【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年12月7日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年9月11日至 2021年9月10日)
【ファンド名】	三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド
【発行者名】	三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田　隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【事務連絡者氏名】	土屋　裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマークの詳細については、後述の「２ 投資方針」をご参照ください。

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

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。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	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

≪商品分類表≫

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （部分ヘッジ） なし	日経225 TOPIX その他 （合成指数）

（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10月 3日　　信託契約締結、設定、運用開始。

（３）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」

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

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

※委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（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ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更

（ハ）大株主の状況

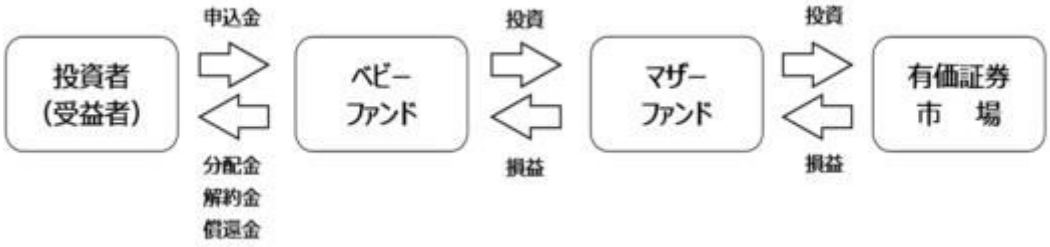
（2021年9月30日現在）

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

ハ　ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

マザーファンドおよび対象指数	基本資産配分比率

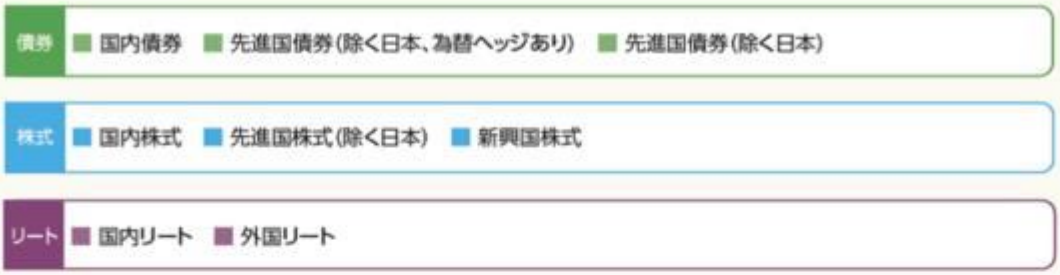
国内債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ（総合）	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	20%
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号） 対象指数：ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）	10%
外国株式インデックス・マザーファンド 対象指数：ＭＳＣＩコクサイインデックス（配当込み、円ベース）	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド 対象指数：ＭＳＣＩエマージング・マーケッ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

