18
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	93.83	1,307,145.73
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	361.68	1,118,314.56
MOSAIC CO/THE	18,584	32.04	595,431.36
NEWMONT CORPORATION	41,882	57.20	2,395,650.40
NUCOR CORP	15,455	106.20	1,641,321.00
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	148.28	694,246.96
PPG INDUSTRIES INC	12,256	150.33	1,842,444.48
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	79.55	612,216.80
SEALED AIR CORP	7,895	58.15	459,094.25
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,616	298.86	4,069,277.76
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	61.97	631,536.27
VULCAN MATERIALS CO	6,698	175.73	1,177,039.54
WESTROCK CO	13,034	50.56	658,999.04
3M COMPANY	30,604	182.42	5,582,781.68
ALLEGION PLC	4,764	139.56	664,863.84
AMETEK INC	12,171	131.24	1,597,322.04
BOEING CO	28,768	211.57	6,086,445.76
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	54.98	2,378,049.94
CATERPILLAR INC	28,430	202.33	5,752,241.90
CUMMINS INC	7,315	231.82	1,695,763.30
DEERE & CO	15,722	355.98	5,596,717.56
DOVER CORP	6,972	166.97	1,164,114.84
EATON CORP PLC	21,326	156.30	3,333,253.80
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	97.65	3,044,531.70
FASTENAL COMPANY	29,892	53.04	1,585,471.68
FORTIVE CORP	15,750	74.98	1,180,935.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,166	96.20	689,369.20

GENERAC HOLDINGS INC	3,300	433.54	1,430,682.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	196.66	2,486,175.72
GENERAL ELECTRIC CO	56,767	100.38	5,698,271.46
HEICO CORP	1,888	126.51	238,850.88
HEICO CORP-CLASS A	3,183	113.52	361,334.16
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,260	220.19	7,984,089.40
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	31.59	600,968.16
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	197.75	416,659.25
IDEX CORP	3,839	215.92	828,916.88
ILLINOIS TOOL WORKS	16,869	217.07	3,661,753.83
INGERSOLL-RAND INC	21,013	53.55	1,125,246.15
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	54.00	621,000.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,803	74.37	2,885,779.11
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	226.98	2,514,711.42
LENOX INTERNATIONAL INC	1,527	313.29	478,393.83
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,359	344.34	4,600,038.06
MASCO CORP	14,885	58.96	877,619.60
NORDSON CORP	2,884	242.05	698,072.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,215	351.73	2,889,461.95
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	90.36	1,907,589.96
OWENS CORNING	5,205	93.54	486,875.70
PACCAR INC	18,041	83.93	1,514,181.13
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,691	285.71	1,911,685.61
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	75.96	624,391.20
PLUG POWER INC	28,584	24.66	704,881.44
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,825	82.74	6,521,980.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	313.31	1,948,474.89
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,657	468.72	2,651,549.04
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	57.33	435,708.00
SMITH(A.O.) CORP	7,157	68.33	489,037.81
SNAP-ON INC	3,106	216.07	671,113.42
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,007	182.38	1,460,316.66
SUNRUN INC	10,669	44.49	474,663.81
TEXTRON INC	11,803	69.84	824,321.52
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	183.74	2,344,338.66

TRANSDIGM GROUP INC	2,681	614.00	1,646,134.00
UNITED RENTALS INC	3,596	331.30	1,191,354.80
WABTEC CORP	9,231	89.40	825,251.40
WW GRAINGER INC	2,390	409.88	979,613.20
XYLEM INC	9,124	132.49	1,208,838.76
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	79.97	642,079.13
CINTAS CORP	5,169	396.11	2,047,492.59
CLARIVATE PLC	19,939	23.67	471,956.13
COPART INC	10,977	144.59	1,587,164.43
COSTAR GROUP INC	20,540	89.34	1,835,043.60
EQUIFAX INC	6,127	273.86	1,677,940.22
IHS MARKIT LTD	19,584	123.39	2,416,469.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	133.01	921,360.27
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	94.61	657,255.67
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	124.95	1,426,304.25
ROBERT HALF INTL INC	5,555	101.79	565,443.45
ROLLINS INC	11,493	37.73	433,630.89
TRANSUNION	9,497	119.00	1,130,143.00
VERISK ANALYTICS INC	7,929	205.56	1,629,885.24
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	130.22	1,765,262.32
WASTE MANAGEMENT INC	22,023	154.58	3,404,315.34
AMERCO	390	658.94	256,986.60
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	90.08	623,804.00
CSX CORPORATION	121,827	30.50	3,715,723.50
DELTA AIR LINES INC	8,299	39.44	327,312.56
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	128.28	1,114,624.92
FEDEX CORP	13,083	255.20	3,338,781.60
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	168.15	741,709.65
KANSAS CITY SOUTHERN	4,866	280.00	1,362,480.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	7,940	51.72	410,656.80
LYFT INC-A	13,145	50.53	664,216.85
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,783	244.79	3,129,150.57
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	288.66	1,421,939.16
SOUTHWEST AIRLINES	7,076	48.03	339,860.28
UBER TECHNOLOGIES INC	62,618	39.01	2,442,728.18

UNION PACIFIC CORP	34,922	203.41	7,103,484.02
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,512	191.01	7,165,167.12
APTIV PLC	14,147	149.83	2,119,645.01
AUTOLIV INC	4,001	87.55	350,287.55
BORGWARNER INC	12,075	42.95	518,621.25
FORD MOTOR COMPANY	209,141	12.86	2,689,553.26
GENERAL MOTORS CO	68,943	50.74	3,498,167.82
LEAR CORP	2,749	157.49	432,940.01
TESLA INC	42,736	744.49	31,816,524.64
D.R.HORTON INC	18,162	87.88	1,596,076.56
GARMIN LTD	8,444	169.47	1,431,004.68
HASBRO INC	7,491	97.48	730,222.68
LENNAR CORP-CL A	14,494	98.59	1,428,963.46
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	420.50	2,725,260.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	186.44	533,777.72
NEWELL BRANDS INC	17,587	24.72	434,750.64
NIKE INC -CL B	66,924	158.76	10,624,854.24
NVR INC	173	4,958.59	857,836.07
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,599	108.50	1,366,991.50
PULTE GROUP INC	13,075	47.18	616,878.50
VF CORP	17,117	70.47	1,206,234.99
WHIRLPOOL CORP	3,212	216.24	694,562.88
AIRBNB INC-CLASS A	6,554	163.30	1,070,268.20
ARAMARK	13,242	32.35	428,378.70
BOOKING HOLDINGS INC	2,139	2,328.66	4,981,003.74
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,690	103.07	1,101,818.30
CARNIVAL CORP	40,398	22.86	923,498.28
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,469	1,859.79	2,732,031.51
DARDEN RESTAURANTS INC	6,111	148.62	908,216.82
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	506.96	1,075,262.16
DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	59.05	988,615.10
EXPEDIA GROUP INC	6,894	150.60	1,038,236.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	131.82	1,926,812.94
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	38.71	682,612.14
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	142.34	2,094,533.10

MCDONALD'S CORPORATION	39,232	241.13	9,460,012.16
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,191	11.95	133,732.45
MGM MIRAGE	22,198	41.41	919,219.18
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	82.42	979,973.80
STARBUCKS CORP	62,130	118.86	7,384,771.80
VAIL RESORTS INC	2,038	298.25	607,833.50
WYNN RESORTS LTD	4,913	92.25	453,224.25
YUM! BRANDS INC	15,549	128.99	2,005,665.51
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	77.84	3,120,761.28
ALPHABET INC-CL A	15,714	2,850.89	44,798,885.46
ALPHABET INC-CL C	15,230	2,868.12	43,681,467.60
ALTICE USA INC-A	9,667	26.61	257,238.87
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	47.30	1,308,223.40
CABLE ONE INC	246	1,908.16	469,407.36
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,002	761.86	5,334,543.72
COMCAST CORP-CLASS A	239,809	55.59	13,330,982.31
DISCOVERY INC-A	7,075	26.26	185,789.50
DISCOVERY INC-C	17,417	25.29	440,475.93
DISH NETWORK CORP.	12,937	42.00	543,354.00
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	145.37	2,231,720.24
FACEBOOK INC-A	125,292	376.53	47,176,196.76
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	35.30	598,758.60
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	32.84	288,105.32
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	132.57	526,833.18
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	37.02	726,554.52
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	172.94	226,897.28
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	177.62	1,455,773.52
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	49.48	509,050.24
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	47.75	365,192.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	48.15	199,389.15
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	88.68	666,164.16
MATCH GROUP INC	12,773	157.36	2,009,959.28
NETFLIX INC	23,263	577.76	13,440,430.88
NEWS CORP-CLASS A	23,102	22.01	508,475.02
OMNICOM GROUP	10,417	72.46	754,815.82

PINTEREST INC- CLASS A	28,563	54.43	1,554,684.09
ROKU INC	6,012	316.76	1,904,361.12
SEA LTD-ADR	3,725	333.55	1,242,473.75
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.03	407,965.68
SNAP INC-A	49,643	71.31	3,540,042.33
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	152.15	868,320.05
THE WALT DISNEY CO.	94,639	182.40	17,262,153.60
TWITTER INC	40,795	60.19	2,455,451.05
VIACOMCBS INC	29,772	38.92	1,158,726.24
ZILLOW GROUP INC-A	3,154	92.21	290,830.34
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	91.90	726,561.40
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	201.17	689,208.42
AMAZON.COM INC	23,690	3,450.00	81,730,500.00
AUTOZONE INC	1,137	1,563.77	1,778,006.49
BATH & BODYWORKS INC	12,707	63.41	805,750.87
BEST BUY COMPANY INC	12,132	110.17	1,336,582.44
BURLINGTON STORES INC	3,391	290.43	984,848.13
CARMAX INC	8,427	135.00	1,137,645.00
CARVANA CO	3,803	329.07	1,251,453.21
CHEWY INC - CLASS A	3,969	72.22	286,641.18
DOLLAR GENERAL CORP	12,746	216.29	2,756,832.34
DOLLAR TREE INC	12,047	88.43	1,065,316.21
DOORDASH INC-A	3,844	203.33	781,600.52
EBAY INC	35,551	71.39	2,537,985.89
ETSY INC	6,272	214.31	1,344,152.32
GENUINE PARTS CO	7,406	120.00	888,720.00
HOME DEPOT INC	55,494	333.12	18,486,161.28
LKQ CORPORATION	15,922	51.11	813,773.42
LOWE'S COMPANIES INC	36,894	204.17	7,532,647.98
MERCADOLIBRE INC	2,337	1,856.34	4,338,266.58
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,641	590.85	2,151,284.85
POOL CORP	2,107	474.68	1,000,150.76
ROSS STORES INC	18,792	112.42	2,112,596.64
TARGET CORP	26,108	242.24	6,324,401.92
TJX COMPANIES INC	63,882	69.48	4,438,521.36

TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	205.26	1,255,575.42
ULTA BEAUTY INC	2,765	373.73	1,033,363.45
WAYFAIR INC-CLASS A	3,756	266.37	1,000,485.72
COSTCO WHOLESALE CORP	23,094	458.41	10,586,520.54
KROGER CO	38,955	41.79	1,627,929.45
SYSCO CORP	26,862	75.78	2,035,602.36
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,873	48.22	1,826,236.06
WALMART INC	81,129	144.30	11,706,914.70
ALTRIA GROUP INC	96,029	48.37	4,644,922.73
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,341	60.38	1,831,989.58
BOSTON BEER COMPANY INC-A	467	531.01	247,981.67
BROWN-FORMAN CORPORATION	16,130	70.89	1,143,455.70
BUNGE LIMITED	7,174	76.98	552,254.52
CAMPBELL SOUP CO	10,638	43.36	461,263.68
COCA-COLA CO/THE	213,435	55.69	11,886,195.15
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	10,501	58.45	613,783.45
CONAGRA BRANDS INC	24,639	33.19	817,768.41
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	215.59	1,914,654.79
GENERAL MILLS INC	31,489	58.77	1,850,608.53
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	42.41	633,562.99
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	122.46	706,349.28
KELLOGG CO	12,949	63.68	824,592.32
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	35.02	1,339,304.88
KRAFT HEINZ COMPANY	32,774	36.21	1,186,746.54
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	60.88	451,546.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	85.08	1,113,186.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	46.58	448,518.82
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,270	60.35	4,421,844.50
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,898	94.96	1,889,514.08
PEPSICO INC	71,927	155.15	11,159,474.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	81,198	101.96	8,278,948.08
THE HERSHEY COMPANY	7,514	174.55	1,311,568.70
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	75.43	1,127,603.07
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	83.71	1,045,119.35
CLOROX COMPANY	6,542	172.24	1,126,794.08

COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	43,041	77.30	3,327,069.30	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,059	330.82	3,989,358.38	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	138.12	2,458,536.00	
PROCTER & GAMBLE CO	128,383	145.43	18,670,739.69	
ABBOTT LABORATORIES	92,360	127.05	11,734,338.00	
ABIOMED INC	2,288	353.53	808,876.64	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	706.45	2,722,658.30	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	123.09	983,858.37	
ANTHEM INC	12,576	366.47	4,608,726.72	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	81.77	2,161,508.18	
BECTON DICKINSON & CO	15,140	260.45	3,943,213.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	44.85	3,343,836.60	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	52.13	787,892.82	
CENTENE CORP	30,528	60.80	1,856,102.40	
CERNER CORP	15,537	73.92	1,148,495.04	
CIGNA CORPORATION	18,324	203.65	3,731,682.60	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,771	441.47	1,223,313.37	
CVS HEALTH CORPORATION	69,353	83.89	5,818,023.17	
DANAHER CORP	33,766	324.09	10,943,222.94	
DAVITA INC	4,138	122.33	506,201.54	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	61.83	733,551.12	
DEXCOM INC	5,047	542.23	2,736,634.81	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,336	120.94	3,910,715.84	
HCA HEALTHCARE INC	14,312	254.67	3,644,837.04	
HENRY SCHEIN INC	7,559	78.44	592,927.96	
HOLOGIC INC	13,592	78.05	1,060,855.60	
HUMANA INC.	6,744	401.99	2,711,020.56	
IDEXX LABORATORIES INC	4,601	661.39	3,043,055.39	
INSULET CORP	3,400	294.29	1,000,586.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,237	1,039.01	6,480,305.37	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	296.80	1,482,516.00	
MASIMO CORPORATION	2,941	271.62	798,834.42	
MCKESSON CORP	8,411	203.99	1,715,759.89	
MEDTRONIC PLC	70,251	130.58	9,173,375.58	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,698	262.05	707,010.90	

NOVOCURE LTD	4,517	126.07	569,458.19
OAK STREET HEALTH INC	6,212	51.68	321,036.16
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	154.81	1,054,875.34
RESMED INC	7,595	292.28	2,219,866.60
STERIS PLC	5,282	215.94	1,140,595.08
STRYKER CORP	17,983	275.26	4,950,000.58
TELADOC HEALTH INC	7,496	133.72	1,002,365.12
TELEFLEX INC	2,340	387.34	906,375.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,467	412.54	20,407,116.18
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	146.82	617,084.46
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,005	299.01	2,094,565.05
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	452.06	1,708,334.74
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	147.68	1,603,214.08
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	155.67	593,725.38
ABBVIE INC	92,065	106.48	9,803,081.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,406	172.42	2,656,302.52
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	187.97	1,055,075.61
AMGEN INC	30,112	216.04	6,505,396.48
AVANTOR INC	25,606	42.01	1,075,708.06
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	802.89	979,525.80
BIO-TECHNE CORP	1,991	509.89	1,015,190.99
BIOGEN INC	7,987	295.95	2,363,752.65
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	76.17	691,623.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,054	62.11	7,208,113.94
CATALENT INC	8,935	138.15	1,234,370.25
CHARLES RIVER LABORATORIES INC	2,577	436.24	1,124,190.48
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	32.92	685,098.12
ELI LILLY & CO	42,227	233.09	9,842,691.43
EXACT SCIENCES CORP	8,428	97.06	818,021.68
GILEAD SCIENCES INC	65,673	70.45	4,626,662.85
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	106.17	1,229,660.94
ILLUMINA INC	7,655	448.85	3,435,946.75
INCYTE CORP	9,243	72.24	667,714.32
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	257.55	2,555,153.55
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	134.94	351,383.76

JOHNSON & JOHNSON	137,048	164.80	22,585,510.40
MERCK & CO. INC.	133,049	72.11	9,594,163.39
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	1,559.44	1,961,775.52
MODERNA INC	17,813	427.71	7,618,798.23
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	94.62	396,079.32
NOVAVAX INC	3,601	234.29	843,678.29
PERKINELMER INC	5,624	183.38	1,031,329.12
PFIZER INC	290,792	44.71	13,001,310.32
PPD INC	6,413	46.72	299,615.36
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	645.15	3,545,099.25
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,431	39.67	294,787.77
SEAGEN INC	6,654	150.46	1,001,160.84
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	53,937	9.06	488,669.22
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,664	562.40	11,621,433.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	188.41	2,549,187.30
VIATRIS INC	63,072	13.68	862,824.96
WATERS CORP	3,425	409.49	1,402,503.25
ZOETIS INC	25,246	203.55	5,138,823.30
BANK OF AMERICA CORP	402,525	39.84	16,036,596.00
CITIGROUP INC	107,883	68.78	7,420,192.74
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	42.77	889,573.23
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	38.98	1,448,107.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	199.63	1,776,108.11
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	15.04	1,140,287.68
JPMORGAN CHASE & CO	157,992	157.07	24,815,803.44
KEYCORP	51,128	20.60	1,053,236.80
M & T BANK CORP	7,237	133.67	967,369.79
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,991	188.35	4,142,004.85
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,041	19.45	914,947.45
SVB FINANCIAL GROUP	2,761	584.44	1,613,638.84
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	70,316	54.63	3,841,363.08
US BANCORP	74,623	55.91	4,172,171.93
WELLS FARGO & COMPANY	217,356	46.05	10,009,243.80
ALLY FINANCIAL INC	20,139	51.74	1,041,991.86
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,523	159.48	5,665,208.04

AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,738	266.58	1,529,636.04
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	61.02	472,599.90
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	51.14	2,158,465.98
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	69,189	277.20	19,179,190.80
BLACKROCK INC	7,916	901.95	7,139,836.20
BLACKSTONE INC	35,000	130.60	4,571,000.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	154.39	3,651,941.06
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	49.12	495,817.28
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	124.23	703,266.03
CME GROUP INC.	18,712	188.85	3,533,761.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	120.34	1,976,584.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	29.37	670,223.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	383.75	744,091.25
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	31.32	447,813.36
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	98.85	312,267.15
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,827	403.69	7,196,581.63
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,608	119.26	3,411,790.08
INVESCO LIMITED	18,328	24.95	457,283.60
KKR & CO INC	28,569	63.39	1,810,988.91
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	426.24	814,970.88
MOODY'S CORP	8,519	380.15	3,238,497.85
MORGAN STANLEY	72,831	101.91	7,422,207.21
MSCI INC-A	4,383	653.27	2,863,282.41
NASDAQ INC	6,509	195.55	1,272,834.95
NORTHERN TRUST CORP	11,023	110.13	1,213,962.99
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	134.19	862,304.94
S&P GLOBAL INC	12,767	451.59	5,765,449.53
SCHWAB (CHARLES) CORP	75,184	69.73	5,242,580.32
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	59.21	324,530.01
STATE STREET CORP	18,694	86.57	1,618,339.58
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	47.68	1,531,100.16
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	212.88	2,621,404.32
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	84.72	442,238.40
VOYA FINANCIAL INC	7,308	62.94	459,965.52
AFLAC INC	34,185	54.29	1,855,903.65

ALLEGHANY CORPORATION	689	619.57	426,883.73
ALLSTATE CORP	16,419	132.13	2,169,442.47
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	129.32	457,663.48
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	54.43	2,435,470.35
AON PLC	12,005	291.69	3,501,738.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	39.26	803,887.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,149	145.00	1,471,605.00
ASSURANT INC	3,114	165.81	516,332.34
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,195	68.45	560,947.75
BROWN & BROWN INC	10,864	56.10	609,470.40
CHUBB LTD	23,255	181.28	4,215,666.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	117.44	922,843.52
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	176.25	227,010.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	253.91	524,324.15
FNF GROUP	13,937	46.37	646,258.69
GLOBE LIFE INC	4,333	92.12	399,155.96
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	70.12	1,285,369.72
JACKSON FINANCIAL INC-A	3,265	26.00	84,890.00
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	65.57	568,950.89
LOEWS CORPORATION	12,727	53.18	676,821.86
MARKEL CORP	702	1,227.96	862,027.92
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	157.61	4,196,366.25
METLIFE INC	39,703	60.78	2,413,148.34
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	65.14	920,037.36
PROGRESSIVE CORP	30,543	93.20	2,846,607.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	103.72	2,149,908.16
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	144.44	440,830.88
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	156.35	2,052,250.10
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	71.47	530,879.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	234.27	1,598,424.21
CBRE GROUP INC-A	18,244	96.46	1,759,816.24
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.63	242,149.00
ACCENTURE PLC-CL A	33,363	340.72	11,367,441.36
ADOBE INC	25,076	645.01	16,174,270.76
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	111.92	931,286.32

ANSYS INC	4,470	369.07	1,649,742.90
AUTODESK INC	11,506	279.35	3,214,201.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,387	199.74	4,471,579.38
AVALARA INC	4,319	185.54	801,347.26
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	69.15	609,073.20
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	74.00	564,102.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	169.67	999,186.63
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	164.93	2,350,252.50
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	106.96	746,473.84
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,400	116.34	744,576.00
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	109.58	711,174.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,673	126.76	1,606,429.48
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	26,533	75.68	2,008,017.44
COUPA SOFTWARE INC	3,490	243.40	849,466.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,874	257.30	2,540,580.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	160.00	328,800.00
DATADOG INC - CLASS A	10,423	138.12	1,439,624.76
DOCUSIGN INC	10,078	267.98	2,700,702.44
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	30.68	508,797.12
DYNATRACE INC	9,587	70.61	676,938.07
EPAM SYSTEMS INC	3,095	622.71	1,927,287.45
FAIR ISAAC CORP	1,494	439.27	656,269.38
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,016	123.42	3,951,414.72
FISERV INC	31,564	107.39	3,389,657.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	255.75	1,117,883.25
FORTINET INC	7,360	300.58	2,212,268.80
GARTNER INC	4,568	310.60	1,418,820.80
GLOBAL PAYMENTS INC	15,331	162.11	2,485,308.41
GODADDY INC - CLASS A	8,905	74.21	660,840.05
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	119.98	567,625.38
HUBSPOT INC	2,275	671.83	1,528,413.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	47,143	136.22	6,421,819.46
INTUIT INC	14,242	568.27	8,093,301.34
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	167.11	654,235.65
MASTERCARD INC-CL A	46,455	345.80	16,064,139.00

MICROSOFT CORP	373,728	299.79	112,039,917.12
MONGODB INC	2,659	505.21	1,343,353.39
NORTONLIFELOCK INC	31,347	26.18	820,664.46
OKTA INC	6,306	253.29	1,597,246.74
ORACLE CORPORATION	98,813	86.39	8,536,455.07
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	82,071	26.26	2,155,184.46
PALO ALTO NETWORKS INC	4,942	484.83	2,396,029.86
PAYCHEX INC	17,729	109.66	1,944,162.14
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	468.02	1,180,346.44
PAYPAL HOLDINGS INC	58,324	282.24	16,461,365.76
PTC INC	5,462	122.44	668,767.28
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	217.44	868,020.48
SALESFORCE.COM, INC.	50,706	254.37	12,898,085.22
SERVICENOW INC	10,305	645.42	6,651,053.10
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,046	319.25	3,207,185.50
SPLUNK INC	8,252	150.49	1,241,843.48
SQUARE INC-A	20,789	247.05	5,135,922.45
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	71.34	823,691.64
SYNOPSYS INC	7,869	332.59	2,617,150.71
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	21,400	70.83	1,515,762.00
TWILIO INC-A	8,214	337.00	2,768,118.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	467.97	943,427.52
UNITY SOFTWARE INC	2,853	131.73	375,825.69
VERISIGN INC	5,227	221.95	1,160,132.65
VISA INC	88,428	223.03	19,722,096.84
VMWARE INC	4,194	139.96	586,992.24
WESTERN UNION COMPANY	21,840	21.07	460,168.80
WIX.COM LTD	2,840	214.78	609,975.20
WORKDAY INC-CLASS A	9,864	269.78	2,661,109.92
ZENDESK INC	6,067	115.50	700,738.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,098	281.44	3,123,421.12
ZSCALER INC	4,551	275.80	1,255,165.80
AMPHENOL CORPORATION -CL A	31,396	75.73	2,377,619.08
APPLE INC	871,554	148.12	129,094,578.48
ARISTA NETWORKS INC	2,699	357.76	965,594.24

ARROW ELECTRONICS INC	4,130	112.23	463,509.90
CDW CORP/DE	7,404	193.48	1,432,525.92
CISCO SYSTEMS INC	221,654	57.87	12,827,116.98
COGNEX CORP	8,698	88.05	765,858.90
CORNING INC	39,709	38.26	1,519,266.34
DELL TECHNOLOGIES INC-C	14,550	97.44	1,417,752.00
F5 NETWORKS INC	2,909	202.05	587,763.45
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	13.75	878,363.75
HP INC	65,388	27.56	1,802,093.28
IPG PHOTONICS CORP	1,776	173.18	307,567.68
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	27.99	488,705.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	178.17	1,700,098.14
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	240.81	2,218,341.72
NETAPP INC	10,919	92.19	1,006,622.61
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	11,800	82.73	976,214.00
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	144.74	2,522,094.50
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,371	431.39	1,022,825.69
TRIMBLE INC	12,759	91.31	1,165,024.29
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	57.54	854,871.78
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	576.79	1,578,674.23
AT&T INC	374,701	27.33	10,240,578.33
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	28.51	240,396.32
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	28.60	602,859.40
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	12.50	621,975.00
T-MOBILE US INC	31,897	128.92	4,112,161.24
VERIZON COMMUNICATIONS INC	216,062	54.41	11,755,933.42
AES CORPORATION	33,656	23.82	801,685.92
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	59.28	717,347.28
AMEREN CORPORATION	12,454	85.93	1,070,172.22
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	87.83	2,259,602.41
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	184.88	1,692,391.52
ATMOS ENERGY CORP	6,965	91.28	635,765.20
CENTERPOINT ENERGY INC	32,003	25.66	821,196.98
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	63.18	887,047.20
CONSOLIDATED EDISON INC	18,399	74.19	1,365,021.81

DOMINION ENERGY INC	41,951	76.15	3,194,568.65
DTE ENERGY COMPANY	10,536	117.42	1,237,137.12
DUKE ENERGY CORP	39,456	101.61	4,009,124.16
EDISON INTERNATIONAL	18,856	58.48	1,102,698.88
ENTERGY CORP	10,866	114.39	1,242,961.74
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	47.62	662,346.58
EVERGY INC	11,273	65.76	741,312.48
EVERSOURCE ENERGY	17,557	86.97	1,526,932.29
EXELON CORP	50,837	50.38	2,561,168.06
FIRSTENERGY CORP	26,948	37.45	1,009,202.60
NEXTERA ENERGY INC	103,333	84.64	8,746,105.12
NISOURCE INC	18,919	24.31	459,920.89
NRG ENERGY INC	13,547	43.89	594,577.83
P G & E CORPORATION	76,538	9.80	750,072.40
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	74.00	443,704.00
PPL CORPORATION	39,561	29.38	1,162,302.18
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	62.57	1,703,843.67
SEMPRA ENERGY	16,353	133.83	2,188,521.99
SOUTHERN CO	55,686	65.97	3,673,605.42
UGI CORPORATION	10,588	43.84	464,177.92
VISTRA CORP	25,777	18.00	463,986.00
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	93.42	1,535,637.96
XCEL ENERGY INC	29,237	66.11	1,932,858.07
ADVANCED MICRO DEVICES	63,414	105.73	6,704,762.22
ANALOG DEVICES INC	28,000	173.47	4,857,160.00
APPLIED MATERIALS INC	47,402	140.14	6,642,916.28
BROADCOM INC	21,463	501.87	10,771,635.81
ENPHASE ENERGY INC	6,292	157.95	993,821.40
INTEL CORP	212,391	54.52	11,579,557.32
KLA CORPORATION	8,157	356.39	2,907,073.23
LAM RESEARCH CORP	7,291	603.50	4,400,118.50
MARVELL TECHNOLOGY INC	41,180	62.30	2,565,514.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,352	160.65	2,305,648.80
MICRON TECHNOLOGY INC	58,425	73.49	4,293,653.25
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	495.46	1,111,316.78