（ハ）実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

ファンドの特色

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



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

［各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率］

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

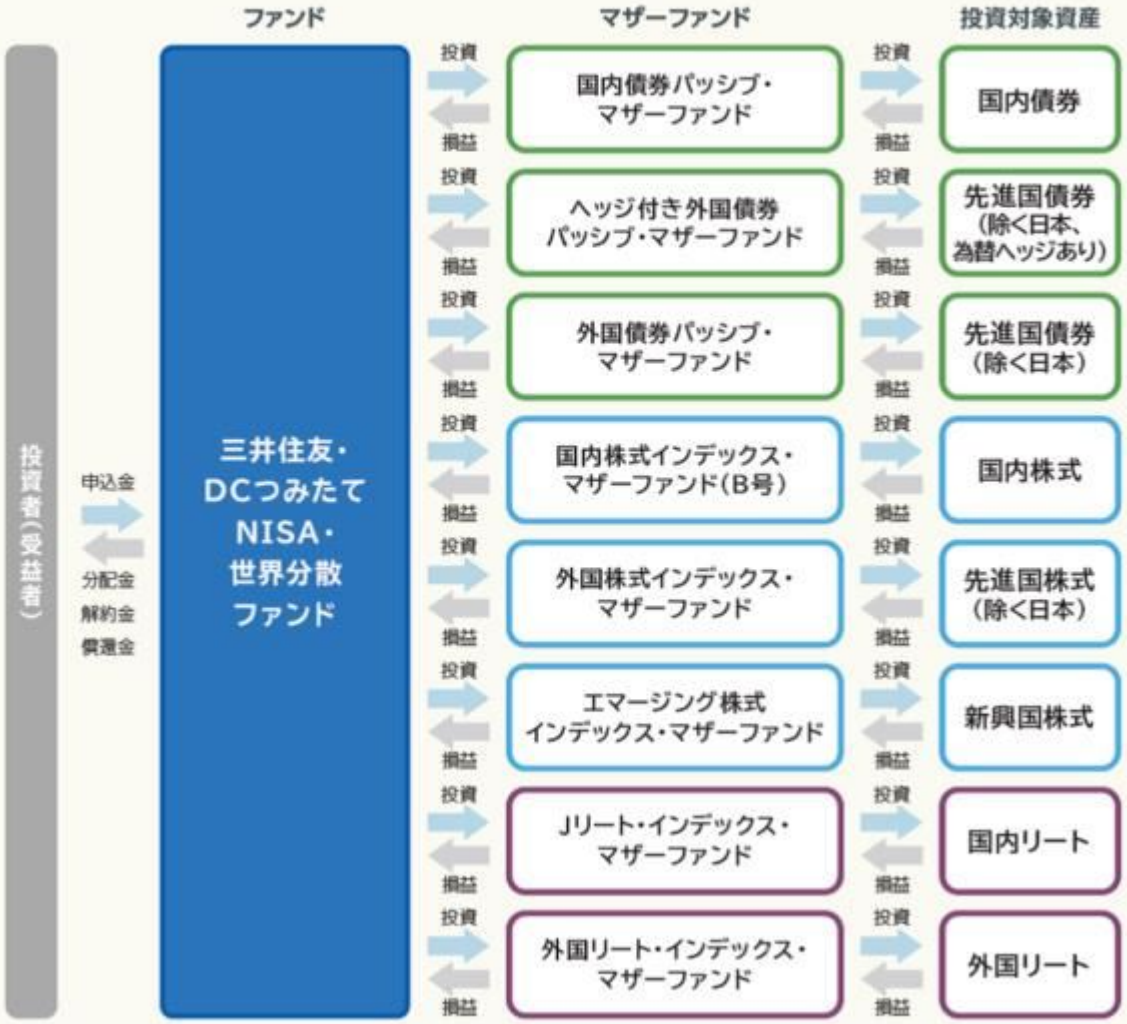
3 実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。

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

NOMURA-BPI（総合）は野村證券株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、TOPIX（東証株価指数）および東証REIT指数は株式会社東京証券取引所、MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが、それぞれ公表している指数で各社の知的財産です。
上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

ファンドのしくみ

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



各マザーファンドの投資方針等

▶債券

国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	• NOMURA−BPI(総合)の動きと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、為替ヘッジあり）…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	• FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。 • ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 • 保有する外貨建資産については、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%

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	• FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。 • ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 • 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

▶株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式*に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指します。 *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	• 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きと連動する投資成果を目指します。 • 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	• 主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きと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%

▶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	・東証REIT指数(配当込み)の動きと連動する投資成果を目指します。 ・日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。
信託財産留保額	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	・S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きと連動する投資成果を目指します。 ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)等を主要投資対象とします。 ・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%

（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券
２．デリバティブ取引にかかる権利
３．約束手形
４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