	NVIDIA CORP	130,062	222.42	28,928,390.04	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	211.48	3,057,366.36	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	47.85	1,000,639.20	
	QORVO INC	6,042	182.13	1,100,429.46	
	QUALCOMM INC	59,483	141.14	8,395,430.62	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	178.13	1,559,884.41	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,634	272.51	717,791.34	
	TERADYNE INC	8,542	122.32	1,044,857.44	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,426	195.11	9,448,396.86	
	XILINX INC	12,876	155.58	2,003,248.08	
	米ドル 小計	16,349,592		2,058,901,527.37 (225,758,552,476)	
カナダドル	CAMECO CORP	18,890	30.84	582,567.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,374	43.16	2,778,381.84	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	10.83	812,899.80	
	ENBRIDGE INC	107,703	50.50	5,439,001.50	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	35.34	459,384.66	
	INTER PIPELINE LTD	5,601	19.99	111,963.99	
	KEYERA CORP	11,374	32.41	368,631.34	
	PARKLAND CORP	7,666	36.43	279,272.38	
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	39.58	1,084,927.38	
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	23.58	1,854,378.36	
	TC ENERGY CORP	50,579	62.22	3,147,025.38	
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	13,447	70.73	951,106.31	
	B2GOLD CORP	42,963	4.85	208,370.55	
	BARRICK GOLD CORP	93,098	24.73	2,302,313.54	
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	72.30	474,504.90	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	23.93	757,910.96	
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	179.35	1,823,092.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	9.26	302,783.48	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	7.40	469,907.40	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	13,385	54.42	728,411.70	
	LUNDIN MINING CORP	28,209	9.42	265,728.78	
	NUTRIEN LTD	29,898	77.42	2,314,703.16	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	32.97	387,826.11	

TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	32.67	810,673.38
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	96.86	429,864.68
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	56.60	1,377,361.00
YAMANA GOLD INC	53,588	5.38	288,303.44
BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	19.69	334,887.52
CAE INC	12,891	38.47	495,916.77
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	102.92	395,521.56
WSP GLOBAL INC	6,141	161.05	989,008.05
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	46.01	456,097.13
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	80.26	454,833.42
THOMSON REUTERS CORP	8,569	150.35	1,288,349.15
AIR CANADA	12,083	22.87	276,338.21
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,544	145.73	5,325,557.12
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34,738	86.48	3,004,142.24
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	100.14	1,438,410.96
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	48.85	442,874.10
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	82.01	1,189,965.10
QUEBECOR INC -CL B	9,953	31.13	309,836.89
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	36.37	990,427.84
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,001	196.02	588,256.02
DOLLARAMA INC	17,025	56.12	955,443.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	44,270	50.35	2,228,994.50
EMPIRE CO LTD A	9,148	38.34	350,734.32
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	87.63	760,891.29
METRO INC	13,109	61.90	811,447.10
WESTON (GEORGE) LTD	3,578	134.83	482,421.74
SAPUTO INC	13,425	34.46	462,625.50
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	36.40	598,670.80
CANOPY GROWTH CORP	11,251	18.57	208,931.07
BANK OF MONTREAL	33,057	127.48	4,214,106.36
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	77.69	4,918,320.83
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	145.68	3,425,373.84
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	98.35	1,671,261.55
ROYAL BANK OF CANADA	75,056	128.43	9,639,442.08
TORONTO-DOMINION BANK	95,838	81.76	7,835,714.88

	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,755	70.01	4,603,507.55	
	IGM FINANCIAL INC	4,949	47.59	235,522.91	
	ONEX CORPORATION	4,217	92.78	391,253.26	
	TMX GROUP LTD	3,142	139.87	439,471.54	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	544.26	758,154.18	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	39.24	557,208.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	71.51	346,895.01	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	8,634	173.67	1,499,466.78	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	24.54	2,449,337.40	
	POWER CORP OF CANADA	31,768	43.86	1,393,344.48	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	30,550	65.40	1,997,970.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,820	231.58	421,475.60	
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	12.74	331,150.82	
	CGI INC-CL A	11,493	113.63	1,305,949.59	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	2,184.42	2,241,214.92	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC-SUB VOTE	6,363	151.45	963,676.35	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	3,084	163.69	504,819.96	
	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	66.83	913,231.95	
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,895	1,838.94	10,840,551.30	
	BCE INC	5,509	65.15	358,911.35	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,236	59.91	1,092,518.76	
	TELUS CORPORATION	15,222	28.97	440,981.34	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	19.52	612,127.68	
	ALTAGAS LTD	17,347	25.94	449,981.18	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	41.11	124,563.30	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	53.79	340,813.44	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	35.12	257,921.28	
	EMERA INC	14,279	59.34	847,315.86	
	FORTIS INC	24,171	58.36	1,410,619.56	
	HYDRO ONE LTD	18,821	31.50	592,861.50	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	41.11	446,865.70	
	カナダドル 小計	2,126,191		126,525,779.86 (10,926,766,348)	
ユーロ	ENI SPA	136,972	10.90	1,493,542.68	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	29,687	8.22	244,027.14	

NESTE OYJ	21,427	53.44	1,145,058.88
OMV AG	8,389	48.96	410,725.44
REPSOL SA	79,358	9.84	780,882.72
TENARIS S.A.	25,963	8.52	221,412.46
TOTALENERGIES SE	129,116	37.84	4,886,395.02
VOPAK	3,130	35.06	109,737.80
AIR LIQUIDE SA	25,183	149.06	3,753,777.98
AKZO NOBEL	9,886	101.00	998,486.00
ARCELORMITTAL	36,689	27.52	1,009,681.28
ARKEMA	3,250	115.55	375,537.50
BASF SE	47,459	65.57	3,111,886.63
COVESTRO AG	9,346	58.90	550,479.40
CRH PLC	40,255	43.75	1,761,156.25
EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	27.92	305,779.84
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	41.88	141,135.60
HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	69.40	602,183.80
KONINKLIJKE DSM NV	9,422	184.95	1,742,598.90
LANXESS	4,409	64.32	283,586.88
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	48.37	624,988.77
SOLVAY SA	3,758	109.45	411,313.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	16.04	485,104.53
SYMRISE AG	6,524	119.95	782,553.80
UMICORE	10,288	52.34	538,473.92
UPM-KYMMENE OYJ	28,055	33.24	932,548.20
VOESTALPINE AG	6,056	35.84	217,047.04
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,931	23.35	301,938.85
AIRBUS SE	30,165	112.76	3,401,405.40
ALSTOM RGPT	17,665	31.69	559,803.85
BOUYGUES SA	11,049	36.04	398,205.96
BRENTAG SE	7,392	86.26	637,633.92
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	13.81	756,442.75
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	26,413	61.26	1,618,060.38
DASSAULT AVIATION SA	172	918.50	157,982.00
EIFFAGE SA	4,989	87.88	438,433.32
FERROVIAL SA	24,413	24.92	608,371.96

GEA GROUP AG	8,178	41.01	335,379.78
KINGSPAN GROUP PLC	8,084	97.98	792,070.32
KION GROUP AG	3,179	86.90	276,255.10
KNORR-BREMSE AG	3,881	103.40	401,295.40
KONE OYJ-B	17,618	65.32	1,150,807.76
LEGRAND SA	13,323	97.66	1,301,124.18
MTU AERO ENGINES AG	2,957	187.90	555,620.30
PRYSMIAN SPA	12,526	32.81	410,978.06
RATIONAL AG	350	932.20	326,270.00
SAFRAN SA	18,212	103.66	1,887,855.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,924	154.66	4,318,725.84
SIEMENS AG-REG	39,550	147.84	5,847,072.00
SIEMENS ENERGY AG	19,855	23.06	457,856.30
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	23.35	268,104.70
THALES SA	5,403	83.16	449,313.48
VINCI S.A.	27,327	88.82	2,427,184.14
WARTSILA OYJ-B SHARES	26,753	11.36	304,047.84
BUREAU VERITAS SA	17,817	28.44	506,715.48
RANDSTAD NV	6,241	59.96	374,210.36
TELEPERFORMANCE	2,970	376.10	1,117,017.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	96.92	1,412,899.76
AENA SME SA	4,377	132.30	579,077.10
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	97.64	131,423.44
ATLANTIA SPA	26,501	15.69	415,933.19
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	8.00	132,592.00
DEUTSCHE POST AG-REG	51,345	59.42	3,050,919.90
GETLINK	22,311	13.86	309,230.46
INPOST SA	10,902	15.42	168,152.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	82.15	1,468,266.95
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,564	67.45	172,941.80
CONTINENTAL AG	5,578	112.18	625,740.04
DAIMLER AG	44,402	72.52	3,220,033.04
FAURECIA	6,090	39.75	242,077.50
FERRARI NV	6,452	187.80	1,211,685.60
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	136.65	1,195,140.90

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,765	86.90	674,778.50
RENAULT SA	8,830	29.83	263,398.90
STELLANTIS NV	105,516	16.95	1,788,707.23
VALEO SA	14,444	22.65	327,156.60
VOLKSWAGEN AG	1,960	281.20	551,152.00
VOLKSWAGEN AG PFD	9,776	197.08	1,926,654.08
ADIDAS AG	10,146	293.55	2,978,358.30
ESSILORLUXOTTICA	14,521	170.18	2,471,183.78
HERMES INTERNATIONAL	1,676	1,269.50	2,127,682.00
KERING	3,906	658.30	2,571,319.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,578	646.80	9,429,050.40
MONCLER SPA	10,437	54.60	569,860.20
PUMA SE	5,052	103.85	524,650.20
SEB SA	1,127	131.30	147,975.10
ACCOR SA	10,451	28.72	300,152.72
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,869	170.75	1,514,381.75
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	44.23	255,870.55
SODEXO	3,900	71.28	277,992.00
BOLLORE	39,433	5.13	202,291.29
PUBLICIS GROUPE	10,736	56.26	604,007.36
SCOUT24 AG	4,671	68.32	319,122.72
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	4,745	55.92	265,340.40
VIVENDI SE	38,496	32.53	1,252,274.88
DELIVERY HERO SE	8,061	126.75	1,021,731.75
HELLOFRESH AG	8,096	89.82	727,182.72
INDITEX	55,025	30.18	1,660,654.50
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	77.53	721,571.71
PROSUS NV	48,717	71.13	3,465,240.21
ZALANDO SE	12,367	95.00	1,174,865.00
CARREFOUR SA	35,990	15.04	541,289.60
COLRUYT NV	2,164	47.72	103,266.08
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,458	17.80	204,009.69
KESKO OYJ-B SHS	13,402	32.84	440,121.68
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	55,657	28.15	1,566,744.55
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,567	48.64	1,924,538.88

DANONE	34,300	60.10	2,061,430.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	11.92	334,150.42
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	75.30	464,450.40
HEINEKEN NV	13,143	89.78	1,179,978.54
JDE PEET'S BV	2,166	27.83	60,279.78
KERRY GROUP PLC-A	8,193	122.15	1,000,774.95
PERNOD-RICARD SA	11,108	189.60	2,106,076.80
REMY COINTREAU	1,273	168.30	214,245.90
BEIERSDORF AG	5,138	105.30	541,031.40
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	72.50	433,115.00
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	78.74	712,045.82
L'OREAL	12,964	398.60	5,167,450.40
AMPLIFON SPA	7,567	42.68	322,959.56
BIOMERIEUX	1,570	112.70	176,939.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,924	197.90	380,759.60
DIASORIN SPA	1,313	201.80	264,963.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	61.88	687,981.84
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	42.00	897,246.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,760	39.79	1,900,609.20
ORPEA	2,695	104.70	282,166.50
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	581.80	760,994.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	57.30	812,628.60
ARGENX SE	2,644	276.40	730,801.60
BAYER AG	51,733	45.89	2,374,286.03
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	123.40	865,034.00
GRIFOLS S.A.	15,169	21.17	321,127.73
IPSEN	1,498	80.42	120,469.16
MERCK KGAA	6,832	199.70	1,364,350.40
ORION OYJ	4,159	34.30	142,653.70
QIAGEN N.V.	12,543	45.62	572,211.66
RECORDATI SPA	4,578	52.48	240,253.44
SANOFI	59,771	81.82	4,890,463.22
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	540.00	839,700.00
UCB SA	6,623	90.88	601,898.24
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	11.77	222,792.64

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	5.58	1,969,120.62
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	893,341	3.09	2,761,317.03
BNP PARIBAS	58,640	53.39	3,130,789.60
CAIXABANK	218,103	2.59	565,322.97
COMMERZBANK AG	46,644	5.45	254,209.80
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	11.82	687,214.80
ERSTE GROUP BANK AG	14,968	35.25	527,622.00
FINECOBANK SPA	32,034	15.37	492,362.58
ING GROEP NV-CVA	205,237	11.73	2,409,071.90
INTESA SANPAOLO	852,114	2.38	2,033,570.06
KBC GROUPE SA	13,092	71.80	940,005.60
MEDIOBANCA SPA	31,303	9.78	306,331.15
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,066	21.28	150,364.48
SOCIETE GENERALE	41,025	26.26	1,077,316.50
UNICREDIT SPA	112,845	10.76	1,214,212.20
AMUNDI SA	3,955	75.85	299,986.75
DEUTSCHE BANK AG -REG	113,478	10.96	1,244,172.79
DEUTSCHE BOERSE AG	9,700	142.10	1,378,370.00
EURAZEO	1,792	83.85	150,259.20
EXOR NV	6,204	70.10	434,900.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	95.40	564,195.60
SOFINA	804	353.80	284,455.20
WENDEL	1,082	120.30	130,164.60
AEGON NV	91,609	4.17	382,559.18
AGEAS	8,765	41.43	363,133.95
ALLIANZ SE-REG	21,783	192.84	4,200,633.72
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	17.60	1,008,532.80
AXA SA	100,473	23.25	2,336,499.61
CNP ASSURANCES	8,978	13.90	124,839.09
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	161.35	493,408.30
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,364	244.20	1,798,288.80
NN GROUP NV	14,069	44.10	620,442.90
POSTE ITALIANE SPA	26,562	11.56	307,056.72
SAMPO OYJ-A SHS	26,020	43.87	1,141,497.40

SCOR SE	10,907	26.48	288,817.36
AROUNDTOWN SA	52,560	6.27	329,761.44
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,590	53.00	932,270.00
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	127.15	467,912.00
VONOVIA SE	29,304	53.32	1,562,489.28
ADYEN NV	1,013	2,678.50	2,713,320.50
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	51.04	1,254,052.80
ATOS SE	4,592	46.61	214,033.12
BECHTLE AG	4,305	63.98	275,433.90
CAPGEMINI SA	7,966	191.80	1,527,878.80
DASSAULT SYSTEMES SA	35,115	48.88	1,716,421.20
EDENRED	12,139	47.13	572,111.07
NEMETSCHKE SE	3,011	87.34	262,980.74
NEXI SPA	20,612	17.86	368,130.32
SAP SE	55,037	122.90	6,764,047.30
TEAMVIEWER AG	9,059	29.03	262,982.77
WORLDLINE SA	12,774	70.71	903,249.54
NOKIA OYJ	280,161	4.91	1,377,131.39
CELLNEX TELECOM SA	27,081	57.02	1,544,158.62
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	171,299	17.41	2,983,343.38
ELISA OYJ	8,681	54.46	472,767.26
ILIAD SA	1,016	182.00	184,912.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.79	154,721.16
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.79	485,914.79
ORANGE S.A.	106,132	9.39	997,110.14
PROXIMUS SA	4,617	16.73	77,265.49
TELECOM ITALIA SPA	390,536	0.35	139,655.67
TELECOM ITALIA-RNC	378,308	0.38	144,097.51
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.40	112,876.26
TELEFONICA S.A.	274,278	4.14	1,138,116.56
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	35.43	186,680.67
E.ON SE	116,681	11.22	1,309,394.18
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	22.80	337,234.80
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.82	703,723.93
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	20,779	10.96	227,737.84

	ELIA GROUP SA/NV	2,063	107.00	220,741.00	
	ENAGAS	14,471	18.82	272,344.22	
	ENDESA S.A.	14,104	19.41	273,758.64	
	ENEL SPA	431,652	7.43	3,209,332.62	
	ENGIE	94,886	11.98	1,137,303.59	
	FORTUM OYJ	24,312	27.05	657,639.60	
	IBERDROLA SA	302,073	10.08	3,044,895.84	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	21.84	337,187.76	
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	17.12	404,579.84	
	RWE AG	34,673	33.47	1,160,505.31	
	SNAM SPA	106,707	4.98	531,400.86	
	SUEZ	18,986	19.65	373,074.90	
	TERNA SPA	70,562	6.71	473,612.14	
	UNIPER SE	4,697	35.99	169,045.03	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	29.06	829,982.66	
	VERBUND AG	3,190	95.55	304,804.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,455	374.60	919,643.00	
	ASML HOLDING NV	21,953	753.40	16,539,390.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	66,553	37.91	2,523,356.99	
	STMICROELECTRONICS NV	37,804	39.50	1,493,258.00	
	ユーロ 小計	9,961,070		257,237,992.34 (33,304,602,868)	
英ポンド	BP PLC	1,079,142	3.00	3,237,426.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,867	14.50	3,086,571.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,653	14.51	2,737,732.33	
	ANGLO AMERICAN PLC	66,935	29.96	2,005,707.27	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	14.27	277,491.72	
	BHP GROUP PLC	110,160	20.26	2,231,841.60	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	92.08	721,723.04	
	EVRAZ PLC	28,275	5.85	165,634.95	
	GLENCORE PLC	539,565	3.35	1,812,398.83	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	27.63	278,344.62	
	MONDI PLC	25,128	19.51	490,372.92	
	RIO TINTO PLC	57,926	51.79	2,999,987.54	
	ASHTREAD GROUP PLC	23,686	58.60	1,387,999.60	

BAE SYSTEMS PLC	165,753	5.51	914,293.54
BUNZL PLC	17,064	26.03	444,175.92
DCC PLC	5,954	62.00	369,148.00
FERGUSON PLC	12,017	105.75	1,270,797.75
MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.76	391,657.78
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	389,579	1.09	425,264.43
SMITHS GROUP PLC	24,369	14.14	344,699.50
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	164.05	604,524.25
EXPERIAN PLC	48,895	33.42	1,634,070.90
INTERTEK GROUP PLC	8,184	54.38	445,045.92
RELX PLC	100,974	21.94	2,215,369.56
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.95	539,327.71
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	6.86	320,320.84
BURBERRY GROUP PLC	19,012	18.42	350,201.04
PERSIMMON PLC	16,916	27.71	468,742.36
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.68	380,115.78
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,637	46.40	307,956.80
COMPASS GROUP PLC	93,018	14.36	1,335,738.48
ENTAIN PLC	28,865	19.43	560,991.27
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,587	46.17	442,631.79
WHITBREAD PLC	11,282	32.85	370,613.70
AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	6.19	272,075.26
INFORMA PLC	78,152	5.22	407,953.44
PEARSON PLC	39,623	7.36	291,942.26
WPP PLC	63,987	9.65	617,730.49
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	11.51	332,178.60
KINGFISHER PLC	109,678	3.60	395,498.86
NEXT PLC	6,860	79.84	547,702.40
OCADO GROUP PLC	27,379	18.59	508,975.61
SAINSBURY (J) PLC	67,872	2.89	196,353.69
TESCO PLC	399,930	2.55	1,023,020.94
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	2.91	426,128.79
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	19.13	320,913.08
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	114,393	26.59	3,041,709.87
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.55	213,683.20

DIAGEO PLC	120,446	35.09	4,226,450.14
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	15.25	762,795.76
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	58.21	2,176,180.85
UNILEVER PLC	138,458	40.07	5,548,704.35
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	13.35	592,139.25
ASTRAZENECA PLC	80,659	81.30	6,557,576.70
GLAXOSMITHKLINE PLC	266,528	14.14	3,769,238.97
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	24.85	188,387.85
BARCLAYS PLC	904,741	1.80	1,637,038.36
HSBC HOLDINGS PLC	1,044,428	3.72	3,894,672.01
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,817,021	0.43	1,662,503.49
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.08	658,193.24
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.39	643,695.91
3I GROUP PLC	49,338	12.71	627,085.98
ABRDN PLC	123,263	2.58	318,634.85
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	14.33	280,564.62
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,716	81.06	1,436,058.96
M&G PLC	133,064	2.03	270,785.24
SCHRODERS PLC	6,213	38.01	236,156.13
ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	16.17	422,958.69
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	35.26	406,724.10
AVIVA PLC	198,601	4.04	803,341.04
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.05	193,158.02
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.77	871,597.22
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.44	237,394.14
PRUDENTIAL PLC	130,604	14.51	1,895,717.06
AVEVA GROUP PLC	6,037	39.43	238,038.91
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.41	414,863.67
HALMA PLC	19,839	30.61	607,271.79
BT GROUP PLC	469,907	1.55	730,940.33
VODAFONE GROUP PLC	1,422,998	1.16	1,651,531.47
NATIONAL GRID PLC	191,851	9.66	1,853,856.21
SEVERN TRENT PLC	12,418	28.40	352,671.20
SSE PLC	55,879	16.59	927,032.61

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	10.61	352,326.27
	英ポンド 小計	15,444,781		91,611,110.52 (13,869,006,021)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.91	191,009.91
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	959.00	341,404.00
	GIVAUDAN-REG	484	4,546.00	2,200,264.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	48.29	1,315,371.31
	SIKA AG	7,399	327.60	2,423,912.40
	ABB LTD	90,836	33.93	3,082,065.48
	GEBERIT AG-REG	1,986	764.80	1,518,892.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	274.60	258,398.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	288.00	614,016.00
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	47.47	432,831.46
	SGS SA	308	2,900.00	893,200.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,618	346.30	906,613.40
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	26,754	103.40	2,766,363.60
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,716	259.80	445,816.80
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	50.90	128,064.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	183	2,184.00	399,672.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	10,570.00	623,630.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	109,400.00	547,000.00
	NESTLE SA-REGISTERED	150,863	114.56	17,282,865.28
	ALCON INC	26,585	79.36	2,109,785.60
	SONOVA HOLDING AG	2,660	371.70	988,722.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,843.00	978,633.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	776.60	3,093,974.40
	NOVARTIS AG-REG SHS	116,665	78.80	9,193,202.00
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	1,436	393.00	564,348.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,777	346.20	12,732,197.40
	VIFOR PHARMA AG	2,638	126.10	332,651.80
BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	72.50	113,825.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	126,713	9.66	1,224,047.58	
JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	63.22	793,411.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,591.50	1,914,574.50	
UBS GROUP AG	191,189	15.31	2,928,059.53	

	BALOISE HOLDING AG	2,475	143.60	355,410.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,834	476.90	874,634.60	
	SWISS RE AG	15,168	82.46	1,250,753.28	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,733	399.00	3,085,467.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	94.30	368,335.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,743	139.25	521,212.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,150	91.50	745,725.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	532.60	745,107.40	
	スイスフラン 小計	904,523		81,285,469.08 (9,689,227,914)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	282.20	2,421,558.20	
	BOLIDEN AB	13,086	297.00	3,886,542.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	34,370	140.00	4,811,800.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	347.30	6,493,468.10	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	276.20	14,395,267.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	603.00	20,763,702.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	511.00	10,111,157.00	
	EPIROC AB-A	34,230	194.35	6,652,600.50	
	EPIROC AB-B	19,836	165.00	3,272,940.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	293.70	2,415,095.10	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	73,764	127.75	9,423,351.00	
	SANDVIK AB	61,070	217.20	13,264,404.00	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	241.40	4,147,976.20	
	SKF AB-B SHARES	20,607	210.50	4,337,773.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	193.80	2,574,245.40	
	VOLVO AB-B SHS	71,792	191.40	13,740,988.80	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	138.05	2,225,780.15	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,555	206.50	2,386,107.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	114.75	2,133,546.75	
	EVOLUTION AB	9,021	1,400.80	12,636,616.80	
EMBRACER GROUP AB	15,006	190.20	2,854,141.20		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	174.92	7,022,688.16		
ICA GRUPPEN AB	5,614	409.00	2,296,126.00		
SWEDISH MATCH AB	84,640	78.24	6,622,233.60		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,942	270.70	8,105,299.40		

	NORDEA BANK ABP	167,942	105.68	17,748,110.56	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	120.65	10,655,446.05	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	94.12	7,310,112.16	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	167.58	7,695,441.18	
	EQT AB	15,443	397.20	6,133,959.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,396	297.40	1,009,970.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	282.70	3,008,493.40	
	INVESTOR AB-B SHS	94,456	202.40	19,117,894.40	
	KINNEVIK AB-B SHS	12,465	336.85	4,198,835.25	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	520.20	1,752,033.60	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	576.80	3,070,306.40	
	SINCH AB	27,690	188.35	5,215,411.50	
	ERICSSON LM-B SHS	146,984	101.06	14,854,203.04	
	HEXAGON AB-B SHS	103,110	150.70	15,538,677.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	129.75	3,313,425.75	
	TELIA CO AB	143,404	37.04	5,312,401.18	
	スウェーデンクローナ 小計	1,703,370		294,930,130.63 (3,754,460,562)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	51,871	201.55	10,454,600.05	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	65.28	4,200,376.32	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	411.10	3,701,955.50	
	ADEVINTA ASA-B	15,540	157.95	2,454,543.00	
	SCHIBSTED ASA	3,338	436.20	1,456,035.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	388.40	2,128,432.00	
	MOWI ASA	23,318	232.60	5,423,766.80	
	ORKLA ASA	46,955	77.00	3,615,535.00	
	DNB BANK ASA	45,957	187.80	8,630,724.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	197.70	2,256,152.40	
	TELENOR ASA	34,937	146.50	5,118,270.50	
	ノルウェークローネ 小計	312,157		49,440,391.77 (626,409,763)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	555.60	3,060,800.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	471.20	5,424,454.40	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S	513	3,389.00	1,738,557.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,440	259.80	13,623,912.00	

	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	18,360.00	3,084,480.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	311	19,455.00	6,050,505.00	
	DSV PANALPINA A S	10,310	1,640.50	16,913,555.00	
	PANDORA A/S	4,763	855.00	4,072,365.00	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,019.50	5,693,907.50	
	AMBU A/S-B	8,356	217.90	1,820,772.40	
	COLOPLAST-B	6,399	1,102.00	7,051,698.00	
	DEMANT A/S	4,455	359.60	1,602,018.00	
	GN STORE NORD A/S	6,484	478.50	3,102,594.00	
	GENMAB A/S	3,317	2,780.00	9,221,260.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	88,424	631.40	55,830,913.60	
	DANSKE BANK A/S	39,103	105.10	4,109,725.30	
	TRYG A/S	16,989	153.05	2,600,166.45	
	ORSTED A/S	9,555	944.00	9,019,920.00	
	デンマーククローネ 小計	274,193		154,021,604.05 (2,681,516,126)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	10,927	28.04	306,393.08	
	OIL SEARCH LTD	105,618	3.94	416,134.92	
	SANTOS LTD	100,376	6.49	651,440.24	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	39.76	210,489.44	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	20.81	1,047,866.74	
	BHP GROUP LTD	153,209	41.73	6,393,411.57	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	24.07	612,870.34	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	3.93	331,770.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	88,448	18.08	1,599,139.84	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,266	54.12	1,205,035.92	
	NEWCREST MINING LIMITED	42,131	24.47	1,030,945.57	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	9.58	630,785.52	
	ORICA LIMITED	17,981	12.58	226,200.98	
	RIO TINTO LIMITED	19,336	106.66	2,062,377.76	
	SOUTH32 LTD	276,348	3.41	942,346.68	
	REECE LTD	19,309	19.86	383,476.74	
	BRAMBLES LIMITED	74,638	11.24	838,931.12	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.86	364,538.40		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	5.43	248,862.33		

ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	47.42	1,458,117.58
CROWN RESORTS LTD	21,863	9.64	210,759.32
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,794	164.98	625,934.12
TABCORP HOLDINGS LIMITED	112,817	4.85	547,162.45
REA GROUP LTD	2,833	154.98	439,058.34
SEEK LIMITED	17,266	31.28	540,080.48
WESFARMERS LIMITED	57,250	56.75	3,248,937.50
COLES GROUP LIMITED	73,552	17.28	1,270,978.56
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	65,607	6.58	431,694.06
WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	39.31	2,579,011.17
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	12.28	447,777.92
COCHLEAR LIMITED	3,368	230.00	774,640.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	68.03	642,611.38
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	41.80	1,013,984.40
CSL LIMITED	23,602	300.68	7,096,649.36
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	148,002	27.71	4,101,135.42
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	93,409	101.58	9,488,486.22
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	173,185	28.23	4,889,012.55
WESTPAC BANKING CORPORATION	189,179	25.72	4,865,683.88
ASX LTD	11,180	83.34	931,741.20
MACQUARIE GROUP LTD	17,576	178.31	3,133,976.56
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	39.07	225,941.81
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	5.24	614,059.88
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.55	456,970.20
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	80,863	11.97	967,930.11
SUNCORP GROUP LTD	63,933	12.72	813,227.76
AFTERPAY LTD	11,491	122.20	1,404,200.20
COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	16.52	462,014.84
WISETECH GLOBAL LTD	7,909	49.89	394,580.01
XERO LTD	7,459	147.49	1,100,127.91
TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.96	859,094.28
AGL ENERGY LIMITED	32,492	6.32	205,349.44
AUSNET SERVICES	137,772	1.98	272,788.56
ORIGIN ENERGY LIMITED	88,060	4.58	403,314.80
	3,409,822		76,420,050.06