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

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

ます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

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

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

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定めるものをいいます。）

20. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

１．預金

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

３．コール・ローン

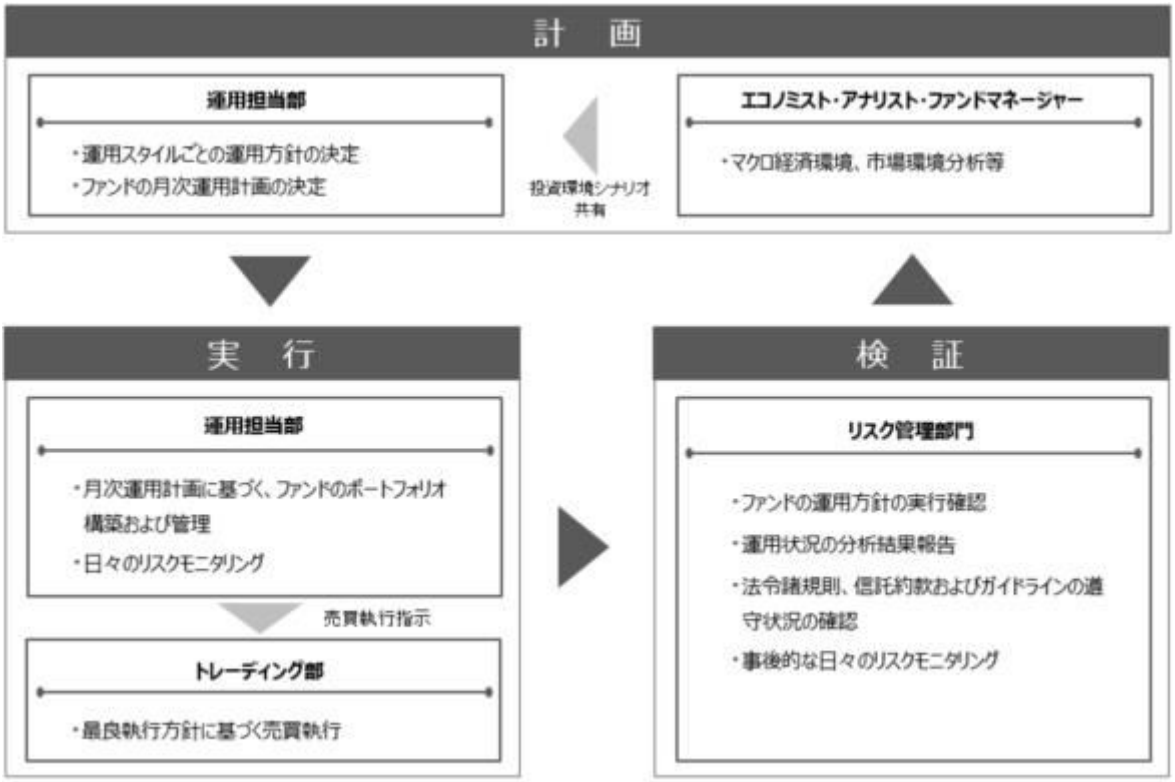
４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

６．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（３）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制



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

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

（４）【分配方針】

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

イ　分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
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】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ　株式への実質投資割合には制限を設けません。
※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドに

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

ロ　外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ハ　投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

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

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

II　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ　投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ハ　信用取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

ニ　先物取引等の指図

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

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

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

ホ　スワップ取引の指図

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

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

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

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

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

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

ヘ　金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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

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

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

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

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

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

（ト）「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

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

（リ）「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

ト　有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

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

チ　有価証券の空売りの指図

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

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

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

リ　有価証券の借入れの指図

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

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ル　外国為替予約取引の指図

（イ）委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ヲ　資金の借入れ

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

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

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

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

３．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

III　法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

１．株券または新株引受権証書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
９．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

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

（ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

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

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

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（ホ）同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

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

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

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

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

（外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

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

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

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

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

（国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

＊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。

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

１．株券または新株引受権証書
２．国債証券
３．特別の法律により法人の発行する債券
４．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
５．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
６．外国法人が発行する譲渡性預金証書
７．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ハ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

１．株券または新株引受権証書
２．国債証券
３．特別の法律により法人の発行する債券
４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
５．コマーシャル・ペーパー
６．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
７．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
８．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
９．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
10．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
11．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13．外国法人が発行する譲渡性預金証書
14．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託

の受益証券に表示されるべきもの

16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

（エマージング株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

（ハ）外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

ます。）

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

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

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

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

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

（Ｊリート・インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

（イ）東証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。

（ロ）不動産投資信託（ＲＥＩＴ）などへの投資にあたっては、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。

（ハ）不動産投資信託（ＲＥＩＴ）の組入比率は、原則として高位を保ちます。

（ニ）運用の効率化を図るため、東証ＲＥＩＴ指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証ＲＥＩＴ指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

２．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

５．投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

６．外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

（ロ）株式への投資は行いません。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

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

る目的以外には利用しません。

（外国リート・インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

（ハ）不動産投資信託（ＲＥＩＴ）の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

２．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

６．外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

（ロ）株式への投資は行いません。

（ハ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。
投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。
当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

（ニ）信用リスク

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

（ホ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。
先進国債券（除く日本、為替ヘッジあり）は、実質外貨建資産に対し原則として対円での為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。

（ヘ）カントリーリスク

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

ます。

（ト）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。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）合成指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、合成指数の動きに連動しないことがあります。

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

（リ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

（ヌ）換金制限等に関する留意点

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

（ル）収益分配金に関する留意事項

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

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

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

ロ　投資リスクの管理体制

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

［ ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 ］

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

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

［ ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 ］

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

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

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX（配当込み） 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所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	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース） J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について
（イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあた

ります。

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

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

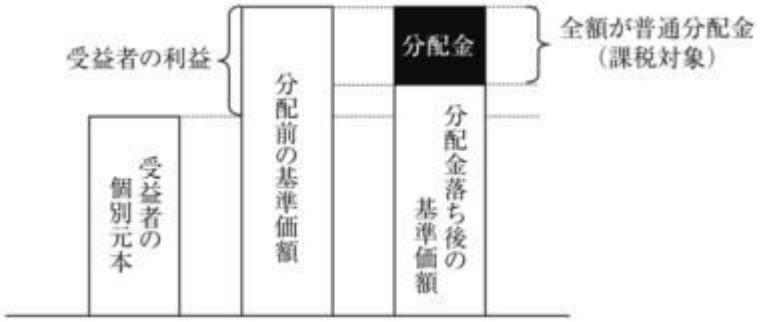
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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

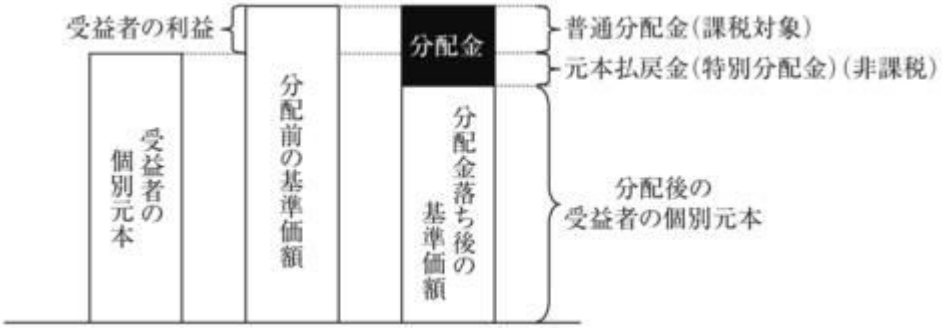
ハ　収益分配金の課税について

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

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



②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



※上記①、②の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

ニ　個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

ｉ．収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および

地方税５％）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

ⅱ．一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、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ます。）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。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをＮＩＳＡ、ジュニアＮＩＳＡおよびつみたてＮＩＳＡでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

	非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	一定の要件を満たした公募株式投資信託（新たに積立投資が必要）	公募株式投資信託（新たに購入が必要）	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象となる方	20歳以上の日本居住者（専用口座が開設される年の1月1日現在）		0～19歳の日本居住者（専用口座が開設される年の1月1日現在）
非課税の期間	最長20年間（投資期間は2042年まで）	最長5年間（投資期間は2023年まで）	
利用できる限度額	40万円／年（最大800万円）	120万円／年（最大600万円）	80万円／年（最大400万円）
留意事項	つみたてNISA ⇔ NISA	同一年において、つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。	

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

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

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、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・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

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（%）
親投資信託受益証券	日本	1,021,189,834	99.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,924,202	0.96
合計（純資産総額）		1,031,114,036	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

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	外国債券パッシブ・マザーファンド	105,129,423	1.9723	207,352,003	1.9635	206,421,622	20.02
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	37,393,655	5.5397	207,149,962	5.4560	204,019,781	19.79
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	121,494,195	1.2828	155,853,988	1.2804	155,561,167	15.09
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	58,416,135	2.6470	154,625,788	2.6014	151,963,733	14.74
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）	30,486,956	3.4663	105,675,800	3.3910	103,381,267	10.03
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	59,558,650	1.7216	102,537,801	1.6859	100,409,928	9.74
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	18,303,885	2.7821	50,922,470	2.7166	49,724,333	4.82

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	33,167,414	1.5184	50,362,946	1.4987	49,708,003	4.82

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(%)
親投資信託受益証券	99.04
合　計	99.04

②【投資不動産物件】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

年月日	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期　(2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期　(2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期　(2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
第4期　(2021年 9月10日)	1,014,406,357	1,014,406,357	12,869	12,869
2020年 9月末日	559,124,971	-	10,614	-
10月末日	572,186,799	-	10,450	-
11月末日	625,796,412	-	11,123	-
12月末日	650,021,027	-	11,314	-
2021年 1月末日	683,642,400	-	11,500	-
2月末日	719,601,553	-	11,717	-
3月末日	773,967,859	-	12,156	-
4月末日	811,211,473	-	12,357	-
5月末日	852,210,968	-	12,495	-
6月末日	899,683,144	-	12,676	-

7月末日	962,612,257	-	12,685	-
8月末日	1,005,100,560	-	12,817	-
9月末日	1,031,114,036	-	12,704	-