	オーストラリアドル 小計			(6,128,888,014)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.42	524,675.62
	A2 MILK CO LTD	19,167	5.70	109,251.90
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	31.55	985,937.50
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	24,028	15.00	360,420.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	111,459	4.90	546,706.39
	MERCURY NZ LTD	26,913	6.48	174,396.24
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,872	5.05	342,753.60
	ニュージーランドドル 小計	351,400		3,044,141.25 (236,590,657)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	130,424	54.60	7,121,150.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	166.80	11,759,400.00
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	94,000	28.75	2,702,500.00
	MTR CORPORATION	84,500	43.55	3,679,975.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS COMPANY LTD	70,000	33.70	2,359,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	48.95	5,776,100.00
	SANDS CHINA LTD	116,000	24.95	2,894,200.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.04	563,200.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	9.01	637,908.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY COMPANY LTD	117,000	16.04	1,876,680.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	18.50	1,657,600.00
	WH GROUP LIMITED	581,500	5.71	3,320,365.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	23.80	4,462,500.00
	HANG SENG BANK LTD	38,800	138.30	5,366,040.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,900	504.50	31,733,050.00
	AIA GROUP LTD	635,000	93.65	59,467,750.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,924	48.95	5,038,129.80
	ESR CAYMAN LTD	102,000	24.00	2,448,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	17.92	1,756,160.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	33.80	2,818,379.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	35.65	3,024,296.45
	SINO LAND CO	118,200	11.06	1,307,292.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	107.90	7,337,200.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	51.10	1,379,700.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	20.40	1,081,200.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	39.10	3,558,100.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	43.85	1,315,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	76.25	6,488,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	12.40	7,519,223.60	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	47.30	3,381,950.00	
	香港ドル 小計	4,167,854		193,831,424.45	(2,733,023,084)
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	54,700	5.25	287,175.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	108,600	3.81	413,766.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	4.92	383,592.72	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.77	253,812.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.11	424,152.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	90,300	30.34	2,739,702.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	181,200	11.65	2,110,980.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	25.83	1,671,201.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	10.05	430,140.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	4.00	546,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.11	183,438.00	
	UOL GROUP LIMITED	17,200	7.00	120,400.00	
	VENTURE CORP LTD	8,700	18.72	162,864.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	384,515	2.40	922,836.00		
	シンガポールドル 小計	1,623,781		10,650,459.22	(868,864,463)
イスラエルシュ ケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	23.00	660,353.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	475.00	659,775.00	
	BANK HAPOLIM BM	66,403	28.81	1,913,070.43	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	27.79	1,949,468.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	17.52	957,888.48	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	108.30	1,001,666.70	
	AZRIELI GROUP	2,140	302.70	647,778.00	
	NICE LTD	3,251	951.60	3,093,651.60	
	イスラエルシュケル 小計	235,967		10,883,651.71	(371,669,087)
	合 計	56,864,701		310,949,577,383	(310,949,577,383)

(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 598銘柄	69.3%	72.6%
カナダドル	株式 89銘柄	3.4%	3.5%
ユーロ	株式 232銘柄	10.2%	10.7%
英ポンド	株式 84銘柄	4.3%	4.5%
スイスフラン	株式 40銘柄	3.0%	3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	1.2%	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 18銘柄	0.8%	0.9%
オーストラリアドル	株式 53銘柄	1.9%	2.0%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	0.8%	0.9%
シンガポールドル	株式 14銘柄	0.3%	0.3%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	405,131.76	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	7,662	1,528,185.90	
		AMERICAN TOWER CORP	23,731	7,033,868.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,936	561,047.04	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	1,647,185.76	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	864,827.30	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	740,839.26	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	22,634	4,283,484.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,126	2,332,580.46	
		DUKE REALTY CORP	17,601	890,082.57	
		EQUINIX INC	4,655	3,886,412.95	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	724,483.68	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,773	1,535,255.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	1,081,100.72	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376	1,353,938.56	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	1,017,099.72	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	624,772.47	
	INVITATION HOMES INC	27,735	1,125,486.30	
	IRON MOUNTAIN INC	14,204	645,429.76	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	655,956.22	
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	1,107,332.40	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,364	336,208.16	
	PROLOGIS INC	38,138	5,055,191.90	
	PUBLIC STORAGE	8,249	2,618,397.58	
	REALTY INCOME CORPORATION	20,646	1,408,263.66	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289	559,590.39	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	2,109,468.12	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,345	2,247,218.20	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088	1,216,017.12	
	UDR INC	16,633	889,200.18	
	VENTAS INC	19,379	1,112,160.81	
	VEREIT INC	10,854	519,798.06	
	VICI PROPERTIES INC	27,615	826,240.80	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	356,771.88	
	WELLTOWER INC	21,015	1,839,653.10	
	WEYERHAEUSER CO	38,940	1,327,464.60	
	WP CAREY INC	8,640	658,454.40	
	米ドル 小計	652,722	57,124,600.63 (6,263,712,459)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	242,072.16	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	167,794.55	
	カナダドル 小計	11,412	409,866.71 (35,396,089)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	181,201.44	
	GECINA SA	2,189	271,873.80	
	KLEPIERRE	13,600	261,664.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,024	469,484.16	

ユーロ 小計		25,201	1,184,223.40 (153,321,403)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	232,723.31
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	277,352.83
	SEGRO PLC	59,874	764,590.98
英ポンド 小計		144,697	1,274,667.12 (192,971,855)
オーストラリアドル	APA GROUP	55,644	504,691.08
	DEXUS	54,256	584,337.12
	GOODMAN GROUP	86,301	1,942,635.51
	GPT GROUP	121,221	601,256.16
	LENDLEASE GROUP	36,263	407,958.75
	MIRVAC GROUP	200,053	608,161.12
	SCENTRE GROUP	275,200	800,832.00
	STOCKLAND	127,393	578,364.22
	SYDNEY AIRPORT	62,186	511,790.78
	TRANSURBAN GROUP	145,337	2,008,557.34
	VICINITY CENTRES	167,788	287,756.42
	オーストラリアドル 小計		1,331,642
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	193,500	1,486,080.00
	HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,115,780.00
	LINK REIT	110,100	7,607,910.00
香港ドル 小計		500,600	11,209,770.00 (158,057,757)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	170,500	523,435.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	238,488	481,745.76
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400	233,792.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100	428,686.00
シンガポールドル 小計		729,488	1,667,658.76 (136,047,601)
合計			7,648,181,672 (7,648,181,672)

(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	1.9%	81.9%
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%	2.0%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.5%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.2%	9.3%
香港ドル	投資証券 3銘柄	0.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	370,349,522	471,624,359
金銭信託	-	1,828,983,066
コール・ローン	2,112,362,318	558,985,152
株式	6,160,546,846	10,200,086,676
投資信託受益証券	663,772,752	590,846,517
投資証券	208,857,950	1,164,708,816
派生商品評価勘定	25,125,386	-
未収入金	2,231,595	142,789
未収配当金	6,366,448	17,783,334
前払金	-	54,729,605
差入委託証拠金	952,341,318	758,656,545
流動資産合計	10,501,954,135	15,646,546,859
資産合計	10,501,954,135	15,646,546,859
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,690,712	58,673,121
前受金	24,863,703	-
未払金	27,451,381	166,857
未払解約金	74,633,173	4,000,000
未払利息	5,053	1,443
その他未払費用	34,538	6,216
流動負債合計	131,678,560	62,847,637
負債合計	131,678,560	62,847,637
純資産の部		
元本等		

元本	7,467,831,585	9,098,817,572
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,902,443,990	6,484,881,650
元本等合計	10,370,275,575	15,583,699,222
純資産合計	10,370,275,575	15,583,699,222
負債純資産合計	10,501,954,135	15,646,546,859

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に、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>
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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,467,831,585口	9,098,817,572口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3887円 (10,000口当たりの純資産額 13,887円)	1口当たり純資産額 1.7127円 (10,000口当たりの純資産額 17,127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 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、社債券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,316,686,308	-	3,341,550,011	24,863,703
	MSCIE 2012	3,316,686,308	-	3,341,550,011	24,863,703
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,080,631,256	-	2,075,940,544	4,690,712
	米ドル	2,080,631,256	-	2,075,940,544	4,690,712
	売建	66,031,256	-	65,769,573	261,683
	米ドル	66,000,000	-	65,738,477	261,523
	香港ドル	31,256	-	31,096	160
	合計	5,463,348,820	-	5,483,260,128	20,434,674

（2021年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,680,021,765	-	3,625,292,160	54,729,605
	MSCIE 2112	3,680,021,765	-	3,625,292,160	54,729,605
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,389,400,000	-	2,385,456,484	3,943,516
	米ドル	2,389,400,000	-	2,385,456,484	3,943,516
	合計	6,069,421,765	-	6,010,748,644	58,673,121

（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 9月16日 至 2021年 9月15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 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,806,463,130円
同期中における追加設定元本額	4,536,852,842円
同期中における一部解約元本額	2,875,484,387円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC つみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,208,547,296円
三井住友・DC 新興国株式インデックスファンド	1,949,190,865円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	575,758,927円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	655,141,612円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	416,212,591円
イオン・バランス戦略ファンド	90,294,022円
三井住友DS・DC ターゲットイヤーファンド2050	15,717,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	45,285,896円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	30,597,380円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	143,761,259円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	100,602,743円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	166,880,524円
三井住友・DC つみたてNISA・世界分散ファンド	39,971,465円
三井住友DS・DC ターゲットイヤーファンド2060	2,609,064円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	27,260,652円

合計	7,467,831,585円
----	----------------

(2021年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,467,831,585円
同期中における追加設定元本額	4,323,012,865円
同期中における一部解約元本額	2,692,026,878円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,256,111,923円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,442,980,621円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	111,304,543円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	259,905,633円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	172,813,862円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,208,151円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,544,068円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,317,201円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	205,349,178円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	151,161,592円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	251,538,782円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	59,398,612円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,375,282円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	586,270円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	592,453円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	669,613円
SMA 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>	35,959,788円
合計	9,098,817,572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	YPF S.A.-SPONSORED ADR	2,632	5.35	14,081.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	2,909	7.24	21,061.16	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	1,088	60.77	66,117.76	
	51JOB INC-ADR	358	72.27	25,872.66	
	DIDI GLOBAL INC	4,100	8.45	34,645.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,820	30.25	176,055.00	

LI AUTO INC - ADR	7,234	29.81	215,645.54
NIO INC-ADR	18,231	37.89	690,772.59
XPENG INC - ADR	5,176	38.44	198,965.44
GAOTU TECHEDU INC- ADR	1,659	2.48	4,114.32
HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,407	48.55	116,859.85
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	20,808	2.00	41,616.00
TAL EDUCATION GROUP-ADR	5,571	4.67	26,016.57
TRIP.COM GROUP-ADR	6,827	28.40	193,886.80
YUM CHINA HOLDINGS INC	5,670	61.22	347,117.40
AUTOHOME INC-ADR	927	44.70	41,436.90
BAIDU INC - SPON ADR	3,680	160.52	590,713.60
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,178	79.50	173,151.00
HELLO GROUP INC-SPON ADR	2,159	12.00	25,908.00
HUYA INC-ADR	1,153	9.36	10,792.08
IQIYI INC-ADR	3,643	8.98	32,714.14
JOYY INC	758	62.05	47,033.90
NETEASE.COM INC -ADR	5,421	84.52	458,182.92
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,009	8.06	72,612.54
WEIBO CORP-SPON ADR	841	51.66	43,446.06
BAOZUN INC-SPN-ADR	838	20.73	17,371.74
DADA NEXUS LTD-ADR	799	19.51	15,588.49
JD.COM INC-ADR	11,657	77.90	908,080.30
PINDUODUO INC-ADR	5,914	101.78	601,926.92
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	6,030	13.49	81,344.70
ADECOAGRO SA	1,698	9.70	16,470.60
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,287	5.05	41,849.35
BEIGENE LTD-ADR	617	368.89	227,605.13
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	588	19.62	11,536.56
HUTCHMED CHINA LTD-ADR	1,066	39.14	41,723.24
I-MAB-SPONSORED ADR	471	68.72	32,367.12
ZAI LAB LTD-ADR	1,053	134.59	141,723.27
CREDICORP LTD	911	106.27	96,811.97
360 DIGITECH INC	1,160	21.66	25,125.60
LUFAX HOLDING LTD	2,325	7.81	18,158.25
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	377	38.50	14,514.50

	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,071	13.41	14,362.11	
	KE HOLDINGS INC-ADR	4,909	17.44	85,612.96	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	14,880	0.91	13,540.80	
	21VIANET GROUP INC-ADR	1,166	20.10	23,436.60	
	AGORA INC-ADR	680	29.97	20,379.60	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,520	10.35	15,732.00	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	1,203	60.94	73,310.82	
	GLOBANT SA	530	322.50	170,925.00	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	608	31.84	19,358.72	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,578	4.31	6,801.18	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	787	61.00	48,007.00	
	米ドル 小計	192,982		6,452,482.96	(707,514,756)
メキシコペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV	43,200	87.14	3,764,448.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,695	267.38	453,209.10	
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	11,700	54.85	641,745.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,700	69.65	536,305.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	2,655	361.36	959,410.80	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,000	231.78	1,158,900.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	3,050	147.31	449,295.50	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	71,100	71.61	5,091,471.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,000	124.11	868,770.00	
	BECLE SAB DE CV	6,000	49.00	294,000.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,465	236.66	583,366.90	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	19,600	55.35	1,084,860.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	17,600	35.24	620,224.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	34,700	128.52	4,459,644.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	28,200	17.64	497,448.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	459,500	18.86	8,666,170.00	
	TELESITES SAB DE CV	14,700	16.91	248,577.00	
	メキシコペソ 小計	735,865		30,377,844.30	(167,366,733)
ブラジルリアル	COSAN SA	12,688	23.50	298,168.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	49,800	26.68	1,328,664.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	63,800	25.88	1,651,144.00	

ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,600	14.51	153,806.00
BRADESPAR SA -PREF	2,900	60.64	175,856.00
BRASKEM SA-PREF A	2,600	69.42	180,492.00
COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	8,500	33.13	281,605.00
GERDAU S.A.-PREF	16,400	27.55	451,820.00
SUZANO SA	10,615	60.05	637,430.75
VALE SA	53,100	94.09	4,996,179.00
WEG SA	22,460	39.38	884,474.80
COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	13,800	11.77	162,426.00
LOCALIZA RENT A CAR SA	7,900	58.00	458,200.00
RUMO SA	15,600	18.42	287,352.00
ALPARGATAS SA - PREF	2,100	57.93	121,653.00
AMERICANAS SA	5,275	41.23	217,488.25
LOJAS RENNER S.A.	12,780	37.38	477,716.40
MAGAZINE LUIZA SA	41,000	17.03	698,230.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	15,680	25.32	397,017.60
VIA S/A	14,000	9.05	126,700.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	8,100	18.67	151,227.00
RAIA DROGASIL SA	14,300	26.00	371,800.00
AMBEV SA	65,400	16.44	1,075,176.00
BRF-BRASIL FOODS SA	9,900	23.89	236,511.00
JBS SA	11,800	33.28	392,704.00
NATURA &CO HOLDING SA	12,100	49.95	604,395.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,000	15.23	258,910.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,700	84.70	567,490.00
REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,400	70.30	379,620.00
HYPERMARCAS SA	6,000	34.80	208,800.00
BANCO BRADESCO S.A.-PREF	65,806	21.23	1,397,061.38
BANCO BRADESCO SA	17,938	18.27	327,727.26
BANCO DO BRASIL S.A.	10,600	29.23	309,838.00
ITAU UNIVANCO HOLDING SA	64,900	28.99	1,881,451.00
ITAUSA SA	62,380	11.06	689,922.80
BM&F BOVESPA SA	82,000	14.13	1,158,660.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	8,600	19.62	168,732.00
TOTVS SA	6,600	38.55	254,430.00

	TELEFONICA BRASIL SA	6,900	42.79	295,251.00	
	TIM SA	11,100	12.19	135,309.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	3,800	38.20	145,160.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	3,100	38.63	119,753.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	13,946	13.76	191,896.96	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	7.13	78,430.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	3,900	35.09	136,851.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,400	27.88	66,912.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	39.28	100,164.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,200	25.28	283,136.00	
	ブラジルリアル 小計	927,018		25,973,741.20	(543,396,639)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,818	7,049.00	41,011,082.00	
	EMPRESAS CMPC SA	13,085	1,620.00	21,197,700.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	1,830	43,348.00	79,326,840.00	
	FALABELLA SA	10,123	2,825.00	28,597,475.00	
	CENCOSUD SA	18,317	1,410.00	25,826,970.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	7,375.10	11,696,908.60	
	BANCO DE CHILE	608,640	77.15	46,956,576.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	640	30,700.00	19,648,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,002,990	40.40	40,520,796.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,523	997.99	5,511,898.77	
	COLBUN SA	124,112	129.50	16,072,504.00	
	ENEL AMERICAS SA	263,707	101.30	26,713,519.10	
	ENEL CHILE SA	364,877	37.90	13,828,838.30	
	チリペソ 小計	2,421,248		376,909,107.77	(52,683,601)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	61,693	2,550.00	157,317,150.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,656	31,000.00	113,336,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,554	31,070.00	172,562,780.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	19,920.00	59,481,120.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,933	22,330.00	132,483,890.00	
	コロンビアペソ 小計	79,822		635,180,940.00	(18,183,959)
ユーロ	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	

	OPAP SA	2,776	13.36	37,087.36	
	JUMBO S.A.	1,451	12.90	18,717.90	
	ALPHA BANK AE	30,000	1.15	34,500.00	
	EUROBANK ERGASIAS SEEVICES & HOLDINGS SA	35,017	0.84	29,722.42	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,986	16.48	49,224.21	
	ユーロ 小計	72,353		169,842.29	(21,989,481)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,504	106.70	160,476.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	19,752	17.77	350,993.04	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	14.96	126,441.92	
	KOC HOLDING AS	9,107	22.42	204,178.94	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	22,434	8.50	190,689.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	947	168.80	159,853.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,702	67.45	384,599.90	
	AKBANK T.A.S.	39,334	5.65	222,237.10	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	35,453	9.56	338,930.68	
	TURKIYE IS BANKASI-C	22,389	5.41	121,124.49	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	15,566	15.84	246,565.44	
	トルコリラ 小計	180,640		2,506,090.91	(32,582,439)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	934	845.00	789,230.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	89.00	426,310.00	
	CEZ AS	2,068	688.00	1,422,784.00	
	チェココルナ 小計	7,792		2,638,324.00	(13,468,907)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	5,818	2,396.00	13,939,928.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,803	8,595.00	15,496,785.00	
	OTP BANK PLC	2,983	18,400.00	54,887,200.00	
	ハンガリーフォリント 小計	10,604		84,323,913.00	(31,199,594)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,209	80.50	338,824.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	21,226	6.38	135,421.88	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,813	174.45	316,277.85	
	LPP SA	15	14,390.00	215,850.00	
	CD PROJEKT SA	1,044	188.78	197,086.32	

	CYFROWY POLSAT SA	3,380	34.62	117,015.60	
	ALLEGRO.EU SA	4,840	62.10	300,564.00	
	DINO POLSKA SA	651	339.10	220,754.10	
	BANK PEKAO SA	2,279	107.00	243,853.00	
	PKO BANK POLSKI SA	11,801	43.71	515,821.71	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	565	303.80	171,647.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,749	38.49	336,749.01	
	ORANGE POLSKA SA	6,710	8.12	54,485.20	
	PGE SA	10,070	10.20	102,714.00	
	ポーランドズロチ 小計	77,352		3,267,064.17	(92,802,264)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	26,000	6.99	181,740.00	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	338,000	3.90	1,318,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	46,000	18.58	854,680.00	
	PETROCHINA CO LTD	298,000	3.72	1,108,560.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	20,000	16.40	328,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	52,000	6.78	352,560.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	47.60	833,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	31,000	13.36	414,160.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	36,000	6.16	221,760.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	48,000	12.48	599,040.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	38,000	8.90	338,200.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	3,400	153.10	520,540.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	12,000	16.80	201,600.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	14,000	17.08	239,120.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	13,000	7.24	94,120.00	
	MMG LIMITED	32,000	3.87	123,840.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	21,000	11.40	239,400.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	6,250	14.90	93,125.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	10,000	6.61	66,100.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	76,000	11.84	899,840.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	26,000	5.73	148,980.00	
	BOC AVIATION LTD	3,500	63.40	221,900.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	3.96	79,200.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	21,000	33.50	703,500.00	

CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	15,000	15.16	227,400.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	45,000	4.34	195,300.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	34,000	6.94	235,960.00	
CITIC LIMITED	77,000	9.72	748,440.00	
FOSUN INTERNATIONAL	31,500	10.00	315,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	7,000	28.95	202,650.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	10.08	191,520.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	13.96	139,600.00	
WEICHAO POWER CO	24,000	18.08	433,920.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	10,418	16.46	171,480.28	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	6,600	39.30	259,380.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	8.06	104,780.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	53,000	6.18	327,540.00	
AIR CHINA/HONG KONG	32,000	5.19	166,080.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	20,000	4.66	93,200.00	
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	16,140	13.24	213,693.60	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.46	107,040.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS COMPANY LIMITED	42,900	14.82	635,778.00	
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	24,000	6.07	145,680.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	8.09	177,980.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	13,000	10.86	141,180.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	6.67	80,040.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	6.02	180,600.00	
BYD CO LTD-H	10,500	263.00	2,761,500.00	
DONGFENG MOTOR CORPORATION	32,000	8.14	260,480.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,200	44.40	408,480.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	79,000	26.50	2,093,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	41,500	33.60	1,394,400.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	39,200	8.16	319,872.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	28.80	288,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	14,000	12.98	181,720.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	14,000	159.00	2,226,000.00	
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	44,000	6.58	289,520.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	30,200	28.00	845,600.00	
LI NING COMPANY LIMITED	30,000	98.95	2,968,500.00	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,200	168.10	1,882,720.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	10,000	8.59	85,900.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	12,000	13.32	159,840.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	26,000	3.72	96,720.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	14,000	31.40	439,600.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9,000	24.75	222,750.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	15,200	17.76	269,952.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	0.81	89,100.00	
CHINA LITERATURE LTD	5,400	67.20	362,880.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	3,700	97.70	361,490.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	77,100	472.80	36,452,880.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	203,300	158.30	32,182,390.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	40.10	320,800.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	198,000	0.79	156,420.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	36,000	2.75	99,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,700	76.90	361,430.00	
MEITUAN-B	54,000	245.00	13,230,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	21,000	9.73	204,330.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,500	63.80	542,300.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	3.76	92,120.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,500	102.03	153,045.00	
CHINA FEIHE LTD	50,000	13.50	675,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	43,000	47.35	2,036,050.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	20,000	58.65	1,173,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.22	82,290.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	4,400	38.05	167,420.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	24,000	34.55	829,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	14.60	379,600.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	61.50	492,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	13,000	7.42	96,460.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	67,000	5.42	363,140.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	6,000	42.25	253,500.00	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	8,000	41.65	333,200.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	23.00	92,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	52,000	11.76	611,520.00	

JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	13.22	264,400.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	50.40	453,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,100	55.00	335,500.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	36,000	13.62	490,320.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	16.14	124,278.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	18,800	21.05	395,740.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,000	44.60	133,800.00
3SBIO INC	17,000	8.59	146,030.00
AKESO INC	4,000	43.70	174,800.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	278.00	278,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	17,000	15.00	255,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	120,800	9.70	1,171,760.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	4.04	48,480.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	42,000	3.76	157,920.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	16,000	33.25	532,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,400	167.20	234,080.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	20.90	376,200.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	16,000	65.20	1,043,200.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,000	184.40	368,800.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	7,500	48.15	361,125.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	145,000	6.67	967,150.00
SSY GROUP LIMITED	10,000	4.46	44,600.00
WUXI APPTTEC CO LTD	4,411	168.90	745,017.90
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,000	117.30	5,630,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	340,000	2.73	928,200.00
BANK OF CHINA LTD	1,071,000	2.81	3,009,510.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	108,000	4.62	498,960.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	27,500	3.30	90,750.00
CHINA CITIC BANK	120,000	3.65	438,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,288,000	5.66	7,290,080.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	34,000	2.85	96,900.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	52,500	66.40	3,486,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	80,100	3.26	261,126.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	24,000	3.01	72,240.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	755,000	4.40	3,322,000.00

POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	115,000	5.61	645,150.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	90,000	1.45	130,500.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	10.28	82,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	36,000	4.62	166,320.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	92,000	0.84	77,280.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	18,400	22.50	414,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	33,000	20.60	679,800.00
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	8.92	249,760.00
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	15.20	258,400.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	42,800	7.22	309,016.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	24,600	12.56	308,976.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	100,000	13.28	1,328,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,000	23.50	799,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	22,200	12.34	273,948.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	11,400	23.40	266,760.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	127,000	2.49	316,230.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	92,000	7.42	682,640.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	85,500	57.60	4,924,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6,700	35.90	240,530.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	7,000	30.30	212,100.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	12,000	7.29	87,480.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	18,000	4.32	77,760.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	27,000	2.97	80,190.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	62,000	2.43	150,660.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	49,000	17.82	873,180.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	6.15	92,250.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	29.30	1,289,200.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	8,600	37.20	319,920.00
CHINA VANKE CO LTD -H	22,100	20.20	446,420.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	10,000	13.70	137,000.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	5.05	212,100.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	99,000	7.88	780,120.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	21,000	56.15	1,179,150.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	12,500	12.66	158,250.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	18,000	8.09	145,620.00

GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	26,800	5.84	156,512.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED	10,000	28.70	287,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	50,000	2.20	110,000.00	
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	12,500	7.39	92,375.00	
LOGAN GROUP COMPANY LIMITED	16,000	8.24	131,840.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,500	34.85	888,675.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	1,200	44.25	53,100.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	25,000	5.73	143,250.00	
SEAZEN GROUP LTD	32,000	6.46	206,720.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	42,000	2.27	95,340.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	15.68	290,080.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	16.06	160,600.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	33,000	16.30	537,900.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	16.02	160,200.00	
WHARF HOLDINGS LTD	17,000	26.60	452,200.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	17,600	7.35	129,360.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	4.27	59,780.00	
CHINA YOUZAN LTD	172,000	1.05	180,600.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	34,000	13.44	456,960.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	35,000	25.35	887,250.00	
KINGSOFT CORPORATION LTD.	13,000	30.90	401,700.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	5,000	27.55	137,750.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	12,000	14.74	176,880.00	
WEIMOB INC	21,000	11.90	249,900.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	9,000	40.55	364,950.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	8,500	33.25	282,625.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	10,000	37.40	374,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	12,000	14.10	169,200.00	
LENOVO GROUP LTD	102,000	8.20	836,400.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,600	226.00	2,169,600.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	192,200	23.25	4,468,650.00	
ZTE CORPORATION	10,200	27.05	275,910.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	578,000	1.05	606,900.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	6,000	29.80	178,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	60,000	3.25	195,000.00	

	CGN POWER CO LTD-H	167,000	2.14	357,380.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	43,200	22.20	959,040.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	45,000	16.04	721,800.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	3.45	127,650.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	12,000	45.90	550,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	26,000	20.30	527,800.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,600	143.90	1,525,340.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	40,000	10.70	428,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	44,000	3.94	173,360.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	58,000	8.86	513,880.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	5,000	37.05	185,250.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	6,000	42.55	255,300.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	66,000	17.48	1,153,680.00	
	香港ドル 小計	11,485,819		201,531,029.78 (2,841,587,519)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	48,600	2.66	129,276.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,000	19.82	59,460.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	34,800	7.92	275,616.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	39,200	5.58	218,736.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	8.73	70,713.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.24	105,504.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.70	98,490.00	
	MISC BHD	19,600	7.00	137,200.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	4.35	43,500.00	
	GENTING BHD	25,800	4.94	127,452.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	43,800	3.02	132,276.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	27.52	33,024.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	31,800	3.90	124,020.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	5,000	20.42	102,100.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	900	134.80	121,320.00	
	PPB GROUP BERHAD	9,040	18.42	166,516.80	
	QL RESOURCES BHD	13,050	5.50	71,775.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,900	3.84	91,776.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,100	6.32	145,992.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	27,500	6.54	179,850.00	

	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	15,000	2.70	40,500.00	
	SUPERMAX CORP BHD	16,968	2.64	44,795.52	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	76,500	3.23	247,095.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	17,000	3.13	53,210.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	92,600	4.78	442,628.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.46	186,446.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	18.30	34,770.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	53,500	8.29	443,515.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	196,300	4.00	785,200.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.35	154,615.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,600	4.04	131,704.00	
	DIGI.COM BHD	38,800	4.48	173,824.00	
	MAXIS BERHAD	26,800	4.77	127,836.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	5.98	95,680.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,600	16.76	177,656.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	33,100	10.18	336,958.00	
	マレーシアリングット 小計	1,096,858		5,911,029.32	(155,627,944)
タイバーツ	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	18,400	112.50	2,070,000.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	139,400	39.00	5,436,600.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	15,000	50.50	757,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	24,700	44.75	1,105,325.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	33,300	60.75	2,022,975.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	17,200	66.25	1,139,500.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	10,800	412.00	4,449,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	55,000	62.25	3,423,750.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	126,600	8.80	1,114,080.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	90,600	9.45	856,170.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	69,600	4.32	300,672.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	36,600	33.00	1,207,800.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,891	33.75	705,071.25	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	74,400	14.10	1,049,040.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	36,300	29.00	1,052,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	19,000	34.00	646,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	81,100	62.25	5,048,475.00	

	CARABAO GROUP PCL	5,400	129.50	699,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	53,100	26.50	1,407,150.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	16,200	34.75	562,950.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	31,900	21.60	689,040.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	127,700	22.30	2,847,710.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	5,400	131.00	707,400.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,000	33.75	438,750.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	11.00	321,200.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	12,700	103.50	1,314,450.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,000	18.50	333,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,300	63.50	908,050.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	63.00	478,800.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	70.00	826,000.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	25,200	53.75	1,354,500.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	108,900	8.10	882,090.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	4,500	582.00	2,619,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,000	190.00	3,040,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,400	77.75	1,119,600.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	150,000	3.36	504,000.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	42.75	290,700.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	3,800	177.00	672,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	20,800	65.25	1,357,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	9,600	79.50	763,200.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	40,800	40.50	1,652,400.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	7,900	45.75	361,425.00	
	タイパーツ 小計	1,623,891		58,535,773.25 (194,338,767)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	26,650	45.10	1,201,915.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	810.50	3,071,795.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	555.00	727,050.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,282	65.00	2,618,330.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,205	988.00	3,166,540.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,770	188.00	2,212,760.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	7,480	204.20	1,527,416.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,180	143.00	1,455,740.00	

	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	22,527	82.45	1,857,351.15	
	BDO UNIBANK INC	28,670	113.00	3,239,710.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	24,240	45.00	1,090,800.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.77	418,093.00	
	AYALA LAND INC	117,600	33.60	3,951,360.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	131,400	33.50	4,401,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	335	3,174.00	1,063,290.00	
	PLDT INC	1,255	1,480.00	1,857,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,340	295.00	690,300.00	
	フィリピンベソ 小計	543,934		34,551,750.15 (75,882,553)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	263,900	1,385.00	365,501,500.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	19,300	21,400.00	413,020,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	128,000	2,470.00	316,160,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	364,200	1,010.00	367,842,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	29,700	7,875.00	233,887,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	10,700.00	141,240,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	179,700	2,740.00	492,378,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	43,500	8,900.00	387,150,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	255,600	5,525.00	1,412,190,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	112,900	6,600.00	745,140,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	21,200	8,450.00	179,140,000.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	32,500.00	130,000,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	51,300	6,175.00	316,777,500.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	104,500	4,050.00	423,225,000.00	
	KALBE FARMA PT	246,100	1,480.00	364,228,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	103,700	5,400.00	559,980,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA-RIGHTS	167,073	226.00	37,758,498.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	149,600	32,725.00	4,895,660,000.00	
	PT BANK MANDIRI	265,600	6,100.00	1,620,160,000.00	
	PT BANK RAKYAT	726,000	3,700.00	2,686,200,000.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	283,900	1,350.00	383,265,000.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	692,700	3,440.00	2,382,888,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	2,990.00	355,511,000.00		
		4,344,573		19,209,301,998.00	

	インドネシアルピア 小計			(147,911,625)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	628	43,050.00	27,035,400.00
	S-OIL CORPORATION	553	100,500.00	55,576,500.00
	SK INNOVATION CO LTD	682	256,000.00	174,592,000.00
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,476	42,700.00	63,025,200.00
	HYUNDAI STEEL COMPANY	1,044	53,100.00	55,436,400.00
	KOREA ZINC CO., LTD.	97	521,000.00	50,537,000.00
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	227	199,000.00	45,173,000.00
	LG CHEM LTD	614	734,000.00	450,676,000.00
	LG CHEM LTD	89	345,500.00	30,749,500.00
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	207	256,000.00	52,992,000.00
	POSCO	1,000	366,500.00	366,500,000.00
	POSCO CHEMICAL CO LTD	461	154,500.00	71,224,500.00
	SK CHEMICALS CO LTD	96	296,000.00	28,416,000.00
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	191	227,500.00	43,452,500.00
	SKC CO LTD	281	177,500.00	49,877,500.00
	CJ CORP	168	106,000.00	17,808,000.00
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	415	29,550.00	12,263,250.00
	DOOSAN BOBCAT INC	664	42,500.00	28,220,000.00
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION	3,599	21,000.00	75,579,000.00
	ECOPRO BM CO LTD	147	436,800.00	64,209,600.00
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	891	44,750.00	39,872,250.00
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	921	53,900.00	49,641,900.00
	HYUNDAI ENGINEERING&CON(1905451D) -RIGHTS	15	0.00	0.00
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	570	68,400.00	38,988,000.00
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	1,063	31,550.00	33,537,650.00
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	478	118,500.00	56,643,000.00
	LG CORP	1,117	96,600.00	107,902,200.00
	SAMSUNG C&T CORPORATION	1,079	130,000.00	140,270,000.00
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,075	24,150.00	50,111,250.00
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	6,668	6,630.00	44,208,840.00
SK INC	453	268,500.00	121,630,500.00	
S1 CORPORATION	219	85,200.00	18,658,800.00	
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	170,500.00	12,617,000.00	
GLOVIS CO LTD	234	181,500.00	42,471,000.00	

HMM CO LTD	3,618	38,350.00	138,750,300.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,328	32,450.00	75,543,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	4,527	7,490.00	33,907,230.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	963	45,100.00	43,431,300.00	
HANON SYSTEMS	2,380	16,100.00	38,318,000.00	
HYUNDAI MOBIS	897	269,500.00	241,741,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,861	209,000.00	388,949,000.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	419	99,500.00	41,690,500.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	313	101,000.00	31,613,000.00	
KIA CORP	3,528	83,400.00	294,235,200.00	
COWAY CO LTD	746	78,400.00	58,486,400.00	
FILA HOLDINGS CORP	620	46,700.00	28,954,000.00	
HLB INC	1,314	61,100.00	80,285,400.00	
LG ELECTRONICS INC	1,477	142,500.00	210,472,500.00	
KANGWON LAND INC	1,392	28,100.00	39,115,200.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	1,193	23,450.00	27,975,850.00	
HYBE CO LTD	182	283,500.00	51,597,000.00	
KAKAO CORP	4,160	124,000.00	515,840,000.00	
NAVER CORPORATION	1,649	402,500.00	663,722,500.00	
NCSOFT CORP	228	599,000.00	136,572,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	337	124,000.00	41,788,000.00	
PEARLABYSS CORP	399	82,900.00	33,077,100.00	
CJ ENM CO LTD	144	149,600.00	21,542,400.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	90,400.00	36,792,800.00	
LOTTE SHOPPING CO LTD	172	109,000.00	18,748,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	120	276,500.00	33,180,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	61	179,000.00	10,919,000.00	
E-MART INC	237	170,500.00	40,408,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	125	441,000.00	55,125,000.00	
KT&G CORPORATION	1,574	81,400.00	128,123,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	373	124,500.00	46,438,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	419	191,500.00	80,238,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	53,800.00	25,447,400.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	130	1,386,000.00	180,180,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	668,000.00	11,356,000.00	

CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,127	110,900.00	124,984,300.00	
ALTEOGEN INC	312	78,600.00	24,523,200.00	
CELLTRION INC	1,293	263,000.00	340,059,000.00	
CELLTRION PHARM INC	173	148,700.00	25,725,100.00	
GREEN CROSS CORP	79	358,000.00	28,282,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	302,500.00	26,317,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	221	913,000.00	201,773,000.00	
SEEGENE INC	408	64,100.00	26,152,800.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	334	67,400.00	22,511,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	383	115,000.00	44,045,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	256	276,500.00	70,784,000.00	
YUHAN CORPORATION	760	64,800.00	49,248,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP INC.	4,190	45,150.00	189,178,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,084	10,250.00	41,861,000.00	
KAKAObANK CORP	700	69,700.00	48,790,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,328	52,300.00	278,654,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	5,922	39,150.00	231,846,300.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,654	11,100.00	73,859,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	576	88,500.00	50,976,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	5,310.00	29,353,680.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	4,496	8,740.00	39,295,040.00	
SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD.	982	49,150.00	48,265,300.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	2,376	13,450.00	31,957,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	507	61,500.00	31,180,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	378	233,500.00	88,263,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	1,020	75,000.00	76,500,000.00	
DUZONBIZON CO LTD	190	100,500.00	19,095,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	428	168,000.00	71,904,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	3,101	20,350.00	63,105,350.00	
LG INNOTEK CO LTD	158	227,500.00	35,945,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	794	187,000.00	148,478,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	63,941	76,600.00	4,897,880,600.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11,017	71,400.00	786,613,800.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	737	755,000.00	556,435,000.00	
LG UPLUS CORP	3,103	14,600.00	45,303,800.00	

	SK TELECOM CO LTD	116	303,500.00	35,206,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	3,402	23,800.00	80,967,600.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	7,310	107,500.00	785,825,000.00	
	韓国ウォン 小計	209,750		16,195,605,990.00 (1,515,908,720)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	98.00	1,372,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	29,000	46.50	1,348,500.00	
	CHINA STEEL CORP	158,000	39.85	6,296,300.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	49,000	83.20	4,076,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	52,000	102.00	5,304,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	71,000	88.60	6,290,600.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	67,077	51.40	3,447,757.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	910.00	1,820,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	35,000	29.75	1,041,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,121	338.50	1,056,458.50	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	33,740	123.50	4,166,890.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	29,000	29.90	867,100.00	
	WAN HAI LINES LTD	7,700	201.50	1,551,550.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	21,000	117.50	2,467,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	21,000	37.35	784,350.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	3,000	612.00	1,836,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	5,640	220.00	1,240,800.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	4,000	343.00	1,372,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	420.00	840,000.00	
	POU CHEN	26,000	33.95	882,700.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	603.00	2,412,000.00	
	MOMO.COM INC	1,000	2,010.00	2,010,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	278.00	2,224,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	69.40	4,511,000.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	186.00	558,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	65,754	16.65	1,094,804.10	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	252,000	23.00	5,796,000.00		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	162,201	26.35	4,273,996.35		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	139,792	22.70	3,173,278.40		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	103,133	21.15	2,181,262.95		

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	147,000	32.50	4,777,500.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	124,760	14.05	1,752,878.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	125,958	18.55	2,336,520.90
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	128,105	22.20	2,843,931.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	48,299	45.65	2,204,849.35
CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,463	281.00	4,907,103.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	131,160	25.10	3,292,116.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	107,000	59.80	6,398,600.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	182,000	14.30	2,602,600.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,832	29.10	664,411.20
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	99,000	80.80	7,999,200.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	148,432	9.50	1,410,104.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,700	83.50	726,450.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	278.50	1,949,500.00
ACER INC	34,000	24.75	841,500.00
ADVANTECH CO LTD	5,299	372.00	1,971,228.00
ASUSTEK COMPUTER INC	10,000	322.50	3,225,000.00
AU OPTRONICS CORP	107,000	17.65	1,888,550.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	158.50	1,426,500.00
COMPAL ELECTRONICS	53,000	23.10	1,224,300.00
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	263.50	6,851,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	11,000	62.80	690,800.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	167,800	107.50	18,038,500.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	118,000	16.60	1,958,800.00
INVENTEC CORPORATION	42,000	24.65	1,035,300.00
LARGAN PRECISION CO LTD	1,080	2,530.00	2,732,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	31,000	61.10	1,894,100.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	8,000	138.50	1,108,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	3,000	444.00	1,332,000.00
PEGATRON CORP	27,000	64.50	1,741,500.00
QUANTA COMPUTER INC	37,000	75.70	2,800,900.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	16,000	53.10	849,600.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	16,000	142.50	2,280,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	4,000	172.00	688,000.00
WISTRON CORPORATION	35,293	27.20	959,969.60

	WIWYNN CORP	1,000	892.00	892,000.00	
	WPG HOLDINGS CO LTD	24,520	48.30	1,184,316.00	
	YAGEO CORPORATION	5,198	481.00	2,500,238.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	7,000	98.60	690,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	111.00	5,661,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	22,000	60.80	1,337,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	22,000	99.00	2,178,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	45,000	124.50	5,602,500.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	2,100.00	1,050,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	895.00	2,685,000.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	20,000	947.00	18,940,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	14,000	66.20	926,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	8,000	440.00	3,520,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	412.50	825,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	111.50	1,115,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	529.00	3,174,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	4,375.00	4,375,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	330,000	613.00	202,290,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	159,000	66.00	10,494,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	12,000	160.00	1,920,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	320.50	1,282,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	45,000	29.40	1,323,000.00	
	新台湾ドル 小計	4,288,557		449,666,263.15 (1,781,083,101)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	10,659	493.10	5,255,952.90	
	COAL INDIA LTD	20,779	154.70	3,214,511.30	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,413	274.15	2,032,273.95	
	INDIAN OIL CORP LTD	29,088	115.25	3,352,392.00	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	34,064	123.95	4,222,232.80	
	PETRONET LNG LTD	8,894	231.05	2,054,958.70	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	38,050	2,368.45	90,119,522.50	
	ACC LIMITED	1,019	2,442.95	2,489,366.05	
	AMBUJA CEMENTS LTD	9,373	432.45	4,053,353.85	
	ASIAN PAINTS LTD	5,175	3,362.50	17,400,937.50	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,709	834.85	2,261,608.65	

GRASIM INDUSTRIES LTD	3,391	1,611.80	5,465,613.80
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,210	477.95	10,137,319.50
JSW STEEL LTD	11,353	693.65	7,875,008.45
PI INDUSTRIES LTD	1,067	3,497.60	3,731,939.20
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,056	2,408.85	4,952,595.60
SHREE CEMENT LTD	146	30,658.50	4,476,141.00
TATA STEEL LTD	9,384	1,452.30	13,628,383.20
ULTRATECH CEMENT LTD	1,418	7,856.45	11,140,446.10
UPL LTD	7,208	752.50	5,424,020.00
VEDANTA LTD	14,989	303.20	4,544,664.80
ADANI ENTERPRISES LTD	4,024	1,513.20	6,089,116.80
BHARAT ELECTRONICS LTD	19,131	202.40	3,872,114.40
HAVELLS INDIA LTD	3,011	1,465.55	4,412,771.05
LARSEN & TOUBRO LTD	9,215	1,696.45	15,632,786.75
SIEMENS LTD	1,167	2,207.30	2,575,919.10
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	7,391	755.40	5,583,161.40
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	3,801	729.10	2,771,309.10
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,271	1,943.00	2,469,553.00
BAJAJ AUTO LTD	949	3,751.05	3,559,746.45
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	971	2,472.50	2,400,797.50
BHARAT FORGE LTD	3,465	780.05	2,702,873.25
EICHER MOTORS LTD	1,826	2,820.30	5,149,867.80
HERO MOTOCORP LTD	1,617	2,851.70	4,611,198.90
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11,737	750.20	8,805,097.40
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	1,833	6,894.45	12,637,526.85
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	17,036	221.95	3,781,140.20
MRF LTD	21	80,423.85	1,688,900.85
TATA MOTORS LTD	21,998	306.10	6,733,587.80
PAGE INDUSTRIES LTD	82	32,590.45	2,672,416.90
TITAN CO LTD	4,625	2,055.70	9,507,612.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,066	4,116.00	4,387,656.00
INFO EDGE INDIA LTD	1,041	6,722.50	6,998,122.50
TRENT LTD	2,023	1,004.00	2,031,092.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,184	3,979.70	8,691,664.80
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	1,462	4,101.50	5,996,393.00

ITC LIMITED	41,784	216.10	9,029,522.40
NESTLE INDIA LTD	452	20,230.45	9,144,163.40
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,079	881.30	7,120,022.70
UNITED SPIRITS LTD	3,920	758.90	2,974,888.00
COLGATE PALMOLIVE INDIA	1,365	1,732.95	2,365,476.75
DABUR INDIA LIMITED	8,343	639.20	5,332,845.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,827	1,114.05	5,377,519.35
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	10,978	2,762.55	30,327,273.90
MARICO LTD	6,577	558.30	3,671,939.10
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,357	4,732.45	6,421,934.65
AUROBINDO PHARMA LIMITED	3,611	748.05	2,701,208.55
BIOCON LTD	4,686	355.70	1,666,810.20
CIPLA LTD	6,526	953.15	6,220,256.90
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,790	5,094.85	9,119,781.50
DR.REDDY'S LABORATORIES	1,514	4,930.75	7,465,155.50
IPCA LABORATORIES LTD	918	2,637.50	2,421,225.00
LUPIN LTD	3,151	982.65	3,096,330.15
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	10,932	781.40	8,542,264.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	556	3,133.10	1,742,003.60
AXIS BANK LIMITED	30,568	794.40	24,283,219.20
BANDHAN BANK LTD	10,002	284.35	2,844,068.70
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	23,102	2,818.05	65,102,591.10
ICICI BANK LIMITED	68,018	707.45	48,119,334.10
KOTAK MAHINDRA BANK LIMITED	7,481	1,867.75	13,972,637.75
STATE BANK OF INDIA	22,850	433.00	9,894,050.00
YES BANK LTD	111,806	12.45	1,391,984.70
BAJAJ FINANCE LIMITED	3,647	7,417.55	27,051,804.85
BAJAJ FINSERV LTD	487	16,831.25	8,196,818.75
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,281	581.25	3,650,831.25
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	718	3,268.90	2,347,070.20
MUTHOOT FINANCE LTD	1,343	1,542.40	2,071,443.20
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,440	2,648.70	3,814,128.00
REC LTD	9,915	157.45	1,561,116.75
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,787	1,061.30	2,957,843.10
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,560	1,352.80	3,463,168.00

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	10,903	739.20	8,059,497.60	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	2,989	1,614.70	4,826,338.30	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	4,842	689.90	3,340,495.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,070	1,170.90	7,107,363.00	
	DLF LIMITED	8,519	342.30	2,916,053.70	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	14,640	1,238.65	18,133,836.00	
	INFOSYS LIMITED	45,640	1,686.15	76,955,886.00	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	627	5,580.40	3,498,910.80	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	12,472	3,885.90	48,464,944.80	
	TECH MAHINDRA LTD	8,114	1,452.05	11,781,933.70	
	WIPRO LTD	18,340	673.45	12,351,073.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	33,090	694.20	22,971,078.00	
	INDUS TOWERS LIMITED	9,651	246.25	2,376,558.75	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,136	1,149.40	5,903,318.40	
	ADANI TOTAL GAS LTD	4,019	1,375.00	5,526,125.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	4,001	1,942.70	7,772,742.70	
	GAIL INDIA LIMITED	20,678	156.00	3,225,768.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,121	587.00	2,419,027.00	
	NTPC LTD	69,036	115.90	8,001,272.40	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	44,752	174.10	7,791,323.20	
	インドルピー 小計	1,114,403		952,481,946.00 (1,428,722,919)	
エジプトbond	EASTERN TOBACCO	13,558	12.64	171,373.12	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	22,149	45.80	1,014,424.20	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	5,390	17.00	91,630.00	
	エジプトbond 小計	41,097		1,277,427.32 (8,913,632)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	3,530	189.25	668,052.50	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,503	236.75	355,835.25	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	762	1,365.50	1,040,511.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	5,848	225.35	1,317,846.80	
	GOLD FIELDS LIMITED	11,457	127.26	1,458,017.82	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	8,544	48.14	411,308.16	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	10,682	176.55	1,885,907.10	
	KUMBA IRON ORE LTD	836	607.18	507,602.48	

NORTHAM PLATINUM LTD	4,813	173.99	837,413.87	
SASOL LTD.	7,312	235.20	1,719,782.40	
SIBANYE STILLWATER LTD	39,150	50.65	1,982,947.50	
BIDVEST GROUP LTD	3,606	193.89	699,167.34	
MULTICHOICE GROUP LTD	5,073	105.99	537,687.27	
MR PRICE GROUP LTD	3,242	202.13	655,305.46	
NASPERS LIMITED-N SHS	2,934	2,380.17	6,983,418.78	
WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	12,822	59.99	769,191.78	
BID CORP LTD	4,394	309.14	1,358,361.16	
CLICKS GROUP LTD	3,408	305.15	1,039,951.20	
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	6,730	181.31	1,220,216.30	
SPAR GROUP LIMITED	2,598	202.25	525,445.50	
TIGER BRANDS LTD	2,304	182.06	419,466.24	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	5,233	233.59	1,222,376.47	
ABSA GROUP LTD	9,719	151.87	1,476,024.53	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,084	1,910.00	2,070,440.00	
NEDBANK GROUP LTD	4,692	177.45	832,595.40	
STANDARD BANK GROUP LIMITED	17,479	147.36	2,575,705.44	
FIRSTRAND LIMITED	67,593	60.69	4,102,219.17	
REINET INVESTMENTS SCA	1,681	266.62	448,188.22	
REMGRO LTD	6,563	119.41	783,687.83	
DISCOVERY LTD	5,836	128.25	748,467.00	
OLD MUTUAL LTD	63,504	16.06	1,019,874.24	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	9,457	31.22	295,247.54	
SANLAM LTD	25,896	62.43	1,616,687.28	
NEPI ROCKCASTLE PLC	5,844	102.23	597,432.12	
MTN GROUP LIMITED	22,704	125.87	2,857,752.48	
VODACOM GROUP LIMITED	8,666	136.73	1,184,902.18	
南アフリカランド 小計	397,499		48,225,035.81 (368,921,523)	
合計	29,852,057		10,200,086,676 (10,200,086,676)	

(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 52銘柄	4.5%	6.9%
メキシコペソ	株式 17銘柄	1.1%	1.6%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	3.5%	5.3%
チリペソ	株式 13銘柄	0.3%	0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式 6銘柄	0.1%	0.2%
トルコリラ	株式 11銘柄	0.2%	0.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.2%	0.3%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	0.6%	0.9%
香港ドル	株式 212銘柄	18.2%	27.9%
マレーシアリングット	株式 36銘柄	1.0%	1.5%
タイバーツ	株式 42銘柄	1.2%	1.9%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	0.5%	0.7%
インドネシアルピア	株式 23銘柄	0.9%	1.5%
韓国ウォン	株式 107銘柄	9.7%	14.9%
新台湾ドル	株式 87銘柄	11.4%	17.5%
インドルピー	株式 101銘柄	9.2%	14.0%
エジプトポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
南アフリカランド	株式 36銘柄	2.4%	3.6%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	中国元（オフショア）	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	691,400	34,694,452.00	
	中国元（オフショア）小計		691,400	34,694,452.00 (590,846,517)	
投資信託受益証券合計				590,846,517 (590,846,517)	
投資証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	729	19,062.62	
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	18,439	630,060.63	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	38,065	754,117.13	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	86,125	4,047,875.00	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	83,225	3,462,160.00	

	ISHARES MSCI UAE ETF	56,694	850,976.94	
	米ドル 小計	283,277	9,764,252.32	(1,070,650,266)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	211,300	3,228,664.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,770	776,857.50	
	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	36,300	797,511.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,600	4,647,552.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	34,100	1,665,103.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184	287,942.88	
	メキシコペソ 小計	319,254	11,403,630.38	(62,828,301)
ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,000	442,080.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	4,200	283,332.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,300	232,596.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,800	78,210.00	
	KLABIN SA-UNIT	8,800	226,600.00	
	ブラジルリアル 小計	37,100	1,262,818.00	(26,419,415)
南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,751	628,867.21	
	南アフリカランド 小計	42,751	628,867.21	(4,810,834)
投資証券合計			1,164,708,816	(1,164,708,816)
	合計		1,755,555,333	(1,755,555,333)

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資証券 6銘柄	-	6.9%	61.0%
メキシコペソ	投資証券 6銘柄	-	0.4%	3.6%
ブラジルリアル	投資証券 5銘柄	-	0.2%	1.5%
南アフリカランド	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.3%
中国元(オフショア)	投資信託受益証券 1銘柄	3.8%	-	33.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	83,504,812
コール・ローン	116,653,820	25,521,259
投資証券	6,700,385,400	7,359,713,460
派生商品評価勘定	32,400	-
未収入金	61,054,128	-
未収配当金	75,196,020	79,532,884
前払金	-	904,000
差入委託証拠金	12,555,000	1,500,000
流動資産合計	6,965,876,768	7,550,676,415
資産合計	6,965,876,768	7,550,676,415
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	908,400
前受金	39,000	-
未払金	64,240,288	67,492,386
未払解約金	98,000,000	5,320,521
未払利息	279	65
その他未払費用	2,074	117
流動負債合計	162,281,641	73,721,489
負債合計	162,281,641	73,721,489
純資産の部		
元本等		
元本	3,147,959,475	2,701,982,065
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,655,635,652	4,774,972,861
元本等合計	6,803,595,127	7,476,954,926
純資産合計	6,803,595,127	7,476,954,926
負債純資産合計	6,965,876,768	7,550,676,415

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
----	--------------------------------

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,147,959,475口	2,701,982,065口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.1613円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 21,613円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.7672円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,672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 9月16日 至 2021年 9月15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>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	51,117,600	-	51,150,000	32,400
	東証REIT指数先物	51,117,600	-	51,150,000	32,400
合計		51,117,600	-	51,150,000	32,400

(2021年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	42,968,400	-	42,060,000	908,400
	東証REIT指数先物	42,968,400	-	42,060,000	908,400
合計		42,968,400	-	42,060,000	908,400

(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 9月16日 至 2021年 9月15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 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,000,687,352円
同期中における追加設定元本額	2,988,946,947円
同期中における一部解約元本額	2,841,674,824円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	484,065,576円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	548,906,892円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	359,898,064円
イオン・バランス戦略ファンド	60,993,325円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,348,450,459円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,707,216円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	29,043,982円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	19,509,405円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	60,976,141円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,111,060円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	25,064,827円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,672,700円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,300,787円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	328,136円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	47,345,955円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	13,743,335円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	39,497,389円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	56,344,226円
合計	3,147,959,475円

(2021年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,147,959,475円
同期中における追加設定元本額	1,795,755,288円
同期中における一部解約元本額	2,241,732,698円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,612,726円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	146,589,272円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	115,566,389円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,737,939,195円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,564,038円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	41,617,020円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,947,562円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	98,284,108円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	51,092,333円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	40,646,760円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	18,246,810円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,619,034円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	44,595,253円
日興FWS・Jリートインデックス	357,488円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	610,389円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,420,651円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	8,702,519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>	26,259,893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>	55,546,231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>	59,826,581円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド2021-05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	130,937,813円
合計	2,701,982,065円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	127	17,462,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	199	25,233,200	
	S O S i L A 物流リート投資法人	266	47,002,200	
	東海道リート投資法人	48	5,131,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	219	142,131,000	
	森ヒルズリート投資法人	747	117,876,600	
	産業ファンド投資法人	903	193,874,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人	635	236,220,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	434	97,823,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	339	156,957,000	
	G L P 投資法人	2,056	392,079,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	286	100,529,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,006	391,837,000	
	星野リゾート・リート投資法人	97	69,646,000	
	O n e リート投資法人	99	29,442,600	
	イオンリート投資法人	745	109,217,000	
	ヒューリックリート投資法人	559	99,837,400	
	日本リート投資法人	196	86,142,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,417	32,137,560	
	積水ハウス・リート投資法人	1,870	175,967,000	
	トーセイ・リート投資法人	132	18,348,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	253	75,824,100	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	134	20,046,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	143	17,360,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,053	337,923,800	
	いちごホテルリート投資法人	105	9,597,000	
	ラサールロジポート投資法人	777	152,214,300	
	スターアジア不動産投資法人	651	37,172,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	59	7,699,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	236	147,500,000	
大江戸温泉リート投資法人	102	8,251,800		
投資法人みらい	726	39,494,400		
森トラスト・ホテルリート投資法人	147	19,800,900		
三菱地所物流リート投資法人	162	81,810,000		