②【分配の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	-
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	-
第3期	2019年 9月11日～2020年 9月10日	-
第4期	2020年 9月11日～2021年 9月10日	-

③【収益率の推移】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

	収益率（%）
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7
第4期	20.0

（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。

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

（１）投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

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

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

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
	ジャージィー	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

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

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	４２７　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	１４７　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	１４６　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	３６３　１０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	４２５　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	３６０　１０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	１４５　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	３３０　１０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	１４４　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	３５８　１０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	３５６　１０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	３５７　１０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	６９　２０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	３５９　１０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	６４　２０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	６５　２０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	３６１　１０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	３２９　１０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	３６２　１０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	８４　２０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	１４　３０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	１４８　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	３５４　１０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	７０　２０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	３３３　１０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	８８　２０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	３３８　１０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	３４４　１０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	３５５　１０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	９２　２０年国債	734,000,000	112.23	823,753,520	111.40	817,646,640	2.100	2026/12/20	0.60

ロ　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

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

ロ　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

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

ロ　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

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	ＳＭＣ	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

ロ　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-CL 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-CL 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-CL 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

ロ　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・ライフサイエンス	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

ロ　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	ＧＬＰ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	アクティビア・プ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	ＮＴＴ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

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	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

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	99.13
合　計	99.13

②投資不動産物件

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Ｊリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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・シュケル	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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

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－ＥＵ	ＦＴＳＥ　１００　ＩＤＸ　ＦＵＴ　ＤＥＣ２１ 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	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯ　ＳＴＯＸＸ　５０　ＤＥＣ２１ 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＆Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＤＥＣ２１ 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	ＳＰＩ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ ＤＥＣ２１ 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・シュケル	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	ＩＣＥ－ＵＳ	ＭＳＣＩＥ　２１１２ 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	ＴＲＥＩＴ　先物　０３１２月　２０２１年１２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。

≪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

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
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

■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.96
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	20.02
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	19.79
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.09
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	14.74
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	10.03
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.74
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	4.82
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4.82

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	80.93
特殊債券	日本	8.05
地方債証券	日本	6.78
社債券	日本	3.68
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.42
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	45.86
	フランス	10.07
	イタリア	9.34
	ドイツ	7.43
	イギリス	5.99
	スペイン	5.87
	ベルギー	2.33
	その他	12.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.02
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	T 0.125 01/31/23	0.125	2023/01/31	0.71
アメリカ	国債証券	T 0.125 05/15/23	0.125	2023/05/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 0.5 03/31/25	0.500	2025/03/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 0.25 03/15/24	0.250	2024/03/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.5 06/30/27	0.500	2027/06/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/15/24	0.125	2024/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.625 05/15/31	1.625	2031/05/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.875 11/15/30	0.875	2030/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/28/23	0.125	2023/02/28	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25 08/31/24	1.250	2024/08/31	0.50

外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	45.86
	フランス	10.02
	イタリア	9.30
	ドイツ	7.37
	イギリス	5.99
	スペイン	5.95
	ベルギー	2.35
	その他	12.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.625 05/15/26	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債証券	T 2.25 03/31/26	2.250	2026/03/31	0.99
アメリカ	国債証券	T 2.875 05/15/28	2.875	2028/05/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.5 02/28/26	2.500	2026/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.125 02/15/31	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.625 08/15/30	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.125 08/15/23	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25 06/15/23	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.125 02/15/24	0.125	2024/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.375 09/30/27	0.375	2027/09/30	0.52

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.88
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　1.91%

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

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	66.82
	イギリス	4.07
	カナダ	3.43
	スイス	3.17
	フランス	3.11
	ドイツ	2.75
	その他	12.03
投資証券	アメリカ・その他	2.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.31
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　2.30%

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

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	16.11
	台湾	10.98
	韓国	9.65
	インド	9.40
	中国	4.86
	その他	13.92
投資証券	アメリカ・その他	7.69
投資信託受益証券	香港	3.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23.55
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　23.52%

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

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.95
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　0.55%