C R E ロジスティクスファンド投資法人	246	51,881,400	
ザイマックス・リート投資法人	92	10,534,000	
タカラレーベン不動産投資法人	248	26,883,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	247	38,976,600	
日本ビルファンド投資法人	720	519,840,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	635	435,610,000	
日本都市ファンド投資法人	3,203	345,603,700	
オリックス不動産投資法人	1,266	248,895,600	
日本プライムリアルティ投資法人	417	168,885,000	
N T T 都市開発リート投資法人	574	88,453,400	
東急リアル・エステート投資法人	426	80,514,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	442	53,614,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,430	220,649,000	
森トラスト総合リート投資法人	454	69,870,600	
インヴィンシブル投資法人	2,799	117,837,900	
フロンティア不動産投資法人	222	106,005,000	
平和不動産リート投資法人	411	66,828,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	415	142,137,500	
福岡リート投資法人	329	57,081,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	195	150,345,000	
いちごオフィスリート投資法人	521	47,932,000	
大和証券オフィス投資法人	136	105,264,000	
阪急阪神リート投資法人	286	47,590,400	
スタートプロシード投資法人	99	25,571,700	
大和ハウスリート投資法人	954	325,314,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,949	125,320,700	
大和証券リビング投資法人	842	99,945,400	
ジャパンエクセレント投資法人	591	82,740,000	
合計	38,077	7,359,713,460	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	54,611,703	49,504,198
金銭信託	-	17,968,476
コール・ローン	10,287,058	5,491,637
投資証券	7,798,417,816	15,280,172,870
派生商品評価勘定	24,580	15,223
未収入金	82,118	217,869
未収配当金	16,211,329	28,687,210
流動資産合計	7,879,634,604	15,382,057,483
資産合計	7,879,634,604	15,382,057,483
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,203	79,141
未払金	131,634,098	198,292,838
未払解約金	7,000,000	470,292
未払利息	24	14
その他未払費用	153	36
流動負債合計	138,638,478	198,842,321
負債合計	138,638,478	198,842,321
純資産の部		
元本等		
元本	4,117,357,156	5,796,191,821
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,623,638,970	9,387,023,341
元本等合計	7,740,996,126	15,183,215,162
純資産合計	7,740,996,126	15,183,215,162
負債純資産合計	7,879,634,604	15,382,057,483

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
----	--------------------------------

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,117,357,156口	5,796,191,821口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.8801円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 18,801円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.6195円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,195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	<p>自 2020年 9月16日</p> <p>至 2021年 9月15日</p>
----	---

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

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 9月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	135,500,000	-	135,520,377	20,377
	米ドル	98,000,000	-	98,017,020	17,020
	カナダドル	2,650,000	-	2,650,082	82
	ユーロ	6,250,000	-	6,251,431	1,431
	英ポンド	9,000,000	-	9,002,818	2,818
	オーストラリアドル	5,500,000	-	5,500,514	514
	香港ドル	6,100,000	-	6,095,797	4,203
	シンガポールドル	8,000,000	-	8,002,715	2,715
合計		135,500,000	-	135,520,377	20,377

(2021年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

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

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	216,100,000	-	216,036,082	63,918
	米ドル	167,500,000	-	167,452,205	47,795
	カナダドル	4,100,000	-	4,100,655	655
	ユーロ	9,200,000	-	9,198,562	1,438
	英ポンド	11,300,000	-	11,294,712	5,288
	オーストラリアドル	15,500,000	-	15,489,365	10,635
	香港ドル	3,600,000	-	3,600,842	842
	シンガポールドル	4,900,000	-	4,899,741	259
	合計	216,100,000	-	216,036,082	63,918

(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 9月16日

至 2021年 9月15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 9月15日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	2,518,654,861円
同期中における追加設定元本額	2,584,449,838円
同期中における一部解約元本額	985,747,543円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	54,039,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	60,808,013円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,552,987円
イオン・バランス戦略ファンド	58,981,276円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,586,742,215円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	3,122,915円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	33,641,239円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	22,450,380円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	69,600,892円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,745,503円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	28,730,510円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,478,665円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	539,804円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	359,935円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	63,171,451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>	13,391,496円
合計	4,117,357,156円

(2021年 9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,117,357,156円
同期中における追加設定元本額	2,548,310,516円
同期中における一部解約元本額	869,475,851円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	20,163,828円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,874,376円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,053,549,693円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,280,108円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,209,437円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,511,723円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	103,143,968円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,161,543円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,723,437円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,149,715円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	597,514円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	83,181,946円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	378,061円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	381,491円

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	802,404円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	47,609,004円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	13,755,435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>	34,135,132円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 - 0 5 (リスク3%)<適格機関投資家限定>	168,560,701円
合計	5,796,191,821円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	8,247	170,300.55	
		AGREE REALTY CORP	6,157	437,824.27	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758	153,947.24	
		ALEXANDER'S INC	136	34,586.16	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	12,331	2,459,417.95	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	4,195	164,192.30	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	11,944	599,111.04	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,155	87,231.45	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,269	983,622.57	
		AMERICOLD REALTY TRUST	22,508	794,757.48	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	13,986	705,174.12	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	15,893	108,867.05	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	18,468	279,051.48	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,848	63,605.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,708	2,850,277.32	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,485	48,438.00	

BOSTON PROPERTIES INC	13,106	1,446,640.28	
BRANDYWINE REALTY TRUST	15,153	202,292.55	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	26,434	615,119.18	
BROADSTONE NET LEASE INC	14,236	376,115.12	
BRT APARTMENTS CORP	500	9,620.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,903	1,345,510.39	
CARETRUST REIT INC	8,327	181,445.33	
CENTERSPACE	1,026	102,281.94	
CHATHAM LODGING TRUST	4,019	48,388.76	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,279	36,372.31	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	76,133.62	
CLIPPER REALTY INC	800	6,496.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	10,778	205,644.24	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,458	117,123.70	
COREPOINT LODGING INC	3,610	54,077.80	
CORESITE REALTY CORPORATION	3,791	561,030.09	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9,768	267,447.84	
COUSINS PROPERTIES INC	13,019	485,869.08	
CTO REALTY GROWTH INC	310	16,891.90	
CUBESMART	17,895	944,677.05	
CYRUSONE INC	10,806	827,307.36	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	18,176	162,493.44	
DIGITAL REALTY TRUST INC	25,663	3,957,491.23	
DIGITALBRIDGE GROUP INC-CLASS A	43,678	284,780.56	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	82,160.96	
DOUGLAS EMMETT INC	15,050	495,145.00	
DUKE REALTY CORP	33,991	1,718,924.87	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	7,057	148,338.14	
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,701	643,270.81	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,815	127,509.25	
EPR PROPERTIES	6,966	337,920.66	
EQUINIX INC	8,140	6,796,004.60	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	10,451	273,398.16	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	15,679	1,311,077.98	

EQUITY RESIDENTIAL	30,826	2,520,950.28	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	10,453	321,011.63	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,968	1,936,377.28	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,204	2,240,166.24	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666	58,604.96	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	6,291	754,542.54	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	11,641	628,846.82	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,728	182,799.76	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	6,015	27,729.15	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	19,719	949,864.23	
GEO GROUP INC	9,546	67,776.60	
GETTY REALTY CORPORATION	3,220	97,244.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,102	69,267.66	
GLADSTONE LAND CORP	1,730	39,149.90	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,403	67,718.14	
GLOBAL NET LEASE INC	8,273	137,993.64	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,994	365,337.24	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	19,297	592,031.96	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,364	1,710,634.68	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876	27,091.92	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,521	417,305.43	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	65,574	1,090,495.62	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	13,192	348,796.48	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	8,401	169,280.15	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	6,274	163,876.88	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,085	476,276.55	
INVITATION HOMES INC	51,098	2,073,556.84	
IRON MOUNTAIN INC	26,267	1,193,572.48	
JBG SMITH PROPERTIES	9,249	271,180.68	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	54,000	42,390.00	
KILROY REALTY CORP	10,021	654,872.35	
KIMCO REALTY CORPORATION	55,655	1,209,383.15	

KITE REALTY GROUP TRUST	7,036	144,800.88	
LEXINGTON REALTY TRUST	26,788	366,459.84	
LIFE STORAGE INC	6,748	826,562.52	
LTC PROPERTIES INC	3,325	111,786.50	
MACERICH COMPANY/THE	14,261	247,428.35	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	7,798	131,240.34	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	121,700	85,798.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	53,657	1,104,797.63	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	10,358	1,984,385.64	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	9,490	180,025.30	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	4,003	232,294.09	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,676	715,609.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	7,371	421,031.52	
NETSTREIT CORP	2,801	70,361.12	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,922	52,824.24	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	2,355	147,587.85	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	3,872	99,665.28	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	20,948	679,553.12	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,014	30,734.34	
PARAMOUNT GROUP INC	14,599	126,281.35	
PARK HOTELS AND RESORTS INC	20,703	394,806.21	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,678	255,981.76	
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	5,400	9,990.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	19,886	363,118.36	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	11,314	192,338.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,586	60,357.24	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	6,243	72,169.08	
PRIME US REIT	54,200	46,341.00	
PROLOGIS INC	67,155	8,901,395.25	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,747	274,086.83	
PUBLIC STORAGE	13,863	4,400,393.46	
REALTY INCOME CORPORATION	33,599	2,291,787.79	

REGENCY CENTERS CORP	14,082	950,675.82	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	9,864	172,718.64	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	19,526	251,690.14	
RETAIL VALUE INC	2,032	52,832.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	11,978	726,585.48	
RLJ LODGING TRUST	14,708	211,059.80	
RPT REALTY	6,346	80,721.12	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,944	408,423.84	
SABRA HEALTH CARE REIT	20,302	319,350.46	
SAFEHOLD INC	1,242	99,745.02	
SAUL CENTERS INC	894	39,711.48	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468	52,054.68	
SERVICE PROPERTIES TRUST	15,023	163,900.93	
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,889	3,872,418.84	
SITE CENTERS CORP	14,831	232,550.08	
SL GREEN REALTY CORP	6,241	425,573.79	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	10,678	530,162.70	
STAG INDUSTRIAL INC	15,122	629,075.20	
STORE CAPITAL CORP	21,664	748,491.20	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,721	89,044.36	
SUN COMMUNITIES INC	10,017	2,000,795.58	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	18,868	229,246.20	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	9,118	153,364.76	
TERRENO REALTY CORP	6,101	404,191.25	
UDR INC	27,387	1,464,109.02	
UMH PROPERTIES INC	3,698	89,565.56	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	1,344	77,723.52	
URBAN EDGE PROPERTIES	11,117	201,773.55	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	56,578.91	
VENTAS INC	34,433	1,976,109.87	
VEREIT INC	21,319	1,020,966.91	
VICI PROPERTIES INC	48,990	1,465,780.80	

	VORNADO REALTY TRUST	14,176	580,932.48	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,763	223,982.28	
	WELLTOWER INC	38,100	3,335,274.00	
	WHITESTONE REIT	4,511	44,117.58	
	WP CAREY INC	16,130	1,229,267.30	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	9,586	166,604.68	
	米ドル 小計	2,243,049	104,913,432.80 (11,503,757,906)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	5,481	230,366.43	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	60,948.54	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715	21,729.05	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,000	97,200.00	
	CAN APARTMENT PROP	7,389	450,433.44	
	CHOICE PROPERTIES REIT	14,769	219,762.72	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	7,925	83,529.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,710	67,447.80	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,551	80,552.70	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	8,986	152,762.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,169	49,713.48	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	9,313	167,913.39	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,770	257,277.60	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,949	213,399.52	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178	110,277.30	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,671	102,061.35	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447	33,628.28	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	27,667.89	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	8,645	115,237.85	
	PLAZA RETAIL REIT	8,509	38,545.77	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,635	352,569.25	
	SLATE GROCERY REIT	3,196	43,146.00	
	SLATE OFFICE REIT	3,663	19,633.68	

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,374	193,259.68
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,963	148,520.79
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	4,770	34,964.10
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	3,417	93,933.33
	カナダドル 小計	164,089	3,466,481.44 (299,365,337)
ユーロ	AEDIFICA	3,213	376,884.90
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	16,309	261,433.27
	ALTAREA	329	66,293.50
	BEFIMMO SCA	2,240	78,288.00
	CARE PROPERTY INVEST	2,707	75,796.00
	CARMILA	4,754	59,425.00
	COFINIMMO	2,741	367,019.90
	COVIVIO	4,314	327,346.32
	CROMWELL REIT EUR	27,720	73,458.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,371	67,757.10
	GECINA SA	4,842	601,376.40
	HAMBORNER REIT AG	6,236	58,244.24
	HIBERNIA REIT PLC	56,011	66,541.06
	ICADE	2,844	200,075.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798	17,488.71
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	22,528	199,034.88
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,884	46,817.40
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432	59,185.28
	KLEPIERRE	18,362	353,284.88
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	4,421	24,050.24
	MERCIALYS	3,772	35,324.78
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	30,219	282,487.21
	MONTEA NV	896	110,028.80
	NSI NV	1,995	66,333.75
	RETAIL ESTATES	963	63,076.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	12,685	847,865.40
	VASTNED RETAIL	1,505	34,916.00

	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,191	462,770.36
	WERELDHAVE NV	3,304	41,795.60
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,599	81,229.20
	ユーロ 小計	297,185	5,405,628.08 (699,866,667)
英bond	AEW UK REIT PLC	9,000	9,666.00
	ASSURA PLC	234,553	177,791.17
	BIG YELLOW GROUP PLC	14,536	212,516.32
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210	61,629.75
	BRITISH LAND CO PLC	83,293	431,124.56
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	69,586	116,347.79
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238	48,006.72
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999	38,479.03
	DERWENT LONDON PLC	9,845	362,985.15
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037	56,194.63
	GCP STUDENT LIVING PLC	43,019	91,200.28
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	25,609	196,805.16
	HAMMERSON PLC	380,846	127,202.56
	HOME REIT PLC	17,550	19,480.50
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	23,000	27,416.00
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	285.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	65,987	459,137.54
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	81,335	204,964.20
	LXI REIT PLC	49,506	71,684.68
	NEWRIVER REIT PLC	46,021	34,193.60
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	54,055.38
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	117,823	192,051.49
	REGIONAL REIT LTD	45,664	40,184.32
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	18,480	208,084.80
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70,698	35,490.39
	SEGRO PLC	110,080	1,405,721.60
	SHAFTESBURY PLC	27,317	167,862.96
	STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280	38,468.16
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	73,348	87,284.12
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	35,187.24

	TRITAX BIG BOX REIT PLC	149,824	353,284.99
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	58,562	44,624.24
	UNITE GROUP PLC	36,476	426,039.68
	WORKSPACE GROUP PLC	13,356	118,668.06
	英債券 小計	2,264,489	5,954,118.07 (901,393,934)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	32,980	118,398.20
	APN INDUSTRIA REIT	13,221	48,785.49
	ARENA REIT	28,622	120,212.40
	AVENTUS GROUP	35,000	117,600.00
	BWP TRUST	45,015	182,310.75
	CENTURIA CAPITAL GROUP	46,643	160,451.92
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,528	158,464.48
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559	109,333.09
	CHARTER HALL GROUP	40,904	720,728.48
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	47,301	250,695.30
	CHARTER HALL RETAIL REIT	42,995	168,540.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	33,955	126,312.60
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	139,671.84
	DEXUS	98,875	1,064,883.75
	GDI PROPERTY GROUP	43,204	50,116.64
	GOODMAN GROUP	151,215	3,403,849.65
	GPT GROUP	167,683	831,707.68
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	30,439	131,496.48
	HOME CONSORTIUM	16,399	126,272.30
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	40,492	64,787.20
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	15,921	56,360.34
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	27,812	177,440.56
	IRONGATE GROUP	42,404	64,878.12
	MIRVAC GROUP	352,526	1,071,679.04
	NATIONAL STORAGE REIT	91,680	216,364.80
	RURAL FUNDS GROUP	25,701	68,364.66
	SCENTRE GROUP	466,384	1,357,177.44
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	92,804	250,570.80

	STOCKLAND	213,660	970,016.40
	VICINITY CENTRES	336,355	576,848.82
	WAYPOINT REIT LTD	81,055	226,143.45
オーストラリアドル 小計		2,904,050	13,130,463.08 (1,053,063,139)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	83,275	137,403.75
	GOODMAN PROPERTY TRUST	91,963	239,103.80
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	131,684	154,070.28
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	110,983	187,006.35
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	36,063	111,795.30
ニュージーランドドル 小計		453,968	829,379.48 (64,459,373)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	170,000	712,300.00
	FORTUNE REIT	130,000	1,054,300.00
	LINK REIT	182,300	12,596,930.00
	PROSPERITY REIT	98,000	306,740.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110,000	545,600.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	176,000	681,120.00
香港ドル 小計		866,300	15,896,990.00 (224,147,559)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	38,300	54,003.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300	106,743.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	291,800	895,826.00
	ASCOTT TRUST	139,155	136,371.90
	CAPITALAND CHINA TRUST	83,000	107,070.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	406,708	821,550.16
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	69,050	79,407.50
	EC WORLD REIT	52,800	42,240.00
	ESR REIT	217,952	104,616.96
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600	61,752.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	176,400	46,746.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	116,900	267,701.00

	FRASERS HOSPITALITY TRUST	102,700	49,296.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	248,238	369,874.62	
	IREIT GLOBAL	57,600	36,576.00	
	KEPPEL DC REIT	109,500	278,130.00	
	KEPPEL REIT	202,900	217,103.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	57,600	50,112.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	321,700	17,050.10	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	193,200	401,856.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	167,600	475,984.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	252,150	519,429.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	167,200	168,872.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	107,008.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	39,600	188,100.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	104,800	45,064.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700	59,363.00	
	SPH REIT	74,600	68,632.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200	88,448.00	
	SUNTEC REIT	186,700	266,981.00	
	シンガポールドル 小計	4,543,153	6,131,906.24 (500,240,911)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	8,325	54,778,500.00	
	JR REIT XXVII	8,500	45,390,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	2,600	16,224,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522	70,373,640.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	5,000	23,500,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302	43,582,440.00	
	韓国ウォン 小計	42,249	253,848,580.00 (23,760,227)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	15,233	296,281.85	
	イスラエルシェケル 小計	15,233	296,281.85 (10,117,817)	
	合計		15,280,172,870 (15,280,172,870)	

（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 153銘柄	75.8%	75.3%
カナダドル	投資証券 27銘柄	2.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄	4.6%	4.6%
英ポンド	投資証券 34銘柄	5.9%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	6.9%	6.9%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	0.4%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	1.5%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	3.3%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 6銘柄	0.2%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	0.1%	0.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	486,061,247
コール・ローン	396,539,274	148,553,054
国債証券	104,311,002,360	111,262,905,020
地方債証券	8,894,942,430	9,309,564,450
特殊債券	12,902,314,589	11,463,696,995
社債券	5,659,432,000	4,849,856,000
未収入金	150,925,000	337,017,000
未収利息	460,030,466	430,082,162
前払費用	7,672,150	10,168,350
流動資産合計	132,782,858,269	138,297,904,278
資産合計	132,782,858,269	138,297,904,278
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	540,656,000
未払解約金	46,282,000	410,000
未払利息	948	383
その他未払費用	8,273	1,476

流動負債合計	146,291,221	541,067,859
負債合計	146,291,221	541,067,859
純資産の部		
元本等		
元本	103,559,131,437	107,296,279,211
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,077,435,611	30,460,557,208
元本等合計	132,636,567,048	137,756,836,419
純資産合計	132,636,567,048	137,756,836,419
負債純資産合計	132,782,858,269	138,297,904,278

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	103,559,131,437口	107,296,279,211口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2808円 (10,000口当たりの純資産額 12,808円)	1口当たり純資産額 1.2839円 (10,000口当たりの純資産額 12,839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 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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 9月15日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	111,291,274,213円

同期中における追加設定元本額	29,214,010,057円
同期中における一部解約元本額	36,946,152,833円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,417,910,131円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	9,352,829,017円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,998,420,713円
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)	730,795,894円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	46,082,897円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	181,230,371円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	374,855,441円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	438,441,370円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	177,137,533円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	308,707,190円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	129,925,576円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,337,900,462円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	382,833,387円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	16,075,994円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	21,159,651円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	840,868,379円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	253,096,548円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	361,732,503円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	76,188,990円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	21,255,805円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	65,668,552円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	27,950,990円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	57,969,369円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	12,852,515円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,598,454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>	5,903,494,951円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	15,408,583,398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>	6,719,111,006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>	16,611,697,542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>	316,664,963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>	567,607,238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>	1,942,066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>	243,859,822円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	117,573,504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>	1,922,462,329円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,101,626,336円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,539,043,379円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	9,356,692,074円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	1,655,317円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,358,855,987円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	465,048,141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>	619,590,284円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	179,522,478円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	43,699,763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>	1,688,140,285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 >	2,266,783,215円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	868,223,966円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	211,492,420円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	19,262,253円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	302,431,646円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,618,673,320円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	81,344,659円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	297,899,914円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	926,069,950円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	1,237,370,919円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,927,220,580円
合計	103,559,131,437円

(2021年 9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	103,559,131,437円
同期中における追加設定元本額	22,521,825,732円
同期中における一部解約元本額	18,784,677,958円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	6,460,445,852円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	11,448,337,963円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	2,614,840,289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)	729,407,076円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	43,884,113円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	195,944,976円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	468,973,163円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	674,885,416円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	319,844,376円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	461,952,707円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	141,487,997円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,523,302,649円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,185,930,120円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	494,355,889円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	41,016,697円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,618,467,794円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	543,175,156円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	815,757,476円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	178,903,993円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,210,475円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	120,859,694円
三井住友D S ・ 年金バランス3 0 (債券重点型)	102,416,811円
三井住友D S ・ 年金バランス5 0 (標準型)	177,326,252円

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	51,220,521円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,771,707円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,580,848,669円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	13,706,248,701円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,645,250,132円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,655,431,933円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	331,211,562円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	592,548,396円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	273,591,100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>	120,352,684円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,879,386,729円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,700,349円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,459,305,568円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,018,958,610円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	964,528円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,249,600,072円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	465,435,023円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	570,338,804円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	178,863,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,132,304円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,545,296,247円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,226,859,326円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	753,200,032円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	209,761,569円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,071,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	284,228,228円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,448,462,272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>	416,502,680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>	820,434,999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>	889,288,444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>	5,225,285,939円
合計	107,296,279,211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425回利付国債(2年)	2,120,000,000	2,125,066,800	
	第426回利付国債(2年)	50,000,000	50,125,500	
	第427回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,308,679,000	
	第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,463,000	
	第138回利付国債(5年)	600,000,000	603,126,000	
	第139回利付国債(5年)	260,000,000	261,502,800	
	第140回利付国債(5年)	600,000,000	603,816,000	
	第141回利付国債(5年)	795,000,000	800,525,250	
	第142回利付国債(5年)	760,000,000	765,722,800	
	第143回利付国債(5年)	770,000,000	776,098,400	
	第144回利付国債(5年)	1,250,000,000	1,260,612,500	
	第145回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,321,881,700	
	第146回利付国債(5年)	1,690,000,000	1,705,919,800	
	第147回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,709,231,000	
	第148回利付国債(5年)	510,000,000	512,805,000	
	第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,991,200	
	第2回利付国債(40年)	242,000,000	340,656,140	
	第3回利付国債(40年)	185,000,000	261,510,450	
	第4回利付国債(40年)	247,000,000	350,907,960	
	第5回利付国債(40年)	245,000,000	336,485,450	
	第6回利付国債(40年)	260,000,000	351,423,800	
	第7回利付国債(40年)	275,000,000	357,769,500	
	第8回利付国債(40年)	310,000,000	377,604,800	
	第9回利付国債(40年)	513,000,000	468,917,910	
	第10回利付国債(40年)	470,000,000	501,725,000	
	第11回利付国債(40年)	380,000,000	393,334,200	
	第12回利付国債(40年)	380,000,000	355,311,400	
	第13回利付国債(40年)	475,000,000	442,158,500	
	第14回利付国債(40年)	230,000,000	228,583,200	
	第329回利付国債(10年)	950,000,000	965,485,000	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,308,952,400		

第332回利付国債(10年)	793,000,000	806,028,990	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	829,857,450	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	321,366,150	
第335回利付国債(10年)	90,000,000	91,713,600	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	347,010,800	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	121,688,400	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	819,884,450	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	800,558,700	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	786,293,200	
第341回利付国債(10年)	557,000,000	567,014,860	
第342回利付国債(10年)	350,000,000	353,409,000	
第343回利付国債(10年)	310,000,000	313,186,800	
第344回利付国債(10年)	811,000,000	819,580,380	
第345回利付国債(10年)	758,000,000	766,421,380	
第346回利付国債(10年)	740,000,000	748,399,000	
第347回利付国債(10年)	800,000,000	809,496,000	
第348回利付国債(10年)	345,000,000	349,171,050	
第349回利付国債(10年)	370,000,000	374,543,600	
第350回利付国債(10年)	550,000,000	556,836,500	
第351回利付国債(10年)	380,000,000	384,776,600	
第352回利付国債(10年)	790,000,000	800,301,600	
第353回利付国債(10年)	640,000,000	648,409,600	
第354回利付国債(10年)	835,000,000	846,030,350	
第355回利付国債(10年)	810,000,000	820,740,600	
第356回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,083,770,900	
第357回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,083,310,800	
第358回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,113,145,000	
第359回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,072,094,600	
第360回利付国債(10年)	1,560,000,000	1,576,177,200	
第361回利付国債(10年)	990,000,000	999,167,400	
第362回利付国債(10年)	930,000,000	937,495,800	
第363回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,550,487,400	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	615,519,000	
第4回利付国債(30年)	340,000,000	430,888,800	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	351,039,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	586,608,180	

第9回利付国債(30年)	240,000,000	275,198,400	
第10回利付国債(30年)	535,000,000	596,535,700	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	509,958,500	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	729,611,700	
第14回利付国債(30年)	692,000,000	886,403,560	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	605,225,400	
第18回利付国債(30年)	540,000,000	693,241,200	
第19回利付国債(30年)	470,000,000	604,998,100	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	446,688,750	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	418,020,750	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	437,790,430	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	413,605,100	
第25回利付国債(30年)	380,000,000	497,062,800	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	481,661,070	
第27回利付国債(30年)	420,000,000	566,785,800	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	523,678,480	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	238,316,340	
第30回利付国債(30年)	442,000,000	590,016,960	
第31回利付国債(30年)	325,000,000	429,780,000	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	524,460,300	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	489,608,280	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	610,264,090	
第35回利付国債(30年)	350,000,000	456,291,500	
第36回利付国債(30年)	90,000,000	117,737,100	
第37回利付国債(30年)	355,000,000	459,096,650	
第38回利付国債(30年)	360,000,000	459,806,400	
第39回利付国債(30年)	300,000,000	389,685,000	
第40回利付国債(30年)	270,000,000	345,419,100	
第41回利付国債(30年)	270,000,000	340,005,600	
第42回利付国債(30年)	260,000,000	327,758,600	
第43回利付国債(30年)	305,000,000	384,897,800	
第44回利付国債(30年)	300,000,000	378,984,000	
第45回利付国債(30年)	325,000,000	396,854,250	
第46回利付国債(30年)	315,000,000	384,901,650	
第47回利付国債(30年)	340,000,000	423,470,000	
第48回利付国債(30年)	405,000,000	486,789,750	

第49回利付国債(30年)	345,000,000	414,869,400	
第50回利付国債(30年)	335,000,000	356,550,550	
第51回利付国債(30年)	345,000,000	326,915,100	
第52回利付国債(30年)	353,000,000	350,271,310	
第53回利付国債(30年)	247,000,000	250,571,620	
第54回利付国債(30年)	45,000,000	47,729,700	
第55回利付国債(30年)	325,000,000	344,496,750	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	455,494,700	
第57回利付国債(30年)	355,000,000	375,792,350	
第58回利付国債(30年)	420,000,000	443,776,200	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	412,552,000	
第60回利付国債(30年)	380,000,000	410,312,600	
第61回利付国債(30年)	345,000,000	354,742,800	
第62回利付国債(30年)	125,000,000	122,047,500	
第63回利付国債(30年)	360,000,000	341,647,200	
第64回利付国債(30年)	325,000,000	307,567,000	
第65回利付国債(30年)	325,000,000	307,066,500	
第66回利付国債(30年)	310,000,000	292,413,700	
第67回利付国債(30年)	310,000,000	307,733,900	
第68回利付国債(30年)	360,000,000	356,911,200	
第69回利付国債(30年)	350,000,000	356,051,500	
第70回利付国債(30年)	360,000,000	365,814,000	
第71回利付国債(30年)	370,000,000	375,080,100	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,066,840,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,066,695,600	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,076,926,200	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	834,522,000	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	803,631,720	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	712,359,120	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	528,308,200	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	634,999,300	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	675,471,400	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	926,959,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	709,719,300	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	827,545,180	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	22,210,000	