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

■外国リート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

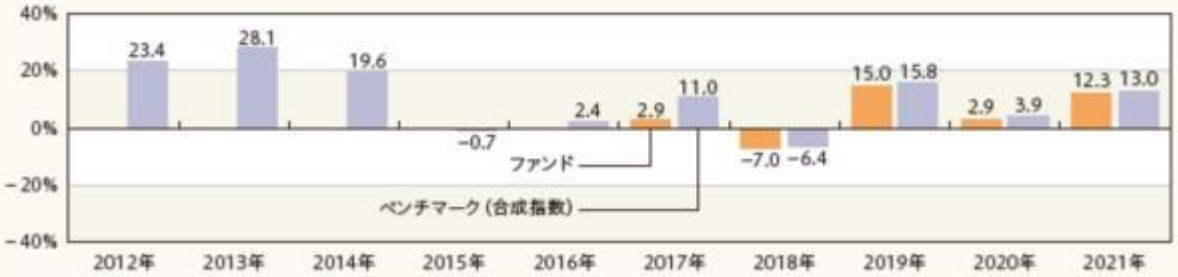
資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	75.01
	オーストラリア	6.75
	イギリス	5.49
	シンガポール	3.46
	カナダ	1.97
	フランス	1.94
	香港	1.43
	その他	3.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.87
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
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)



※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10月3日)から年末までの騰落率を表示しています。
※2021年の収益率は、年初から2021年9月30日までの騰落率を表示しています。
※ベンチマーク(合成指数)の情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

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

（ロ）原則として午後３時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを

当日の申込受付分とします。
なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受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
・ロンドンの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日
・ロンドンの銀行の休業日

（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）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、解約請求の受付けは行いません。
・ニューヨークの取引所の休業日
・ロンドンの取引所の休業日
・ニューヨークの銀行の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
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付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

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

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法

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

照会先の名称	コールセンター※	ホームページ
三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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10月3日から下記「（５）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

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

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

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

ｄ．書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

ｅ．上記ｂ～ｄまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｂ～ｄまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

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

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

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

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

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に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ます。）に支払われます。

ハ　信託約款の変更等

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

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

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

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

（ホ）上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録によ

り同意の意思表示をしたときには適用しません。

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

ニ　反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ　販売会社との契約の更改等

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

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト　公告

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

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

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

チ　運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

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

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

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

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、受益者は

その権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

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

ホ　帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期（2020年 9月11日から2021年9月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2020年 9月10日現在）	第4期 （2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	3,771,984
コール・ローン	6,259,369	7,308,256
親投資信託受益証券	540,003,284	1,005,072,758
流動資産合計	546,262,653	1,016,152,998
資産合計	546,262,653	1,016,152,998
負債の部		
流動負債		
未払解約金	938,247	697,032
未払受託者報酬	50,349	97,172
未払委託者報酬	478,288	923,083
未払利息	18	16
その他未払費用	15,133	29,338
流動負債合計	1,482,035	1,746,641
負債合計	1,482,035	1,746,641
純資産の部		
元本等		
元本	508,204,609	788,236,116
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,576,009	226,170,241
元本等合計	544,780,618	1,014,406,357
純資産合計	544,780,618	1,014,406,357
負債純資産合計	546,262,653	1,016,152,998

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2019年 9月11日 至　2020年 9月10日	第4期 自　2020年 9月11日 至　2021年 9月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	15,823,298	135,426,773
営業収益合計	15,823,298	135,426,773
営業費用		
支払利息	2,606	6,989
受託者報酬	89,556	166,314
委託者報酬	850,689	1,579,876
その他費用	28,213	50,718
営業費用合計	971,064	1,803,897
営業利益又は営業損失（△）	14,852,234	133,622,876
経常利益又は経常損失（△）	14,852,234	133,622,876
当期純利益又は当期純損失（△）	14,852,234	133,622,876
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（△）	△92,594	6,726,357
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,511,897	36,576,009
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,878,243	69,416,188
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	11,878,243	69,416,188
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,758,959	6,718,475
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,758,959	6,718,475
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,576,009	226,170,241

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第4期 自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（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		第3期 （2020年 9月10日現在）	第4期 （2021年 9月10日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数		508,204,609口	788,236,116口
２．1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0720円	1口当たり純資産額　1.2869円
	(10,000口当たりの純資産額	10,720円)	(10,000口当たりの純資産額　12,869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11日 至 2020年 9月10日	第4期 自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10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（8,343,778円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（6,601,050円）、収益調整金（13,722,287円）、および分配準備積立金（7,908,894円）より、分配対象収益は36,576,009円（1万口当たり719.67円）でありますが、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（14,720,294円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（112,176,225円）、収益調整金（79,128,854円）、および分配準備積立金（20,144,868円）より、分配対象収益は226,170,241円（1万口当たり2,869.28円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第4期 自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第4期 （2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第3期（自 2019年 9月11日　至 2020年 9月10日）