第90回利付国債(20年)	580,000,000	647,343,800	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	819,606,420	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	705,488,960	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	347,398,050	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	770,926,980	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	788,543,910	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	237,946,500	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	412,719,450	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	534,196,440	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	449,943,000	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	429,477,500	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	438,015,060	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	446,226,300	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	390,544,400	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	454,175,320	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	501,242,490	
第114回利付国債(20年)	263,000,000	309,900,790	
第116回利付国債(20年)	100,000,000	119,120,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	235,654,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	342,409,450	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	228,628,000	
第121回利付国債(20年)	55,000,000	64,503,450	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	384,044,100	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	95,556,800	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	225,188,000	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	247,521,100	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	213,919,200	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	170,946,300	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	76,864,450	
第130回利付国債(20年)	155,000,000	182,290,850	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	443,118,000	
第132回利付国債(20年)	450,000,000	526,059,000	
第133回利付国債(20年)	190,000,000	224,055,600	
第134回利付国債(20年)	200,000,000	236,458,000	
第135回利付国債(20年)	155,000,000	181,635,200	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	139,366,800	

第137回利付国債(20年)	25,000,000	29,367,000	
第139回利付国債(20年)	20,000,000	23,280,000	
第140回利付国債(20年)	340,000,000	400,336,400	
第141回利付国債(20年)	200,000,000	236,024,000	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	131,040,800	
第143回利付国債(20年)	190,000,000	222,674,300	
第144回利付国債(20年)	90,000,000	104,452,200	
第145回利付国債(20年)	110,000,000	130,454,500	
第146回利付国債(20年)	145,000,000	172,329,600	
第147回利付国債(20年)	220,000,000	259,340,400	
第148回利付国債(20年)	309,000,000	361,319,880	
第149回利付国債(20年)	675,000,000	790,566,750	
第150回利付国債(20年)	261,000,000	302,827,860	
第151回利付国債(20年)	690,000,000	783,681,300	
第152回利付国債(20年)	295,000,000	335,338,300	
第153回利付国債(20年)	267,000,000	307,562,640	
第154回利付国債(20年)	580,000,000	660,846,200	
第155回利付国債(20年)	410,000,000	456,108,600	
第156回利付国債(20年)	420,000,000	431,230,800	
第157回利付国債(20年)	415,000,000	413,813,100	
第158回利付国債(20年)	360,000,000	374,374,800	
第159回利付国債(20年)	418,000,000	440,475,860	
第160回利付国債(20年)	355,000,000	379,129,350	
第161回利付国債(20年)	350,000,000	368,291,000	
第162回利付国債(20年)	250,000,000	262,862,500	
第163回利付国債(20年)	490,000,000	514,784,200	
第164回利付国債(20年)	415,000,000	429,064,350	
第165回利付国債(20年)	490,000,000	506,037,700	
第166回利付国債(20年)	295,000,000	314,095,350	
第167回利付国債(20年)	490,000,000	504,837,200	
第168回利付国債(20年)	330,000,000	333,821,400	
第169回利付国債(20年)	400,000,000	396,984,000	
第170回利付国債(20年)	415,000,000	411,132,200	
第171回利付国債(20年)	425,000,000	420,269,750	
第172回利付国債(20年)	520,000,000	522,698,800	
第173回利付国債(20年)	515,000,000	516,802,500	

	第174回利付国債(20年)	500,000,000	500,880,000	
	第175回利付国債(20年)	515,000,000	524,676,850	
	第176回利付国債(20年)	540,000,000	549,271,800	
	第177回利付国債(20年)	450,000,000	448,767,000	
国債証券合計		102,652,000,000	111,262,905,020	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,712,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,440,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,059,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	521,040,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	639,600,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	100,532,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	100,613,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,602,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,148,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,480,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	300,000,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	107,180,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,026,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,068,000	
	第13回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,623,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	201,426,000	
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,601,000	
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,537,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,078,000	
	平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,156,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	325,425,000	
	第10回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	118,246,000	
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	129,966,000	
	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	108,774,000	
	平成22年度第8回愛知県公募公債(20年)	200,000,000	232,350,000	
	平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	200,006,000	
	平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	101,699,000	
	平成26年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,656,000	
	平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,562,000	
	平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,468,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	100,951,000		

	第1 1 1 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,368,000	
	第1 1 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,077,000	
	第1 1 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,723,000	
	第1 1 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,832,000	
	第1 1 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,764,000	
	第1 1 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
	第1 3 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,324,000	
	第1 7 2 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,840,000	
	第1 8 3 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,452,000	
	第1 回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	209,088,000	
	第3 回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	107,715,000	
	第5 回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	111,546,000	
	第1 回京都市公募公債(30年)	100,000,000	134,549,000	
	第7 回京都市公募公債(20年)	100,000,000	116,286,000	
	平成29年度第5 回京都市公募公債	100,000,000	100,054,000	
	平成26年度第17 回神戸市公募公債	100,000,000	100,942,000	
	第4 回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	107,141,000	
	第9 回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,202,000	
	第14 回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,780,000	
	平成26年度第3 回横浜市公募公債	200,000,000	203,340,000	
	第47 回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,047,000	
	平成26年度第4 回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,491,000	
	平成24年度第2 回北九州市公募公債	100,000,000	100,901,000	
	平成23年度第9 回福岡市公募公債	147,000,000	147,786,450	
	平成29年度第11 回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,156,000	
地方債証券合計		8,697,000,000	9,309,564,450	
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	209,502,000	
	第3 4 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,036,000	
	第3 6 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,320,000	
	第9 回道路債券	100,000,000	128,622,000	
	第1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,624,000	
	第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	438,843,000	
	第2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,809,000	
	第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	347,430,000	
	第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,254,000	

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	232,088,000	
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	132,815,000	
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	349,902,000	
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	118,128,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	404,256,000	
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	116,354,000	
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	118,709,000	
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	232,820,000	
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	203,246,000	
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	304,662,000	
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	189,003,780	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	116,807,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	101,545,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,218,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,728,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,088,000	
第20回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,109,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,025,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	229,346,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,951,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,272,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,878,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,044,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,669,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,478,000	
第101回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,097,000	
第106回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,016,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	101,807,000	

第5 1 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,028,000	
第3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	9,609,000	9,617,936	
第4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,529,000	11,792,552	
第5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	9,969,000	9,980,165	
第7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,994,000	13,450,089	
第9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	22,098,000	22,480,295	
第9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,213,000	13,760,546	
第1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	34,314,000	35,067,535	
第1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,980,000	13,412,493	
第1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,983,000	14,635,446	
第1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,150,000	20,287,221	
第1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,789,000	17,729,855	
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,716,000	36,905,885	
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,487,000	56,595,664	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,507,000	20,707,070	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,164,000	22,517,861	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,547,000	10,639,602	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,762,000	25,439,834	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,408,000	25,038,835	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,803,000	12,012,739	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,118,000	48,938,115	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,658,000	13,020,145	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,602,000	25,075,472	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,922,000	24,224,198	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,426,000	11,654,520	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,357,000	12,729,563	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,396,000	24,029,095	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,298,000	31,029,218	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,584,000	24,968,380	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,704,000	47,197,589	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,443,000	23,634,050	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,353,000	11,636,370	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,720,000	53,345,774	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,719,000	

第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,084,000	12,434,919	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,276,000	76,256,239	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,440,000	36,333,166	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,125,000	40,251,231	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,730,000	77,925,237	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,112,000	119,115,984	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,823,000	38,658,994	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,464,000	44,399,933	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,892,000	90,642,686	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,798,000	78,591,006	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,585,000	44,973,166	
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,532,000	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,558,000	66,007,525	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,695,000	82,949,018	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,636,000	82,669,511	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,855,000	82,888,828	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,265,000	84,190,074	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,515,000	83,548,912	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,023,000	85,285,025	
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	234,428,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,982,000	88,402,416	
第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,392,000	99,662,240	
第226回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,091,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,302,000	22,710,349	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,938,000	25,683,895	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,966,000	12,260,363	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,559,000	11,797,577	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,222,000	25,938,809	
い第810号農林債	300,000,000	300,285,000	
第12回国際協力機構債券	100,000,000	100,678,000	
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,896,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,366,000	
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,477,000	
第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,564,000	
特殊債券合計	10,665,840,000	11,463,696,995	

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	201,080,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,512,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	200,000,000	199,716,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,834,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,250,000	
	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	100,995,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,431,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,584,000	
	第22回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,565,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,269,000	
	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	113,663,000	
	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	101,270,000	
	第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,579,000	
	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	101,287,000	
	第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	110,460,000	
	第17回NTTファイナンス株式会社無担保社 債	200,000,000	201,254,000	
	第93回トヨタファイナンス株式会社無担保社 債	400,000,000	401,488,000	
	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	100,107,000	
	第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	126,777,000	
	第135回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,498,000	
	第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,713,000	
	第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	100,000,000	121,801,000	
	第169回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	200,000,000	199,428,000	
	第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,445,000	
	第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,903,000	
	第45回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
	第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,203,000	
	第546回中部電力株式会社社債	200,000,000	199,924,000	
	第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,141,000	

第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	203,514,000	
第37回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,430,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,400,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,668,000	
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	101,304,000	
社債券合計	4,700,000,000	4,849,856,000	
合計		136,886,022,465	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	312,980,466	115,651,826
金銭信託	-	445,214,856
コール・ローン	436,715,832	136,069,327
国債証券	164,241,584,009	158,592,169,610
未収入金	1,000,000	-
未収利息	964,840,721	875,129,168
前払費用	31,156,429	26,157,612
流動資産合計	165,988,277,457	160,190,392,399
資産合計	165,988,277,457	160,190,392,399
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,890,000	106,728,032
未払利息	1,044	351
その他未払費用	12,488	1,413
流動負債合計	19,903,532	106,729,796
負債合計	19,903,532	106,729,796
純資産の部		
元本等		
元本	86,672,161,351	81,268,533,582
剰余金		
剰余金又は欠損金()	79,296,212,574	78,815,129,021
元本等合計	165,968,373,925	160,083,662,603
純資産合計	165,968,373,925	160,083,662,603
負債純資産合計	165,988,277,457	160,190,392,399

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	86,672,161,351口	81,268,533,582口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9149円 (10,000口当たりの純資産額 19,149円)	1口当たり純資産額 1.9698円 (10,000口当たりの純資産額 19,698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 9月16日 至 2021年 9月15日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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 9月15日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	85,315,961,664円

同期中における追加設定元本額	21,890,938,105円
同期中における一部解約元本額	20,534,738,418円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	22,731,151,256円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	658,594,713円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,773,832,616円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	886,639,369円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	135,734,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,442,392円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,932,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	89,355,084円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	147,123,191円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	87,219,265円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	169,760,535円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,583,939円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	151,930,417円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	177,017,525円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	117,322,530円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	8,504,435円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	49,486,241円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	29,259,182円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	68,781,313円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	21,896,060円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,152,323円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	58,321,950円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	59,325,052円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	3,401,354円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	11,013,159円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	5,718,420円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,437,654円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,325,407,859円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	62,516,303円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	8,969,125,020円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,882,034,678円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	11,081,288,238円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,927,566円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	92,654,350円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	364,139円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	667,821,535円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	117,038,834円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,130,698,774円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,406,378,119円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,693,637,685円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	5,375,225,533円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	1,096,475円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	8,991,550,157円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	372,710,683円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	155,672,719円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	94,741,730円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	35,684,638円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	12,403,524円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	114,449,543円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	457,949,726円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	131,485,417円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	41,665,026円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,430,860円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,136,440,664円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	5,422,002円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,418,321,803円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,193,432,057円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	5,014,430,246円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	523,340,928円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	62,703,933円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	53,516,287円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	188,026,035円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	251,064,556円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,054,566,362円
合計	86,672,161,351円

(2021年 9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	86,672,161,351円
同期中における追加設定元本額	8,945,685,891円
同期中における一部解約元本額	14,349,313,660円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,375,165,327円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	761,022,261円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,128,168,842円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,134,090,695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)	112,000,859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)	7,016,735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)	30,488,397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)	99,555,827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)	206,938,212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)	140,095,839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)	239,826,544円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,471,452円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	60,371,045円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	81,937,511円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	56,724,347円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	16,102,594円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	58,265,762円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	42,748,577円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	104,100,384円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	28,182,434円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	14,002,349円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	104,754,567円
三井住友D S ・外国債券インデックス年金ファンド	200,219,110円
三井住友D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	12,106,933円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	32,803,570円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	22,150,867円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	2,248,880円
日興F W S ・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	504,541円
三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド	3,210,021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>	2,310,597,405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>	45,899,893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>	7,801,603,636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>	4,694,680,423円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	10,840,471,131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>	35,901,694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>	95,696,295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>	733,010,223円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749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>	1,068,564,548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>	1,431,714,372円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,598,287,873円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	5,023,496,861円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	622,437円
S M A M ・外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	8,421,225,670円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	341,011,119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>	151,272,369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>	85,197,734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>	34,472,321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>	11,926,289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>	101,951,512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>	438,469,208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>	112,773,770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>	40,181,590円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,263,229円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	1,073,075,999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>	684,038,861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>	999,642,200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>	1,449,959,893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>	451,612,674円
S M A M ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定>	16,664,143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>	102,290,689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>	251,915,932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>	274,112,391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>	324,022,967円
合計	81,268,533,582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	1,799,789.05	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,292,609.37	
		US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,985,312.48	
		US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,685,082.01	
		US TREASURY N/B 0.125	7,700,000.00	7,664,207.01	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,005,664.05	
		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,706,015.62	
		US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	2,997,773.43	
		US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,367,656.25	
		US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,254,753.89	
		US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,968,828.12	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,977,734.39	
		US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,975,546.88	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,960,976.57	
		US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,557,531.25	
		US TREASURY N/B 0.375	7,800,000.00	7,542,234.41	
		US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,497,187.50	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,939,296.89	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,933,789.07	

US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,300,140.63	
US TREASURY N/B 0.625	3,600,000.00	3,573,984.38	
US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,481,425.78	
US TREASURY N/B 0.625	2,100,000.00	2,056,851.57	
US TREASURY N/B 0.625	7,200,000.00	7,041,375.00	
US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	7,138,769.55	
US TREASURY N/B 0.625	8,800,000.00	8,355,187.54	
US TREASURY N/B 0.75	6,700,000.00	6,599,238.29	
US TREASURY N/B 0.875	7,000,000.00	6,780,156.25	
US TREASURY N/B 1	3,200,000.00	3,187,250.01	
US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,530,351.57	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,029,843.76	
US TREASURY N/B 1.125	8,500,000.00	8,404,042.99	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,059,296.89	
US TREASURY N/B 1.25	2,200,000.00	2,193,468.74	
US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	4,400,941.41	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,053,906.24	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,051,562.50	
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	510,820.31	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,556,152.35	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,068,906.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,028,867.19	
US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,674,648.44	
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,004,121.10	
US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,549,355.46	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,058,359.39	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,060,351.57	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,064,609.38	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,034,882.81	
US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,611,445.33	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,014,375.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,560,292.96	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,074,531.24	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,069,257.82	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,074,648.43	

US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,086,835.93	
US TREASURY N/B 1.625	4,700,000.00	4,884,695.33	
US TREASURY N/B 1.625	14,950,000.00	15,548,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,060,113.29	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,124,335.93	
US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,614,441.42	
US TREASURY N/B 1.625	1,100,000.00	1,135,921.87	
US TREASURY N/B 1.625	3,200,000.00	3,027,500.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,050,390.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,065,390.64	
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,769,398.45	
US TREASURY N/B 1.75	6,200,000.00	6,437,585.92	
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	883,136.72	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,515,687.51	
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,186,093.76	
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,880,062.51	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,058,945.32	
US TREASURY N/B 1.875	2,800,000.00	2,919,000.00	
US TREASURY N/B 1.875	5,800,000.00	5,819,031.25	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,573,144.54	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,112,304.70	
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,898,414.07	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,086,250.00	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,444,890.62	
US TREASURY N/B 2	4,100,000.00	4,284,980.47	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,674,316.41	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,532,132.83	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,300,976.55	
US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,891,875.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,101,484.38	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,101,093.76	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,225,816.41	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,088,750.00	
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,792,500.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,671,445.33	

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,204,531.24	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,894,992.19	
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,175,816.39	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,134,062.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,301,664.06	
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	3,988,960.92	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,583,613.28	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,655,113.29	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,278,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,262,968.76	
US TREASURY N/B 2.25	13,300,000.00	14,207,621.11	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,724,156.27	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,522,875.00	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,740,484.36	
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	3,082,898.43	
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,805,429.70	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,236,375.00	
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,885,433.60	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,917,406.26	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,305,589.85	
US TREASURY N/B 2.375	4,100,000.00	4,475,085.95	
US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	2,122,507.82	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,217,773.45	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,023,519.51	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,627,507.80	
US TREASURY N/B 2.5	8,500,000.00	9,169,707.01	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,625,152.35	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,281,417.97	
US TREASURY N/B 2.5	3,600,000.00	4,076,718.76	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,142,500.00	
US TREASURY N/B 2.625	1,900,000.00	2,000,640.62	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,468,367.19	
US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,761,453.13	
US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,925,070.32	
US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,208,921.87	

US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,019,964.85	
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,043,398.44	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,095,859.38	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	3,987,476.57	
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,423,945.30	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,398,230.45	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,153,203.12	
US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	4,971,953.14	
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,274,562.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,325,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,340,312.50	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	350,976.56	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,516,953.14	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,785,175.78	
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,055,351.56	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,115,078.12	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,383,218.75	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,192,125.00	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,728,515.62	
US TREASURY N/B 2.875	9,000,000.00	10,079,648.46	
US TREASURY N/B 2.875	500,000.00	560,976.56	
US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,865,281.25	
US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,455,031.25	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,364,578.11	
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,715,601.56	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,376,875.00	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,394,984.37	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	972,437.50	
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,286,132.83	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,684,609.39	
US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,326,167.96	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,099,511.72	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,731,695.31	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,860,105.46	
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,734,179.67	

	US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,757,125.00	
	US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,792,757.80	
	US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,360,906.25	
	US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,239,609.38	
	US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,851,550.78	
	US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	4,116,750.00	
	US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	3,058,031.25	
	US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,882,421.89	
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,130,507.82	
	US TREASURY N/B 3.5	200,000.00	258,296.87	
	US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,202,218.74	
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,821,328.11	
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	2,017,734.37	
	US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	952,464.84	
	US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	679,531.25	
	US TREASURY N/B 4.25	300,000.00	423,187.50	
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	854,765.62	
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	1,004,390.62	
	US TREASURY N/B 4.375	900,000.00	1,297,125.00	
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	435,398.43	
	US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	436,031.25	
	US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	887,953.12	
	US TREASURY N/B 4.75	900,000.00	1,363,851.56	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	645,156.25	
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	439,150.00	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	649,765.62	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,232,187.50	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,311,953.13	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	892,687.50	
	米ドル 小計	625,520,000.00	663,911,638.52	(72,797,911,163)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	800,000.00	793,032.00	
	CANADA-GOV'T 1	2,800,000.00	2,819,684.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,600,000.00	1,610,160.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	5,600,000.00	5,663,000.00	

	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,039,300.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,026,940.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	2,994,105.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,123,023.00
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,237,092.00
	CANADA-GOV'T 2	1,700,000.00	1,814,682.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,043,080.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,481,466.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,200,375.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,211,405.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,348,721.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	635,295.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,770,392.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,113,425.00
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,168,272.00
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	337,255.00
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	738,170.00
	カナダドル 小計	32,900,000.00	36,168,874.00 (3,123,543,958)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	35,478,758.40
	MEXICAN BONOS 5.75	15,000,000.00	14,521,743.75
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,847,105.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,053,390.00
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	18,890,820.00
	MEXICAN BONOS 8	34,000,000.00	35,506,723.60
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,215,692.50
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	25,172,377.60
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,842,548.00
	メキシコペソ 小計	193,000,000.00	205,529,158.85 (1,132,362,900)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	715,950.00
	BELGIAN 0.1	700,000.00	717,703.00
	BELGIAN 0.4	300,000.00	295,998.00
	BELGIAN 0.8	800,000.00	843,904.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,075,330.00
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,081,790.00

BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,537,965.00	
BELGIAN 0304 5	1,000,000.00	1,656,180.00	
BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,045,964.00	
BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	864,983.00	
BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,787,601.00	
BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,579,080.00	
BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,512,221.00	
BELGIAN 0333 3	200,000.00	273,486.00	
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,036,760.00	
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	721,925.00	
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	471,400.00	
BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,420,926.00	
BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	623,245.00	
BELGIAN 0353 0.65	600,000.00	529,320.00	
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,505,182.00	
BELGIAN 1	1,000,000.00	1,108,440.00	
BELGIAN 1.25	400,000.00	457,676.00	
BELGIAN 1.6	850,000.00	1,032,146.50	
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,253,560.00	
BELGIAN 2.15	500,000.00	732,525.00	
BELGIAN 3.75	800,000.00	1,357,616.00	
BTPS 0.35	2,700,000.00	2,754,945.00	
BTPS 0.5	1,000,000.00	1,025,760.00	
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,046,220.00	
BTPS 0.85	1,700,000.00	1,771,893.00	
BTPS 0.9	1,200,000.00	1,233,180.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,042,120.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,043,160.00	
BTPS 0.95	800,000.00	838,320.00	
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,865,898.00	
BTPS 1.25	800,000.00	851,592.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,039,300.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,899,270.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,061,100.00	
BTPS 1.45	200,000.00	211,038.00	

BTPS 1.5	2,700,000.00	2,871,288.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,293,348.00	
BTPS 1.65	2,200,000.00	2,413,642.00	
BTPS 1.65	700,000.00	766,836.00	
BTPS 1.7	1,500,000.00	1,518,120.00	
BTPS 1.85	3,000,000.00	3,176,430.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,077,030.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,417,039.00	
BTPS 2	3,900,000.00	4,347,603.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,669,065.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,102,860.00	
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,576,874.00	
BTPS 2.25	500,000.00	581,890.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,299,958.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,069,263.00	
BTPS 2.5	600,000.00	653,736.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,332,092.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,923,844.50	
BTPS 2.8	300,000.00	353,436.00	
BTPS 2.8	600,000.00	732,120.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,649,232.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,210,395.00	
BTPS 3.1	900,000.00	1,166,778.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	2,034,480.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,104,073.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,968,022.00	
BTPS 3.5	4,400,000.00	5,513,904.00	
BTPS 3.75	1,500,000.00	1,680,870.00	
BTPS 3.85	900,000.00	1,354,752.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,651,934.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,487,864.00	
BTPS 4.5	1,000,000.00	1,120,470.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,170,332.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,746,950.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,614,960.00	

BTPS 4.75	1,600,000.00	2,629,472.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,182,640.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,095,933.40	
BTPS 5	1,800,000.00	2,885,508.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,757,910.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,269,216.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,135,380.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,624,154.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,320,658.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,356,387.00	
BTPS 7.25	400,000.00	549,396.00	
BTPS 9	300,000.00	360,357.00	
BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,590,440.00	
BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,015,360.00	
BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,922,287.00	
BUNDESOBL-178 0	1,600,000.00	1,625,136.00	
BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,324,895.00	
BUNDESOBL-180 0	1,100,000.00	1,125,388.00	
BUNDESOBL-182 0	1,800,000.00	1,852,380.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,639,055.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,351,454.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,800,000.00	3,947,022.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,100,000.00	2,141,622.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,100,000.00	2,968,498.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	3,987,606.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	900,000.00	951,597.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,300,000.00	3,495,129.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,606,950.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,100,000.00	3,266,253.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,629,364.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,100,000.00	2,249,919.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,367,080.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,190,035.50	
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,151,385.50	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,167,893.00	

DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,348,893.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,600,000.00	3,818,592.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,334,640.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,106,720.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,462,844.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,500,000.00	4,024,500.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	700,000.00	1,184,253.00	
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	2,969,838.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,699,322.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,195,744.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	600,000.00	996,480.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,174,352.50	
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,413,054.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,403,660.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,396,056.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	788,725.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,424,530.00	
FINNISH GOV'T 0.25	300,000.00	300,717.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	425,296.00	
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	851,952.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	545,420.00	
FINNISH GOV'T 1.375	300,000.00	379,029.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,036,330.00	
FINNISH GOV'T 1.625	800,000.00	819,040.00	
FINNISH GOV'T 2	600,000.00	642,996.00	
FINNISH GOV'T 2.625	1,000,000.00	1,492,360.00	
FINNISH GOV'T 2.75	400,000.00	488,540.00	
FINNISH GOV'T 4	600,000.00	708,492.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,021,440.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,930,495.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,067,520.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,940,888.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,100,000.00	3,174,493.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,576,860.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,900,000.00	3,939,429.00	

FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,493,552.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	739,935.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,019,596.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,671,360.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,965,508.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,548,556.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,000,000.00	2,155,520.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,700,000.00	2,680,074.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,187,001.50	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,708,175.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,729,208.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	3,400,000.00	3,881,780.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	2,550,000.00	2,943,745.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,882,328.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,374,972.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,800,382.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,800,000.00	2,237,130.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,054,016.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,200,000.00	2,917,046.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	1,962,510.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,669,824.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,326,735.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,850,000.00	4,611,029.50	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,700,000.00	2,715,597.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	2,972,025.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,227,240.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,671,787.70	
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,860,284.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,421,240.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,300,000.00	4,062,168.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,567,212.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	3,980,240.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	800,000.00	1,313,744.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	3,823,080.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	689,466.00	

IRISH GOVT 0	400,000.00	402,800.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	758,275.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,071,940.00	
IRISH GOVT 1.1	1,600,000.00	1,766,192.00	
IRISH GOVT 1.3	600,000.00	685,038.00	
IRISH GOVT 1.35	500,000.00	568,845.00	
IRISH GOVT 1.5	500,000.00	600,360.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	363,189.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,318,150.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	735,126.00	
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	550,815.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	534,760.00	
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	969,160.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,017,140.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,900,000.00	1,951,091.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,760,826.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	500,000.00	524,975.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,793,789.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,840,369.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	430,920.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,500,000.00	1,627,200.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,673,888.00	
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,078,200.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	600,000.00	784,476.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	1,984,872.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	500,000.00	530,145.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,266,134.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,800,000.00	2,917,728.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	970,627.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,115,444.00	
REP OF AUSTRIA 0	900,000.00	916,254.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	846,224.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	550,000.00	583,418.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	960,651.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	753,431.00	

REP OF AUSTRIA 0.75	1,100,000.00	1,176,637.00	
REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	146,917.50	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,077,270.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	274,928.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	881,972.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	800,000.00	859,752.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,053,260.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,168,983.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	971,754.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	900,000.00	944,280.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,505,280.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	500,000.00	808,830.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	626,205.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,402,260.00	
SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,017,220.00	
SPANISH GOV'T 0.25	700,000.00	715,834.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	506,220.00	
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,034,100.00	
SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	423,948.00	
SPANISH GOV'T 1	300,000.00	284,892.00	
SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	525,940.00	
SPANISH GOV'T 1.25	3,000,000.00	3,294,960.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,929,311.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,200,000.00	2,423,542.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,767,312.00	
SPANISH GOV'T 1.45	400,000.00	371,100.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,864,056.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,224,713.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,320,696.00	
SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,830,645.00	
SPANISH GOV'T 1.85	2,700,000.00	3,154,680.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,881,684.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,974,669.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,659,800.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,223,270.00	

	SPANISH GOV'T 2.7	1,250,000.00	1,709,112.50	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,318,127.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,967,700.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,753,983.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,561,546.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,514,088.50	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,214,640.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,161,674.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,550,840.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,387,510.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,583,105.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,063,430.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,865,920.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,437,627.50	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,375,235.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	654,060.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,191,628.00	
	ユーロ 小計	416,740,000.00	493,545,090.60 (63,899,282,879)	
英bond	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	700,000.00	
	UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,486,080.00	
	UK TSY GILT 0.375	2,000,000.00	1,947,760.00	
	UK TSY GILT 0.625	800,000.00	810,616.00	
	UK TSY GILT 0.625	600,000.00	575,862.00	
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,679,706.50	
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,023,000.00	
	UK TSY GILT 1	800,000.00	816,592.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,200,000.00	1,257,600.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,300,000.00	1,372,670.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,871,615.00	
	UK TSY GILT 1.625	1,800,000.00	1,942,272.00	
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	583,780.00	
	UK TSY GILT 1.75	900,000.00	914,922.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,337,892.00	
	UK TSY GILT 1.75	850,000.00	992,035.00	

	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,174,888.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,811,726.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,504,928.00	
	UK TSY GILT 2.75	600,000.00	645,072.00	
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,300,384.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,487,012.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,879,337.50	
	UK TSY GILT 3.75	1,200,000.00	2,062,416.00	
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,363,280.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,726,802.00	
	UK TSY GILT 4.25	700,000.00	951,944.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,527,351.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,250,000.00	1,924,062.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,037,217.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,561,025.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,608,399.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,302,335.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,593,944.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,244,348.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,571,843.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,924,356.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,513,031.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	903,006.00	
	英債券 小計	49,650,000.00	65,931,109.50 (9,981,310,667)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,183,280.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	6,000,000.00	6,286,080.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	5,900,000.00	6,221,432.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,269,360.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,493,700.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,853,080.00	
	スウェーデンクローナ 小計	32,500,000.00	36,306,932.00 (462,187,244)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,008,760.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,559,675.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,074,640.00	

	NORWEGIAN GOV'T 1.75	4,200,000.00	4,347,630.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,091,720.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,443,250.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,206,760.00	
ノルウェークローネ 小計		29,700,000.00	30,732,435.00	(389,379,951)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,251,510.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	10,100,000.00	10,623,180.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,226,800.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	6,000,000.00	6,272,100.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,552,600.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	9,800,000.00	17,408,720.00	
デンマーククローネ 小計		37,200,000.00	46,334,910.00	(806,690,783)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	2,400,000.00	2,381,544.60	
	POLAND GOVT BOND 0.75	6,100,000.00	6,060,655.00	
	POLAND GOVT BOND 1.25	1,800,000.00	1,709,946.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,900,000.00	5,044,109.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,707,180.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	6,000,000.00	6,465,480.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	5,300,000.00	5,707,252.00	
ポーランドズロチ 小計		31,000,000.00	32,076,166.60	(911,136,343)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	1,100,000.00	1,090,962.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	2,500,000.00	2,572,250.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	800,000.00	734,362.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,539,435.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,800,000.00	3,053,260.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,850,000.00	2,066,820.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,678,265.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,790,240.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	200,000.00	225,294.60	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,300,000.00	3,744,510.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	924,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,654,340.80	

	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,098,740.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,300,000.00	1,516,840.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	3,114,060.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,548,120.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,097,585.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,100,000.00	1,481,260.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	1,400,000.00	1,522,416.00	
オーストラリアドル 小計		32,450,000.00	36,453,721.20	(2,923,588,440)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,070,670.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	438,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,251,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	460,554.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	814,450.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	500,000.00	563,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	751,660.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	700,000.00	718,762.94	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	750,000.00	892,875.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,702,500.00	
シンガポールドル 小計		7,850,000.00	8,663,871.94	(706,798,672)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.478	2,500,000.00	2,575,522.75	
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,700,000.00	7,933,698.08	
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,570,976.28	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,463,683.50	
	MALAYSIA GOVT 4.736	6,400,000.00	6,845,916.80	
マレーシアリングgit 小計		26,900,000.00	28,389,797.41	(747,457,942)
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.15	6,600,000.00	6,606,204.00	
	ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	2,989,552.00	
	ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,649,880.00	
	ISRAEL FIXED 3.75	4,100,000.00	5,297,569.00	
	ISRAEL FIXED 6.25	3,300,000.00	4,263,039.00	
イスラエルシュケル 小計		18,400,000.00	20,806,244.00	(710,518,668)
			158,592,169,610	

合計	(158,592,169,610)
----	-------------------

(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 188銘柄	45.5%	45.9%
カナダドル	国債証券 21銘柄	2.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券 268銘柄	39.9%	40.3%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.2%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 7銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 19銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 5銘柄	0.4%	0.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	29,056,345	28,150,330
金銭信託	-	120,919,327
コール・ローン	200,018,460	36,956,115
国債証券	22,541,721,762	25,957,675,314
派生商品評価勘定	171,709,501	125,807,966
未収入金	995,732	-
未収利息	139,068,650	108,745,584
前払費用	9,796,914	16,179,898
流動資産合計	23,092,367,364	26,394,434,534
資産合計	23,092,367,364	26,394,434,534
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	6,700,653	1,175,922
未払金	512,912	-
未払解約金	11,000,000	2,500,000
未払利息	478	95
その他未払費用	4,579	417
流動負債合計	18,218,622	3,676,434
負債合計	18,218,622	3,676,434
純資産の部		
元本等		
元本	14,963,097,482	17,363,959,464
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,111,051,260	9,026,798,636
元本等合計	23,074,148,742	26,390,758,100
純資産合計	23,074,148,742	26,390,758,100
負債純資産合計	23,092,367,364	26,394,434,534

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2020年 9月15日現在）	（2021年 9月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,963,097,482口	17,363,959,464口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5421円 (10,000口当たりの純資産額 15,421円)	1口当たり純資産額 1.5199円 (10,000口当たりの純資産額 15,199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 9月16日 至 2021年 9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 9月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	22,692,931,748	-	22,527,922,900	165,008,848
	米ドル	9,866,560,212	-	9,867,218,400	658,188
	カナダドル	439,984,922	-	434,521,400	5,463,522
	メキシコペソ	172,350,035	-	178,392,500	6,042,465
	ユーロ	9,431,597,533	-	9,348,495,000	83,102,533
	英ポンド	1,506,705,928	-	1,444,167,200	62,538,728
	スウェーデンク ローナ	73,333,936	-	71,999,200	1,334,736
	ノルウェークロー ネ	51,047,808	-	49,056,000	1,991,808
	デンマーククロー ネ	123,330,982	-	122,307,500	1,023,482
	ポーランドズロチ	154,996,078	-	151,447,000	3,549,078
	オーストラリアド ル	562,178,910	-	552,839,100	9,339,810
	シンガポールドル	218,720,003	-	217,718,800	1,001,203
	イスラエルシケ ル	92,125,401	-	89,760,800	2,364,601
合計		22,692,931,748	-	22,527,922,900	165,008,848

(2021年 9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	26,175,092,934	-	26,050,460,890	124,632,044
	米ドル	11,975,159,024	-	11,913,425,524	61,733,500
	カナダドル	517,271,409	-	511,932,749	5,338,660
	メキシコペソ	187,361,443	-	188,512,864	1,151,421
	ユーロ	10,582,515,583	-	10,530,996,924	51,518,659
	英ポンド	1,636,445,041	-	1,636,194,033	251,008

スウェーデンク ローナ	76,726,905	-	76,507,300	219,605
ノルウェークロー ネ	63,160,376	-	63,184,877	24,501
デンマーククロー ネ	134,909,117	-	134,231,100	678,017
ポーランドズロチ	153,611,554	-	151,948,560	1,662,994
オーストラリアドル	485,561,160	-	482,711,894	2,849,266
シンガポールドル	241,569,305	-	240,615,865	953,440
イスラエルシケ ル	120,802,017	-	120,199,200	602,817
合計	26,175,092,934	-	26,050,460,890	124,632,044

(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 9月16日

至 2021年 9月15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 9月15日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	17,958,175,971円
同期中における追加設定元本額	9,168,095,951円
同期中における一部解約元本額	12,163,174,440円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,231,912,433円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	643,981,489円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,020,472円
イオン・バランス戦略ファンド	486,483,527円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	761,269,360円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	256,265,012円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	408,248,126円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	90,493,794円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	17,691,308円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,659,776円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,047,561,449円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,370,846円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,072,854,395円
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>	114,308,290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>	342,582,870円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	456,394,335円
合計	14,963,097,482円

(2021年 9月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	14,963,097,482円
同期中における追加設定元本額	11,177,397,764円
同期中における一部解約元本額	8,776,535,782円
2021年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,211,662,342円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,011,067,137円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	842,192,518円
イオン・バランス戦略ファンド	886,819,868円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,488,687,624円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	556,977,233円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	926,758,331円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	209,296,565円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	57,326,299円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	32,978,057円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	655,738円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,339,079,645円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	820,208円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,102,138,648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>	141,277,611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>	266,955,679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>	289,265,961円
合計	17,363,959,464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	770,000.00	770,210.54	
		US TREASURY N/B 0.125	930,000.00	929,891.01	
		US TREASURY N/B 0.125	1,650,000.00	1,649,355.47	
		US TREASURY N/B 0.125	1,200,000.00	1,199,343.75	
		US TREASURY N/B 0.125	940,000.00	939,302.34	
		US TREASURY N/B 0.125	1,600,000.00	1,598,562.49	
		US TREASURY N/B 0.125	320,000.00	319,450.00	
		US TREASURY N/B 0.125	750,000.00	748,623.04	
		US TREASURY N/B 0.125	1,100,000.00	1,097,593.75	
		US TREASURY N/B 0.125	460,000.00	458,796.09	
		US TREASURY N/B 0.125	1,030,000.00	1,025,332.81	
		US TREASURY N/B 0.125	1,300,000.00	1,293,957.02	
		US TREASURY N/B 0.25	500,000.00	500,566.40	
		US TREASURY N/B 0.25	910,000.00	909,324.60	
		US TREASURY N/B 0.25	1,460,000.00	1,456,635.14	
		US TREASURY N/B 0.25	890,000.00	886,905.85	
		US TREASURY N/B 0.25	620,000.00	617,602.33	
		US TREASURY N/B 0.25	100,000.00	98,777.34	
		US TREASURY N/B 0.25	650,000.00	641,240.23	
		US TREASURY N/B 0.25	630,000.00	620,180.85	

US TREASURY N/B 0.25	720,000.00	707,821.86	
US TREASURY N/B 0.375	980,000.00	980,267.96	
US TREASURY N/B 0.375	820,000.00	819,167.19	
US TREASURY N/B 0.375	1,010,000.00	1,002,503.90	
US TREASURY N/B 0.375	650,000.00	642,052.73	
US TREASURY N/B 0.375	620,000.00	611,935.15	
US TREASURY N/B 0.375	530,000.00	522,546.87	
US TREASURY N/B 0.5	1,570,000.00	1,567,056.25	
US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	495,390.62	
US TREASURY N/B 0.5	560,000.00	548,668.75	
US TREASURY N/B 0.5	330,000.00	322,716.79	
US TREASURY N/B 0.5	1,340,000.00	1,309,588.28	
US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	487,656.25	
US TREASURY N/B 0.5	1,030,000.00	1,002,037.10	
US TREASURY N/B 0.625	550,000.00	546,025.39	
US TREASURY N/B 0.625	440,000.00	434,551.56	
US TREASURY N/B 0.625	580,000.00	568,082.81	
US TREASURY N/B 0.625	570,000.00	557,442.18	
US TREASURY N/B 0.625	920,000.00	875,689.06	
US TREASURY N/B 0.625	1,190,000.00	1,129,849.22	
US TREASURY N/B 0.75	1,020,000.00	1,021,035.94	
US TREASURY N/B 0.75	430,000.00	423,533.20	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	1,004,687.50	
US TREASURY N/B 0.875	1,300,000.00	1,259,171.86	
US TREASURY N/B 1	500,000.00	498,007.81	
US TREASURY N/B 1.125	1,100,000.00	1,108,507.81	
US TREASURY N/B 1.125	1,120,000.00	1,107,356.24	
US TREASURY N/B 1.125	80,000.00	72,018.75	
US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	627,867.19	
US TREASURY N/B 1.25	1,150,000.00	1,178,390.62	
US TREASURY N/B 1.25	660,000.00	669,796.87	
US TREASURY N/B 1.25	320,000.00	324,675.00	
US TREASURY N/B 1.25	690,000.00	699,487.50	
US TREASURY N/B 1.25	1,080,000.00	1,094,048.42	
US TREASURY N/B 1.25	360,000.00	358,931.25	

US TREASURY N/B 1.25	380,000.00	327,913.27	
US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	970,558.59	
US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	306,738.28	
US TREASURY N/B 1.375	470,000.00	483,494.14	
US TREASURY N/B 1.375	580,000.00	542,503.90	
US TREASURY N/B 1.375	870,000.00	774,130.08	
US TREASURY N/B 1.5	1,150,000.00	1,173,134.76	
US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	464,537.11	
US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	569,099.60	
US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	465,697.26	
US TREASURY N/B 1.5	900,000.00	922,289.06	
US TREASURY N/B 1.625	200,000.00	203,445.31	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	814,906.24	
US TREASURY N/B 1.625	880,000.00	900,315.62	
US TREASURY N/B 1.625	520,000.00	532,939.06	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	823,156.24	
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	623,578.12	
US TREASURY N/B 1.625	860,000.00	894,400.00	
US TREASURY N/B 1.625	900,000.00	936,949.21	
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	520,722.65	
US TREASURY N/B 1.625	440,000.00	456,259.36	
US TREASURY N/B 1.625	1,220,000.00	1,259,840.60	
US TREASURY N/B 1.625	840,000.00	794,718.74	
US TREASURY N/B 1.75	350,000.00	355,878.90	
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	717,992.19	
US TREASURY N/B 1.75	500,000.00	523,261.71	
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	508,339.84	
US TREASURY N/B 1.875	900,000.00	916,312.50	
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	312,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	750,000.00	789,111.33	
US TREASURY N/B 1.875	1,110,000.00	1,129,901.95	
US TREASURY N/B 1.875	720,000.00	722,362.50	
US TREASURY N/B 2	100,000.00	102,089.84	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,025,898.44	
US TREASURY N/B 2	200,000.00	208,625.00	

US TREASURY N/B 2	500,000.00	521,953.12	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	627,070.31	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	632,390.62	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	619,687.50	
US TREASURY N/B 2	320,000.00	330,825.00	
US TREASURY N/B 2.125	430,000.00	440,867.57	
US TREASURY N/B 2.125	280,000.00	292,600.00	
US TREASURY N/B 2.125	410,000.00	430,083.59	
US TREASURY N/B 2.125	320,000.00	340,437.50	
US TREASURY N/B 2.25	550,000.00	574,578.12	
US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	481,257.03	
US TREASURY N/B 2.25	770,000.00	808,289.45	
US TREASURY N/B 2.25	580,000.00	612,330.47	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	528,183.59	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	528,750.00	
US TREASURY N/B 2.25	420,000.00	448,661.71	
US TREASURY N/B 2.25	450,000.00	483,152.34	
US TREASURY N/B 2.25	570,000.00	613,818.75	
US TREASURY N/B 2.25	700,000.00	754,167.96	
US TREASURY N/B 2.25	810,000.00	875,306.25	
US TREASURY N/B 2.25	400,000.00	432,687.50	
US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	500,142.18	
US TREASURY N/B 2.375	600,000.00	634,007.81	
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	430,046.87	
US TREASURY N/B 2.375	480,000.00	523,912.49	
US TREASURY N/B 2.375	520,000.00	580,896.87	
US TREASURY N/B 2.375	760,000.00	851,853.10	
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	313,066.40	
US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	746,839.84	
US TREASURY N/B 2.5	390,000.00	439,953.50	
US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	565,761.72	
US TREASURY N/B 2.5	360,000.00	407,671.87	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	536,601.56	
US TREASURY N/B 2.625	430,000.00	465,844.53	
US TREASURY N/B 2.625	720,000.00	797,962.50	

US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	943,136.72	
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	947,988.27	
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	538,300.78	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	648,515.62	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	649,875.00	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	332,859.37	
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	467,968.75	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	356,601.56	
US TREASURY N/B 2.75	250,000.00	297,529.29	
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	951,785.15	
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	216,656.25	
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	650,250.00	
US TREASURY N/B 2.875	720,000.00	785,812.50	
US TREASURY N/B 2.875	500,000.00	559,980.47	
US TREASURY N/B 2.875	660,000.00	740,489.06	
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	238,773.43	
US TREASURY N/B 2.875	110,000.00	132,446.87	
US TREASURY N/B 2.875	370,000.00	448,581.63	
US TREASURY N/B 2.875	630,000.00	772,020.70	
US TREASURY N/B 3	620,000.00	678,415.62	
US TREASURY N/B 3	290,000.00	352,508.59	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	489,843.75	
US TREASURY N/B 3	290,000.00	356,178.90	
US TREASURY N/B 3	300,000.00	369,574.21	
US TREASURY N/B 3	250,000.00	309,951.17	
US TREASURY N/B 3	300,000.00	372,503.90	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	498,078.12	
US TREASURY N/B 3	480,000.00	598,593.74	
US TREASURY N/B 3	550,000.00	688,531.25	
US TREASURY N/B 3.125	380,000.00	433,630.46	
US TREASURY N/B 3.125	210,000.00	259,809.37	
US TREASURY N/B 3.125	150,000.00	185,941.40	
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	495,921.87	
US TREASURY N/B 3.125	110,000.00	137,225.00	
US TREASURY N/B 3.125	470,000.00	598,864.44	

	US TREASURY N/B 3.375	450,000.00	582,363.28
	US TREASURY N/B 3.375	230,000.00	306,457.03
	US TREASURY N/B 3.5	100,000.00	129,148.43
	US TREASURY N/B 3.625	230,000.00	306,879.29
	US TREASURY N/B 3.625	400,000.00	535,703.12
	US TREASURY N/B 3.875	120,000.00	163,087.50
	US TREASURY N/B 4.25	170,000.00	239,806.25
	US TREASURY N/B 4.25	140,000.00	199,445.31
	US TREASURY N/B 4.375	40,000.00	56,606.25
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	430,453.12
	US TREASURY N/B 4.375	430,000.00	619,737.50
	US TREASURY N/B 4.375	120,000.00	174,159.37
	US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	140,671.87
	US TREASURY N/B 4.625	100,000.00	147,992.18
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	258,062.50
	US TREASURY N/B 5.375	80,000.00	109,787.50
	US TREASURY N/B 5.5	120,000.00	155,943.75
	米ドル 小計	103,930,000.00	108,647,175.41 (11,913,162,783)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	90,000.00	89,959.50
	CANADA-GOV'T 0.25	300,000.00	299,145.00
	CANADA-GOV'T 0.25	250,000.00	248,400.00
	CANADA-GOV'T 0.25	170,000.00	165,928.50
	CANADA-GOV'T 0.5	210,000.00	208,170.90
	CANADA-GOV'T 0.5	300,000.00	282,450.00
	CANADA-GOV'T 1	150,000.00	150,952.50
	CANADA-GOV'T 1.25	440,000.00	444,950.00
	CANADA-GOV'T 1.5	130,000.00	132,554.50
	CANADA-GOV'T 1.5	320,000.00	328,620.80
	CANADA-GOV'T 1.5	170,000.00	175,516.50
	CANADA-GOV'T 1.5	160,000.00	163,440.00
	CANADA-GOV'T 1.75	490,000.00	500,255.70
	CANADA-GOV'T 2	300,000.00	309,273.00
	CANADA-GOV'T 2	170,000.00	181,468.20
	CANADA-GOV'T 2	330,000.00	350,130.00

	CANADA-GOV'T 2.25	250,000.00	260,770.00
	CANADA-GOV'T 2.25	130,000.00	137,564.70
	CANADA-GOV'T 2.25	190,000.00	207,337.50
	CANADA-GOV'T 2.5	290,000.00	305,384.50
	CANADA-GOV'T 2.75	230,000.00	282,005.30
	CANADA-GOV'T 2.75	50,000.00	63,529.50
	CANADA-GOV'T 3.5	120,000.00	163,420.80
	CANADA-GOV'T 4	110,000.00	154,984.50
	CANADA-GOV'T 5	70,000.00	104,675.20
	CANADA-GOV'T 5.75	90,000.00	121,411.80
	CANADA-GOV'T 5.75	60,000.00	88,580.40
	カナダドル 小計	5,570,000.00	5,920,879.30 (511,327,136)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	2,700,000.00	2,993,520.24
	MEXICAN BONOS 5.75	3,180,000.00	3,078,609.67
	MEXICAN BONOS 6.75	850,000.00	865,096.00
	MEXICAN BONOS 7.5	3,300,000.00	3,411,817.86
	MEXICAN BONOS 7.75	2,380,000.00	2,507,068.20
	MEXICAN BONOS 7.75	1,960,000.00	2,057,000.40
	MEXICAN BONOS 7.75	2,500,000.00	2,552,449.49
	MEXICAN BONOS 8	4,360,000.00	4,553,215.14
	MEXICAN BONOS 8	3,000,000.00	3,143,760.00
	MEXICAN BONOS 8	1,800,000.00	1,877,649.30
	MEXICAN BONOS 8.5	3,640,000.00	3,983,802.36
	MEXICAN BONOS 8.5	2,300,000.00	2,520,946.51
	メキシコペソ 小計	31,970,000.00	33,544,935.17 (184,815,820)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	50,000.00	71,595.00
	BELGIAN 0	205,000.00	210,625.20
	BELGIAN 0.1	130,000.00	133,287.70
	BELGIAN 0.2	80,000.00	81,540.00
	BELGIAN 0.4	50,000.00	49,333.00
	BELGIAN 0.8	240,000.00	253,171.20
	BELGIAN 0.8	310,000.00	333,352.30
	BELGIAN 0.8	130,000.00	140,632.70
	BELGIAN 0291 5.5	170,000.00	237,685.50

BELGIAN 0304 5	160,000.00	264,988.80	
BELGIAN 0320 4.25	170,000.00	289,844.90	
BELGIAN 0324 4.5	80,000.00	98,855.20	
BELGIAN 0325 4.25	70,000.00	73,607.10	
BELGIAN 0328 2.25	100,000.00	105,272.00	
BELGIAN 0332 2.6	240,000.00	262,144.80	
BELGIAN 0333 3	120,000.00	164,091.60	
BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	103,676.00	
BELGIAN 0344 1.45	110,000.00	129,635.00	
BELGIAN 0347 0.9	170,000.00	185,813.40	
BELGIAN 0348 1.7	100,000.00	124,649.00	
BELGIAN 0352 0	90,000.00	90,324.00	
BELGIAN 0353 0.65	30,000.00	26,466.00	
BELGIAN 1	200,000.00	215,026.00	
BELGIAN 1	160,000.00	177,350.40	
BELGIAN 1.25	130,000.00	148,744.70	
BELGIAN 1.6	120,000.00	145,714.80	
BELGIAN 1.9	170,000.00	213,105.20	
BELGIAN 2.15	130,000.00	190,456.50	
BELGIAN 3.75	130,000.00	220,612.60	
BTPS 0	250,000.00	252,205.00	
BTPS 0	100,000.00	100,851.00	
BTPS 0.3	100,000.00	101,447.00	
BTPS 0.35	300,000.00	306,105.00	
BTPS 0.5	50,000.00	51,288.00	
BTPS 0.5	270,000.00	274,023.00	
BTPS 0.6	360,000.00	358,448.40	
BTPS 0.65	300,000.00	306,933.00	
BTPS 0.85	280,000.00	291,841.20	
BTPS 0.9	240,000.00	246,636.00	
BTPS 0.95	340,000.00	347,160.40	
BTPS 0.95	720,000.00	735,537.60	
BTPS 0.95	130,000.00	136,227.00	
BTPS 0.95	210,000.00	217,688.10	
BTPS 0.95	180,000.00	184,532.40	

BTPS 0.95	100,000.00	97,549.00	
BTPS 1.25	200,000.00	212,898.00	
BTPS 1.35	560,000.00	600,891.20	
BTPS 1.45	200,000.00	203,930.00	
BTPS 1.45	250,000.00	263,787.50	
BTPS 1.45	240,000.00	254,664.00	
BTPS 1.45	100,000.00	105,519.00	
BTPS 1.5	420,000.00	446,644.80	
BTPS 1.5	80,000.00	80,691.20	
BTPS 1.6	380,000.00	409,560.20	
BTPS 1.65	230,000.00	252,335.30	
BTPS 1.65	370,000.00	405,327.60	
BTPS 1.7	140,000.00	141,691.20	
BTPS 1.8	220,000.00	236,709.00	
BTPS 1.85	300,000.00	317,643.00	
BTPS 2	220,000.00	239,806.60	
BTPS 2	320,000.00	356,726.40	
BTPS 2.05	320,000.00	356,067.20	
BTPS 2.1	280,000.00	308,800.80	
BTPS 2.15	50,000.00	51,054.50	
BTPS 2.2	290,000.00	324,910.20	
BTPS 2.25	310,000.00	360,771.80	
BTPS 2.45	420,000.00	444,969.00	
BTPS 2.45	130,000.00	153,631.40	
BTPS 2.45	180,000.00	213,852.60	
BTPS 2.5	260,000.00	283,285.60	
BTPS 2.5	210,000.00	233,209.20	
BTPS 2.7	260,000.00	322,709.40	
BTPS 2.8	240,000.00	282,748.80	
BTPS 2.8	60,000.00	73,212.00	
BTPS 2.95	150,000.00	190,296.00	
BTPS 3	170,000.00	204,504.90	
BTPS 3.1	100,000.00	129,642.00	
BTPS 3.25	160,000.00	217,011.20	
BTPS 3.35	210,000.00	272,771.10	

BTPS 3.45	80,000.00	112,458.40	
BTPS 3.75	100,000.00	112,058.00	
BTPS 3.85	180,000.00	270,950.40	
BTPS 4	250,000.00	351,147.50	
BTPS 4.5	70,000.00	78,432.90	
BTPS 4.5	300,000.00	361,722.00	
BTPS 4.75	300,000.00	329,634.00	
BTPS 4.75	270,000.00	353,019.60	
BTPS 4.75	270,000.00	443,723.40	
BTPS 5	300,000.00	354,792.00	
BTPS 5	310,000.00	463,642.20	
BTPS 5	250,000.00	400,765.00	
BTPS 5	180,000.00	292,014.00	
BTPS 5.25	410,000.00	569,916.40	
BTPS 5.5	350,000.00	373,691.50	
BTPS 5.75	200,000.00	308,724.00	
BTPS 6	250,000.00	377,347.50	
BTPS 6.5	190,000.00	263,360.90	
BTPS 9	170,000.00	204,202.30	
BUNDESUBL-120 0	340,000.00	348,785.60	
BUNDESUBL-120 0	250,000.00	257,820.00	
BUNDESUBL-176 0	250,000.00	251,920.00	
BUNDESUBL-177 0	380,000.00	384,457.40	
BUNDESUBL-178 0	350,000.00	355,498.50	
BUNDESUBL-179 0	490,000.00	499,383.50	
BUNDESUBL-180 0	700,000.00	716,156.00	
BUNDESUBL-183 0	60,000.00	61,904.40	
BUNDESUBL-184 0	90,000.00	93,001.50	
BUNDESSCHATZANW 0	320,000.00	323,500.80	
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	310,050.00	
DEUTSCHLAND REP 0	190,000.00	197,062.30	
DEUTSCHLAND REP 0	100,000.00	103,790.00	
DEUTSCHLAND REP 0	250,000.00	259,932.50	
DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	155,937.00	
DEUTSCHLAND REP 0	680,000.00	706,309.20	

DEUTSCHLAND REP 0	380,000.00	393,995.40
DEUTSCHLAND REP 0	40,000.00	41,378.80
DEUTSCHLAND REP 0	260,000.00	265,153.20
DEUTSCHLAND REP 0	180,000.00	182,217.60
DEUTSCHLAND REP 0	240,000.00	229,819.20
DEUTSCHLAND REP 0	130,000.00	126,002.50
DEUTSCHLAND REP 0.25	330,000.00	346,292.10
DEUTSCHLAND REP 0.25	170,000.00	179,746.10
DEUTSCHLAND REP 0.25	190,000.00	201,234.70
DEUTSCHLAND REP 0.5	330,000.00	344,117.40
DEUTSCHLAND REP 0.5	410,000.00	431,988.30
DEUTSCHLAND REP 0.5	380,000.00	405,634.80
DEUTSCHLAND REP 0.5	310,000.00	332,130.90
DEUTSCHLAND REP 1	100,000.00	105,160.00
DEUTSCHLAND REP 1	230,000.00	245,711.30
DEUTSCHLAND REP 1.25	280,000.00	365,083.60
DEUTSCHLAND REP 1.5	450,000.00	459,891.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	250,000.00	259,402.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	240,000.00	254,572.80
DEUTSCHLAND REP 1.75	200,000.00	212,240.00
DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	263,340.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	390,000.00	613,867.80
DEUTSCHLAND REP 2.5	280,000.00	450,744.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	210,000.00	355,275.90
DEUTSCHLAND REP 4	350,000.00	577,468.50
DEUTSCHLAND REP 4.25	200,000.00	357,752.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	170,000.00	233,297.80
DEUTSCHLAND REP 4.75	180,000.00	298,944.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	250,000.00	480,962.50
DEUTSCHLAND REP 5.5	80,000.00	125,604.80
DEUTSCHLAND REP 5.625	160,000.00	224,585.60
DEUTSCHLAND REP 6.25	290,000.00	457,460.50
DEUTSCHLAND REP 6.5	160,000.00	227,924.80
FINNISH GOV'T 0	120,000.00	121,786.80
FINNISH GOV'T 0	70,000.00	71,341.90

FINNISH GOV'T 0.125	40,000.00	41,019.20	
FINNISH GOV'T 0.125	20,000.00	18,385.20	
FINNISH GOV'T 0.25	70,000.00	70,167.30	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	105,114.00	
FINNISH GOV'T 0.5	40,000.00	42,397.20	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	106,494.00	
FINNISH GOV'T 0.75	30,000.00	32,725.20	
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	106,129.00	
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	114,133.00	
FINNISH GOV'T 1.375	50,000.00	63,171.50	
FINNISH GOV'T 1.5	100,000.00	103,633.00	
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	102,380.00	
FINNISH GOV'T 2.625	40,000.00	59,694.40	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	122,135.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	303,009.00	
FRANCE O.A.T. 0	430,000.00	434,609.60	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	345,457.00	
FRANCE O.A.T. 0	450,000.00	457,596.00	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	347,316.80	
FRANCE O.A.T. 0	380,000.00	389,131.40	
FRANCE O.A.T. 0	270,000.00	276,501.60	
FRANCE O.A.T. 0	480,000.00	488,198.40	
FRANCE O.A.T. 0	510,000.00	515,156.10	
FRANCE O.A.T. 0	230,000.00	230,393.30	
FRANCE O.A.T. 0.25	410,000.00	425,981.80	
FRANCE O.A.T. 0.5	80,000.00	65,772.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	440,000.00	458,145.60	
FRANCE O.A.T. 0.5	470,000.00	493,011.20	
FRANCE O.A.T. 0.5	420,000.00	444,826.20	
FRANCE O.A.T. 0.5	240,000.00	241,843.20	
FRANCE O.A.T. 0.5	70,000.00	69,029.80	
FRANCE O.A.T. 0.75	640,000.00	688,204.80	
FRANCE O.A.T. 0.75	580,000.00	625,100.80	
FRANCE O.A.T. 0.75	350,000.00	347,417.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	120,000.00	118,077.60	