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

第4期（自 2020年 9月11日　至 2021年 9月10日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	132,052,645円
合計	132,052,645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11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項　目	第3期 （2020年 9月10日現在）	第4期 （2021年 9月10日現在）
期首元本額	283,071,447円	508,204,609円
期中追加設定元本額	284,669,114円	357,578,274円
期中一部解約元本額	59,535,952円	77,546,767円

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	30,472,204	105,625,800	
	外国株式インデックス・マザーファンド	35,998,838	199,429,962	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	32,203,455	48,900,946	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	101,717,793	200,618,003	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	117,119,573	150,240,988	
	Ｊリート・インデックス・マザーファンド	17,827,319	49,588,470	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	56,813,655	150,402,788	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	58,243,277	100,265,801	
合計		450,396,114	1,005,072,758	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 9月10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	163,328,371
コール・ローン	440,038,057	316,450,315
国債証券	104,245,403,390	111,186,696,550
地方債証券	8,890,158,495	8,765,062,560
特殊債券	12,898,258,951	11,461,135,766
社債券	5,555,408,000	4,847,751,000
未収入金	401,905,000	234,494,000
未収利息	442,435,604	414,991,081
前払費用	7,582,536	9,522,707
流動資産合計	132,881,190,033	137,399,432,350
資産合計	132,881,190,033	137,399,432,350
負債の部		
流動負債		
未払金	401,840,000	252,342,000
未払解約金	91,523,000	950,000
未払利息	1,286	698
その他未払費用	7,962	10,575
流動負債合計	493,372,248	253,303,273
負債合計	493,372,248	253,303,273
純資産の部		
元本等		
元本	103,519,056,378	106,912,762,885
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	28,868,761,407	30,233,366,192
元本等合計	132,387,817,785	137,146,129,077
純資産合計	132,387,817,785	137,146,129,077
負債純資産合計	132,881,190,033	137,399,432,350

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日

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

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	103,519,056,378口	106,912,762,885口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2789円 (10,000口当たりの純資産額　12,789円)	1口当たり純資産額　1.2828円 (10,000口当たりの純資産額　12,828円)

（金融商品に関する注記）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係る	(1)金融商品の内容

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）

１.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、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11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	112,020,381,328円
同期中における追加設定元本額	29,465,214,127円
同期中における一部解約元本額	37,966,539,077円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	5,404,106,258円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	9,352,829,017円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,998,420,713円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	693,533,147円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	46,082,897円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	181,308,582円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	374,855,441円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	438,754,213円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	177,137,533円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	308,707,190円

三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	129,902,142円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,341,808,057円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	382,833,387円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	16,075,994円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	21,159,651円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	824,764,564円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	250,675,696円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	361,732,503円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	76,188,990円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	20,708,587円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	63,782,215円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	28,011,160円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	58,057,747円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	12,850,189円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,598,454円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,903,494,951円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	15,454,233,129円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,719,111,006円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	16,611,697,542円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	316,664,963円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	567,607,238円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,942,066円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	243,859,822円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	117,573,504円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,922,462,329円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,101,626,336円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,542,605,879円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	9,356,692,074円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ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・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,358,855,987円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	465,430,954円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	622,224,587円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	179,522,478円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,582,648円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,689,664,549円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,273,857,452円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	868,223,966円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	211,492,420円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	19,262,253円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	302,431,646円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,618,673,320円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	81,344,659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＞	297,899,914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＞	926,069,950円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	1,204,188,532円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII＜適格機関投資家限定＞	2,927,220,580円

合計	103,519,056,378円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	103,519,056,378円
同期中における追加設定元本額	22,245,124,587円
同期中における一部解約元本額	18,851,418,080円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	6,429,803,140円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	11,214,547,439円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,529,755,566円
ＳＭＡＭ・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・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	43,884,113円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	195,944,976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）	468,973,163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）	671,004,512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）	316,080,055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）	457,744,477円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	140,646,417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ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	40,627,015円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,610,363,164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）	177,111,519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・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	117,119,573円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	101,694,341円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	177,170,415円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	51,142,584円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,576,866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＞	13,700,918,277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＞	2,458,947,061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＞	1,544,859,838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II＜適格機関投資家限定＞	5,225,285,939円
合計	106,912,762,885円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４２５回利付国債（２年）	2,220,000,000	2,225,150,400	
	第４２６回利付国債（２年）	50,000,000	50,121,500	
	第４２７回利付国債（２年）	3,300,000,000	3,308,382,000	
	第１３７回利付国債（５年）	100,000,000	100,455,000	
	第１３８回利付国債（５年）	600,000,000	603,066,000	
	第１３９回利付国債（５年）	260,000,000	261,474,200	