FRANCE O.A.T. 1	350,000.00	373,390.50	
FRANCE O.A.T. 1	280,000.00	303,315.60	
FRANCE O.A.T. 1.25	380,000.00	432,124.60	
FRANCE O.A.T. 1.25	490,000.00	559,433.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	540,000.00	623,381.40	
FRANCE O.A.T. 1.5	350,000.00	420,339.50	
FRANCE O.A.T. 1.75	640,000.00	666,662.40	
FRANCE O.A.T. 1.75	570,000.00	613,929.90	
FRANCE O.A.T. 1.75	410,000.00	509,568.50	
FRANCE O.A.T. 1.75	150,000.00	197,628.00	
FRANCE O.A.T. 2	290,000.00	384,519.70	
FRANCE O.A.T. 2.25	120,000.00	123,948.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	430,000.00	464,124.80	
FRANCE O.A.T. 2.5	640,000.00	791,174.40	
FRANCE O.A.T. 2.75	420,000.00	503,021.40	
FRANCE O.A.T. 3.25	280,000.00	447,274.80	
FRANCE O.A.T. 3.5	490,000.00	582,516.90	
FRANCE O.A.T. 4	230,000.00	371,132.60	
FRANCE O.A.T. 4	170,000.00	331,535.70	
FRANCE O.A.T. 4	170,000.00	347,320.20	
FRANCE O.A.T. 4.25	480,000.00	530,548.80	
FRANCE O.A.T. 4.5	470,000.00	830,095.20	
FRANCE O.A.T. 4.75	270,000.00	437,794.20	
FRANCE O.A.T. 5.5	390,000.00	564,470.40	
FRANCE O.A.T. 5.75	340,000.00	558,341.20	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	509,744.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	229,822.00	
IRISH GOVT 0.2	120,000.00	124,347.60	
IRISH GOVT 0.2	150,000.00	153,970.50	
IRISH GOVT 0.9	120,000.00	129,990.00	
IRISH GOVT 1	220,000.00	235,826.80	
IRISH GOVT 1.1	130,000.00	143,503.10	
IRISH GOVT 1.3	150,000.00	171,259.50	
IRISH GOVT 1.35	60,000.00	68,261.40	
IRISH GOVT 1.5	70,000.00	84,050.40	

IRISH GOVT 1.7	100,000.00	121,063.00	
IRISH GOVT 2	70,000.00	92,270.50	
IRISH GOVT 2.4	100,000.00	122,521.00	
IRISH GOVT 3.4	80,000.00	88,130.40	
IRISH GOVT 3.9	50,000.00	53,476.00	
IRISH GOVT 5.4	50,000.00	60,572.50	
NETHERLANDS GOVT 0	170,000.00	172,913.80	
NETHERLANDS GOVT 0	120,000.00	123,634.80	
NETHERLANDS GOVT 0	180,000.00	184,840.20	
NETHERLANDS GOVT 0	100,000.00	102,243.00	
NETHERLANDS GOVT 0	50,000.00	49,469.50	
NETHERLANDS GOVT 0	80,000.00	74,576.80	
NETHERLANDS GOVT 0.25	200,000.00	207,156.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	130,000.00	136,493.50	
NETHERLANDS GOVT 0.5	230,000.00	242,689.10	
NETHERLANDS GOVT 0.5	200,000.00	216,514.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	170,000.00	183,141.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	108,480.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	160,000.00	167,388.80	
NETHERLANDS GOVT 2	200,000.00	215,640.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	140,000.00	183,044.40	
NETHERLANDS GOVT 2.75	170,000.00	281,190.20	
NETHERLANDS GOVT 3.75	100,000.00	106,029.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	190,000.00	331,204.20	
NETHERLANDS GOVT 4	260,000.00	421,449.60	
NETHERLANDS GOVT 5.5	150,000.00	207,991.50	
REP OF AUSTRIA 0	180,000.00	182,527.20	
REP OF AUSTRIA 0	90,000.00	91,864.80	
REP OF AUSTRIA 0	120,000.00	122,167.20	
REP OF AUSTRIA 0	290,000.00	293,471.30	
REP OF AUSTRIA 0	120,000.00	112,582.80	
REP OF AUSTRIA 0.5	310,000.00	327,911.80	
REP OF AUSTRIA 0.5	30,000.00	31,822.80	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	213,478.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	130,000.00	139,922.90	

REP OF AUSTRIA 0.75	80,000.00	85,573.60	
REP OF AUSTRIA 1.2	40,000.00	43,090.80	
REP OF AUSTRIA 1.5	70,000.00	96,224.80	
REP OF AUSTRIA 1.5	70,000.00	88,197.20	
REP OF AUSTRIA 1.75	80,000.00	84,260.80	
REP OF AUSTRIA 2.4	100,000.00	129,887.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	40,000.00	64,783.60	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	209,840.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	150,000.00	322,560.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	120,000.00	194,119.20	
REP OF AUSTRIA 4.85	100,000.00	125,241.00	
SPANISH GOV'T 0	180,000.00	181,807.20	
SPANISH GOV'T 0	350,000.00	354,910.50	
SPANISH GOV'T 0	290,000.00	294,993.80	
SPANISH GOV'T 0	210,000.00	213,452.40	
SPANISH GOV'T 0.1	280,000.00	276,466.40	
SPANISH GOV'T 0.25	390,000.00	398,821.80	
SPANISH GOV'T 0.35	300,000.00	305,409.00	
SPANISH GOV'T 0.45	300,000.00	303,732.00	
SPANISH GOV'T 0.5	440,000.00	455,004.00	
SPANISH GOV'T 0.5	170,000.00	173,306.50	
SPANISH GOV'T 0.6	220,000.00	229,944.00	
SPANISH GOV'T 0.8	100,000.00	105,987.00	
SPANISH GOV'T 0.85	210,000.00	212,732.10	
SPANISH GOV'T 1	180,000.00	170,935.20	
SPANISH GOV'T 1.2	60,000.00	63,112.80	
SPANISH GOV'T 1.25	240,000.00	263,596.80	
SPANISH GOV'T 1.3	250,000.00	271,232.50	
SPANISH GOV'T 1.4	250,000.00	275,402.50	
SPANISH GOV'T 1.4	290,000.00	320,325.30	
SPANISH GOV'T 1.45	20,000.00	18,555.00	
SPANISH GOV'T 1.45	350,000.00	385,546.00	
SPANISH GOV'T 1.45	230,000.00	255,753.10	
SPANISH GOV'T 1.5	290,000.00	319,168.20	
SPANISH GOV'T 1.85	160,000.00	186,944.00	

	SPANISH GOV'T 1.95	220,000.00	243,834.80	
	SPANISH GOV'T 1.95	200,000.00	232,314.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	250,000.00	277,062.50	
	SPANISH GOV'T 2.35	300,000.00	366,981.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	270,000.00	369,168.30	
	SPANISH GOV'T 2.75	150,000.00	165,580.50	
	SPANISH GOV'T 2.9	190,000.00	267,045.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	160,000.00	255,124.80	
	SPANISH GOV'T 4.2	100,000.00	152,369.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	332,196.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	590,000.00	708,548.70	
	SPANISH GOV'T 4.7	270,000.00	459,151.20	
	SPANISH GOV'T 4.8	100,000.00	112,917.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	230,000.00	396,076.10	
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	275,124.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	130,000.00	242,569.60	
	SPANISH GOV'T 5.75	260,000.00	411,707.40	
	SPANISH GOV'T 5.9	270,000.00	353,192.40	
	SPANISH GOV'T 6	180,000.00	261,133.20	
	ユーロ 小計	69,205,000.00	80,795,192.60 (10,460,553,585)	
英bond	UK TSY GILT 0.125	260,000.00	260,000.00	
	UK TSY GILT 0.125	260,000.00	259,365.60	
	UK TSY GILT 0.125	320,000.00	317,030.40	
	UK TSY GILT 0.125	140,000.00	136,843.00	
	UK TSY GILT 0.25	220,000.00	209,818.40	
	UK TSY GILT 0.375	100,000.00	99,788.00	
	UK TSY GILT 0.375	180,000.00	175,298.40	
	UK TSY GILT 0.5	140,000.00	119,698.60	
	UK TSY GILT 0.625	250,000.00	253,317.50	
	UK TSY GILT 0.625	220,000.00	211,149.40	
	UK TSY GILT 0.625	230,000.00	205,974.20	
	UK TSY GILT 0.75	280,000.00	283,138.80	
	UK TSY GILT 0.875	170,000.00	173,910.00	
	UK TSY GILT 0.875	130,000.00	124,512.70	

UK TSY GILT 1	150,000.00	153,111.00
UK TSY GILT 1.125	300,000.00	304,716.00
UK TSY GILT 1.25	150,000.00	157,200.00
UK TSY GILT 1.25	150,000.00	155,587.50
UK TSY GILT 1.25	250,000.00	262,422.50
UK TSY GILT 1.5	80,000.00	84,472.00
UK TSY GILT 1.5	310,000.00	341,294.50
UK TSY GILT 1.625	80,000.00	105,230.40
UK TSY GILT 1.625	220,000.00	237,388.80
UK TSY GILT 1.625	80,000.00	93,404.80
UK TSY GILT 1.75	310,000.00	315,139.80
UK TSY GILT 1.75	220,000.00	245,280.20
UK TSY GILT 1.75	90,000.00	105,039.00
UK TSY GILT 1.75	220,000.00	270,710.00
UK TSY GILT 2	130,000.00	138,850.40
UK TSY GILT 2.25	250,000.00	260,345.00
UK TSY GILT 2.5	140,000.00	219,181.20
UK TSY GILT 2.75	90,000.00	96,760.80
UK TSY GILT 3.25	180,000.00	258,793.20
UK TSY GILT 3.5	250,000.00	376,820.00
UK TSY GILT 3.5	170,000.00	337,577.50
UK TSY GILT 4	140,000.00	276,976.00
UK TSY GILT 4.25	200,000.00	246,686.00
UK TSY GILT 4.25	140,000.00	190,388.80
UK TSY GILT 4.25	180,000.00	261,831.60
UK TSY GILT 4.25	140,000.00	215,495.00
UK TSY GILT 4.25	190,000.00	297,747.10
UK TSY GILT 4.25	90,000.00	153,661.50
UK TSY GILT 4.25	90,000.00	160,839.90
UK TSY GILT 4.25	200,000.00	388,510.00
UK TSY GILT 4.5	210,000.00	304,298.40
UK TSY GILT 4.5	260,000.00	432,244.80
UK TSY GILT 4.75	160,000.00	218,691.20
UK TSY GILT 4.75	70,000.00	112,254.10
UK TSY GILT 5	80,000.00	93,109.60

	UK TSY GILT 6	60,000.00	83,354.40
英債券 小計		8,930,000.00	10,785,258.00 (1,632,780,208)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.125	500,000.00	494,615.00
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	950,000.00	993,529.00
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	810,000.00	848,620.80
	SWEDISH GOVRNMNT 1	640,000.00	674,867.20
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1,010,000.00	1,048,864.80
	SWEDISH GOVRNMNT 2.25	300,000.00	361,626.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	800,000.00	878,992.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	430,000.00	640,614.00
スウェーデンクローナ 小計		5,440,000.00	5,941,728.80 (75,638,207)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.25	410,000.00	406,597.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.375	330,000.00	331,445.40
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	650,000.00	661,082.50
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	250,000.00	256,220.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	680,000.00	700,984.80
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	460,000.00	476,169.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	700,000.00	716,051.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	400,000.00	419,700.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	920,000.00	967,554.80
ノルウェークローネ 小計		4,800,000.00	4,935,804.50 (62,536,643)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0	390,000.00	395,811.00
	DENMARK - BULLET 0	550,000.00	552,475.00
	DENMARK - BULLET 0.25	220,000.00	222,059.20
	DENMARK - BULLET 0.25	450,000.00	433,215.00
	DENMARK - BULLET 0.5	660,000.00	694,188.00
	DENMARK - BULLET 0.5	1,090,000.00	1,151,803.00
	DENMARK - BULLET 1.5	1,100,000.00	1,149,885.00
	DENMARK - BULLET 1.75	690,000.00	753,549.00
	DENMARK - BULLET 4.5	1,190,000.00	2,113,916.00
	DENMARK - BULLET 7	90,000.00	111,645.00
デンマーククローネ 小計		6,430,000.00	7,578,546.20 (131,942,489)

ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	460,000.00	456,452.93
	POLAND GOVT BOND 0.25	140,000.00	131,982.20
	POLAND GOVT BOND 0.75	850,000.00	844,517.50
	POLAND GOVT BOND 1.25	200,000.00	189,994.00
	POLAND GOVT BOND 2.25	560,000.00	583,503.20
	POLAND GOVT BOND 2.5	500,000.00	523,020.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	70,000.00	74,016.60
	POLAND GOVT BOND 2.75	510,000.00	549,565.80
	POLAND GOVT BOND 2.75	170,000.00	183,062.80
	POLAND GOVT BOND 3.25	470,000.00	509,418.90
	POLAND GOVT BOND 4	260,000.00	279,076.20
	POLAND GOVT BOND 5.75	720,000.00	931,096.80
ポーランドズロチ 小計		4,910,000.00	5,255,706.93 (149,290,458)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	200,000.00	200,164.80
	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	320,000.00	317,370.88
	AUSTRALIAN GOVT. 0.5	320,000.00	318,042.24
	AUSTRALIAN GOVT. 1	310,000.00	304,965.91
	AUSTRALIAN GOVT. 1	220,000.00	214,698.88
	AUSTRALIAN GOVT. 1.25	190,000.00	189,384.40
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	250,000.00	257,225.00
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	220,000.00	230,069.40
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	180,000.00	165,231.54
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	140,000.00	143,680.60
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	210,000.00	228,994.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	380,000.00	424,536.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	330,000.00	353,530.98
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	270,000.00	302,103.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	130,000.00	146,441.49
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	283,675.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	150,000.00	173,430.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	130,000.00	147,849.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	120,000.00	141,800.64
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	230,000.00	254,058.00
AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	233,360.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	80,000.00	97,696.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	150,000.00	193,515.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	210,000.00	245,469.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	140,000.00	188,524.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	200,000.00	217,488.00	
オーストラリアドル 小計		5,530,000.00	5,973,304.26	(479,059,001)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.875	90,000.00	90,149.85	
	SINGAPORE GOV'T 2	120,000.00	124,404.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.125	340,000.00	360,945.70	
	SINGAPORE GOV'T 2.25	120,000.00	128,480.40	
	SINGAPORE GOV'T 2.375	90,000.00	98,190.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	210,000.00	230,160.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	330,000.00	344,025.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	115,138.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	150,000.00	174,525.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	210,000.00	235,410.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	200,000.00	225,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	322,140.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	180,000.00	184,824.75	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	297,625.00	
シンガポールドル 小計		2,690,000.00	2,931,218.20	(239,128,780)
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 1.5	990,000.00	1,020,571.20	
	ISRAEL FIXED 1.5	360,000.00	345,254.40	
	ISRAEL FIXED 1.75	330,000.00	348,090.60	
	ISRAEL FIXED 2.25	570,000.00	626,954.40	
	ISRAEL FIXED 3.75	370,000.00	478,073.30	
	ISRAEL FIXED 6.25	480,000.00	620,078.40	
イスラエルシュケル 小計		3,100,000.00	3,439,022.30	(117,440,204)
合計			25,957,675,314	(25,957,675,314)

(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 177銘柄	45.1%	45.9%
カナダドル	国債証券 27銘柄	1.9%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券 308銘柄	39.6%	40.3%
英ポンド	国債証券 50銘柄	6.2%	6.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 10銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	0.9%	0.9%
イスラエルシェケル	国債証券 6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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	2021年9月30日 現在
資産総額	6,086,181,569 円
負債総額	5,905,007 円
純資産総額（ - ）	6,080,276,562 円
発行済口数	5,590,104,707 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0877 円
（1万口当たり純資産額	10,877 円）

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	2021年9月30日 現在
資産総額	2,994,082,406 円
負債総額	1,988,035 円
純資産総額（ - ）	2,992,094,371 円
発行済口数	2,570,595,875 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1640 円
（1万口当たり純資産額	11,640 円）

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	2021年9月30日 現在
資産総額	7,200,234,469 円
負債総額	31,406,923 円
純資産総額（ - ）	7,168,827,546 円
発行済口数	5,736,310,837 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2497 円
（1万口当たり純資産額	12,497 円）

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	2021年9月30日 現在
資産総額	2,980,430,186 円
負債総額	9,237,382 円
純資産総額（ - ）	2,971,192,804 円
発行済口数	2,263,515,922 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3126 円
（1万口当たり純資産額	13,126 円）

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	2021年9月30日 現在
資産総額	2,981,982,266 円
負債総額	16,515,647 円
純資産総額（ - ）	2,965,466,619 円
発行済口数	2,185,985,309 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3566 円
（1万口当たり純資産額	13,566 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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2021年9月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

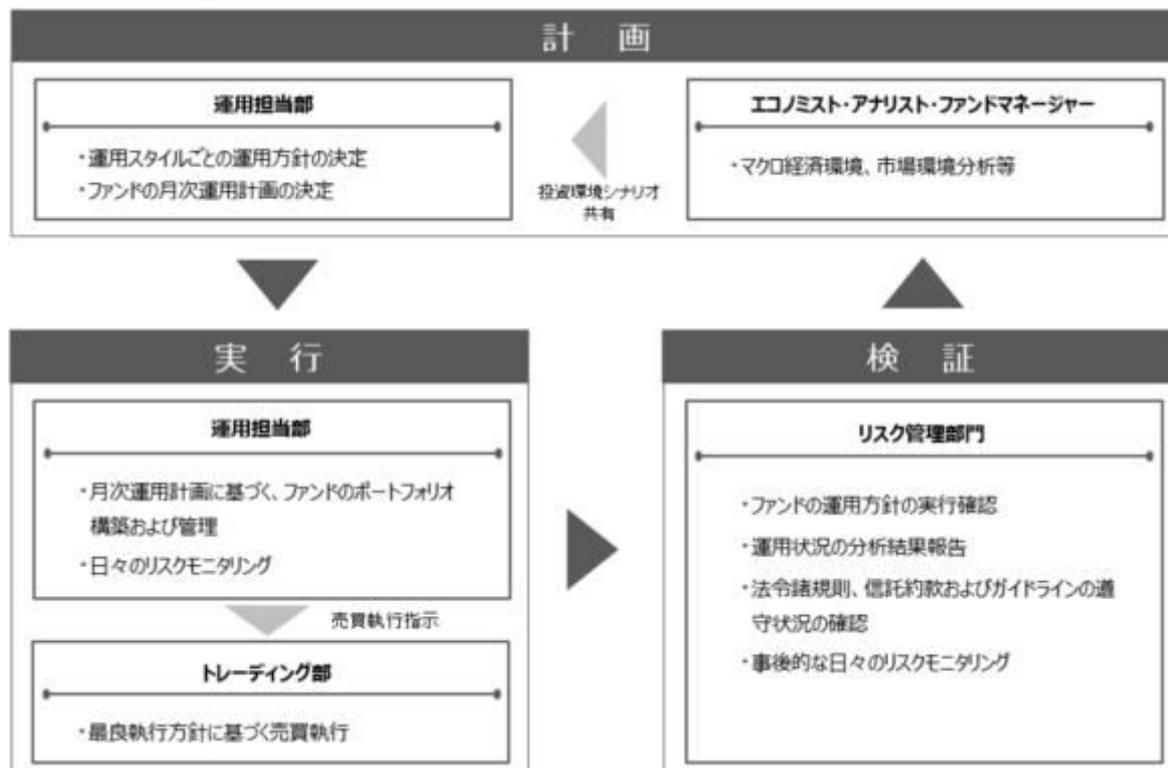
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年9月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	747	9,430,017
単位型株式投資信託	104	569,236
追加型公社債投資信託	1	28,911
単位型公社債投資信託	189	433,339
合計	1,041	10,461,505

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,264,545	33,048,142
顧客分別金信託	300,021	300,036
前払費用	515,226	449,748
未収入金	602,605	132,419
未収委託者報酬	8,404,880	9,936,096
未収運用受託報酬	2,199,785	2,247,156
未収投資助言報酬	299,826	398,108
未収収益	37,702	39,975
その他の流動資産	40,119	6,981
流動資産合計	45,664,712	46,558,665
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	101,609	1,509,450
器具備品	783,224	870,855
土地	710	710
リース資産	968	13,483

建設仮勘定	66,498	-
有形固定資産合計	953,010	2,394,500
無形固定資産		
ソフトウェア	909,133	1,347,889
ソフトウェア仮勘定	508,733	1,029,033
のれん	34,397,824	3,654,491
顧客関連資産	17,785,166	15,671,890
電話加入権	12,739	12,727
商標権	54	48
無形固定資産合計	53,613,651	21,716,080
投資その他の資産		
投資有価証券	19,436,480	22,866,282
関係会社株式	11,246,398	11,246,398
長期差入保証金	2,523,637	1,409,091
長期前払費用	113,852	116,117
会員権	90,479	90,479
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	33,390,098	35,707,619
固定資産合計	87,956,760	59,818,200
資産合計	133,621,473	106,376,866

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,064	5,153
顧客からの預り金	14,285	20,077
その他の預り金	146,200	169,380
未払金		
未払収益分配金	1,629	1,646
未払償還金	131,338	43,523
未払手数料	3,776,873	4,480,697
その他未払金	502,211	270,290
未払費用	3,935,582	5,940,121
未払消費税等	305,513	235,647
未払法人税等	489,151	762,648
賞与引当金	1,716,321	1,516,622
その他の流動負債	30,951	9,710
流動負債合計	11,051,125	13,455,519
固定負債		
リース債務	-	9,678
繰延税金負債	2,963,538	2,566,958
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448
賞与引当金	14,767	-
その他の固定負債	172,918	40,950
固定負債合計	8,451,038	7,876,035
負債合計	19,502,164	21,331,554
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	81,927,000

資本剰余金合計	90,555,984	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	19,364,265	10,281,242
利益剰余金合計	21,185,470	8,460,037
株主資本計	113,741,454	84,095,946
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	377,855	949,365
評価・換算差額等合計	377,855	949,365
純資産合計	114,119,309	85,045,311
負債・純資産合計	133,621,473	106,376,866

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2019年4月1日	(自	2020年4月1日
	至	2020年3月31日)	至	2021年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		54,615,133		50,610,457
運用受託報酬		9,389,058		9,450,169
投資助言報酬		1,303,595		1,270,584
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		181,061		200,807
その他		32,421		32,820
営業収益計		65,521,269		61,564,839
営業費用				
支払手数料		24,888,040		22,784,919
広告宣伝費		447,024		365,317
調査費				
調査費		3,214,679		3,061,987
委託調査費		7,702,309		7,810,157
営業雑経費				
通信費		70,007		95,163
印刷費		612,249		554,920
協会費		45,117		40,044
諸会費		32,199		29,473
情報機器関連費		4,349,174		4,562,612
販売促進費		68,688		23,614
その他		154,201		163,332
営業費用合計		41,583,691		39,491,542
一般管理費				
給料				
役員報酬		264,325		277,027
給料・手当		9,789,691		9,280,730
賞与		914,702		950,630
賞与引当金繰入額		1,726,013		1,501,855
交際費		30,898		11,815
寄付金		2,022		949
事務委託費		956,931		844,255
旅費交通費		249,359		21,023

租税公課	389,032	389,819
不動産賃借料	1,121,553	1,639,529
退職給付費用	797,158	790,144
固定資産減価償却費	3,044,658	3,040,894
のれん償却費	2,645,986	2,645,986
諸経費	482,324	608,206
一般管理費合計	22,414,658	22,002,869
営業利益	1,522,919	70,426

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	778,113	13,164
受取利息	947	2,736
時効成立分配金・償還金	1,041	88,335
原稿・講演料	2,061	2,603
投資有価証券償還益	6,398	57,388
投資有価証券売却益	24,206	162,941
雑収入	53,484	72,933
営業外収益合計	866,254	400,104
営業外費用		
為替差損	72,457	766
投資有価証券償還損	129,006	11,762
投資有価証券売却損	12,906	34,473
雑損失	8,334	1,240
営業外費用合計	222,704	48,243
経常利益	2,166,469	422,288
特別損失		
固定資産除却損	1 110,668	54,493
減損損失	2 46,417	28,097,346
合併関連費用	42,800	-
早期退職費用	3 -	216,200
本社移転費用	4 133,168	127,044
その他特別損失	-	5,460
特別損失合計	333,054	28,500,544
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	1,833,414	28,078,256
法人税、住民税及び事業税	1,874,278	1,549,173
法人税等調整額	619,676	693,192
法人税等合計	1,254,602	855,980
当期純利益又は 当期純損失()	578,811	28,934,237

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

	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	

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失（ ）								28,934,237
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------

	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	純資産合計
	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
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271		-	711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237		-	28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

[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

市場価格のない株式等以外

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）

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、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	4～15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、当事業年度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。

(会計方針の変更)

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)を当事業年度の期首から適用し、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。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	466,875千円	102,329千円
器具備品	1,225,261千円	1,153,649千円
リース資産	1,452千円	2,830千円

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	132,559千円	93,374千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
建物	879千円	18,278千円
器具備品	119千円	28,604千円
リース資産	5,377千円	-千円
ソフトウェア	1,596千円	7,610千円
ソフトウェア仮勘定	102,695千円	-千円

2 減損損失

前事業年度において、次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。

当事業年度において、次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
-	その他	のれん	28,097,346

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。

当社は、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に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 本社移転費用

前事業年度の本社移転費用は、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。

当事業年度の本社移転費用は、本社移転に伴うものであり、主に設備撤去費用、引越費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

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
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)

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1年以内	1,618,641	1,194,699
1年超	5,844,934	3,497,258
合計	7,463,576	4,691,958

(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。

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、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(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	-

当事業年度(2021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	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

(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)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	45,369	39,809
合計	45,369	39,809
子会社株式		
非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	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おりません。

また時価をもって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(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	-	-

当事業年度(2021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	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(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	6,994,762	6,729,039	265,723
小計	6,994,762	6,729,039	265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、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 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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
1,978,622	162,941	34,473

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(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 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,418,601	5,299,814
勤務費用	523,396	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	195	67,476
退職給付の支払額	349,050	585,151
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	1,707,062	-
退職給付債務の期末残高	5,299,814	5,258,448

(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 (2020年 3月31日)	当事業年度 (2021年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
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	5,299,814	5,258,448

(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 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
勤務費用	492,511	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	195	67,476
その他	304,842	246,359
確定給付制度に係る退職給付費用	797,158	790,144

(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 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
割引率	0.000%	0.020%

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248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,622,803	1,610,136
賞与引当金	530,059	464,389
調査費	178,573	247,208
未払金	162,557	206,090
未払事業税	46,423	66,891
ソフトウェア償却	91,937	90,431
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	150,771	131,391
その他	88,250	35,930
繰延税金資産小計	2,986,254	2,967,346
評価性引当額（注）	193,485	218,966
繰延税金資産合計	2,792,768	2,748,380
繰延税金負債		
無形固定資産	5,445,817	4,798,732
その他有価証券評価差額金	310,488	516,605
繰延税金負債合計	5,756,306	5,315,338
繰延税金資産（負債）の純額	2,963,538	2,566,958

（注）評価性引当額が25,480千円増加しております。この増加の内容は、主としてその他有価証券評価差額金に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため記載を省略しております。
（調整）		
評価性引当額の増減	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	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

（セグメント情報等）

前事業年度(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021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	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	3,369.33円	2,510.93円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	17.09円	854.27円

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後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。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
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又は 当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

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

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(2019年4月1日付)に伴って発生したのれんについて、2021年3月期決算において28,097,346千円の減損損失を計上しました。

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(2021年3月末現在)

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

[参考情報：再信託受託会社の概要]

・ 名称 株式会社日本カストディ銀行

- ・ 資本金の額 51,000百万円(2021年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 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(2021年3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。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)
該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべき旨を記載することがあります。
- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。

5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場

合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021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2021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、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10月26日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2021年9月15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10月26日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2021年9月15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10月26日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2021年9月15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10月26日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2021年9月15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10月26日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2020年9月16日から2021年9月15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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2021年9月15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。