第１４０回利付国債（５年）	600,000,000	603,744,000	
第１４１回利付国債（５年）	795,000,000	800,413,950	
第１４２回利付国債（５年）	760,000,000	765,608,800	
第１４３回利付国債（５年）	770,000,000	775,975,200	
第１４４回利付国債（５年）	1,250,000,000	1,260,400,000	
第１４５回利付国債（５年）	1,310,000,000	1,321,632,800	
第１４６回利付国債（５年）	1,690,000,000	1,705,581,800	
第１４７回利付国債（５年）	1,700,000,000	1,708,857,000	
第１４８回利付国債（５年）	380,000,000	382,002,600	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	58,064,400	
第２回利付国債（４０年）	242,000,000	340,682,760	
第３回利付国債（４０年）	185,000,000	261,530,800	
第４回利付国債（４０年）	247,000,000	350,488,060	
第５回利付国債（４０年）	245,000,000	335,632,850	
第６回利付国債（４０年）	240,000,000	323,546,400	
第７回利付国債（４０年）	275,000,000	356,815,250	
第８回利付国債（４０年）	310,000,000	376,572,500	
第９回利付国債（４０年）	513,000,000	467,614,890	
第１０回利付国債（４０年）	470,000,000	500,291,500	
第１１回利付国債（４０年）	370,000,000	381,869,600	
第１２回利付国債（４０年）	380,000,000	354,258,800	
第１３回利付国債（４０年）	475,000,000	440,828,500	
第１４回利付国債（４０年）	230,000,000	227,881,700	
第３２９回利付国債（１０年）	950,000,000	965,475,500	
第３３０回利付国債（１０年）	1,285,000,000	1,308,926,700	
第３３２回利付国債（１０年）	793,000,000	805,981,410	
第３３３回利付国債（１０年）	815,000,000	829,800,400	
第３３４回利付国債（１０年）	315,000,000	321,340,950	
第３３５回利付国債（１０年）	90,000,000	91,704,600	
第３３６回利付国債（１０年）	340,000,000	346,973,400	
第３３７回利付国債（１０年）	120,000,000	121,672,800	
第３３８回利付国債（１０年）	805,000,000	819,771,750	
第３３９回利付国債（１０年）	785,000,000	800,440,950	
第３４０回利付国債（１０年）	770,000,000	786,170,000	
第３４１回利付国債（１０年）	557,000,000	566,914,600	
第３４２回利付国債（１０年）	350,000,000	353,332,000	

第３４３回利付国債（１０年）	310,000,000	313,118,600	
第３４４回利付国債（１０年）	811,000,000	819,385,740	
第３４５回利付国債（１０年）	758,000,000	766,027,220	
第３４６回利付国債（１０年）	740,000,000	748,206,600	
第３４７回利付国債（１０年）	800,000,000	809,280,000	
第３４８回利付国債（１０年）	345,000,000	349,071,000	
第３４９回利付国債（１０年）	370,000,000	374,428,900	
第３５０回利付国債（１０年）	550,000,000	556,847,500	
第３５１回利付国債（１０年）	380,000,000	384,784,200	
第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	800,033,000	
第３５３回利付国債（１０年）	640,000,000	648,179,200	
第３５４回利付国債（１０年）	835,000,000	845,721,400	
第３５５回利付国債（１０年）	810,000,000	820,108,800	
第３５６回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,083,353,600	
第３５７回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,082,872,100	
第３５８回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,112,672,000	
第３５９回利付国債（１０年）	1,060,000,000	1,071,161,800	
第３６０回利付国債（１０年）	1,560,000,000	1,574,773,200	
第３６１回利付国債（１０年）	990,000,000	998,246,700	
第３６２回利付国債（１０年）	930,000,000	936,612,300	
第３６３回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,548,978,200	
第２回利付国債（３０年）	510,000,000	615,360,900	
第４回利付国債（３０年）	340,000,000	430,576,000	
第５回利付国債（３０年）	290,000,000	350,752,100	
第７回利付国債（３０年）	474,000,000	586,072,560	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	274,917,600	
第１０回利付国債（３０年）	535,000,000	595,562,000	
第１１回利付国債（３０年）	430,000,000	509,421,000	
第１２回利付国債（３０年）	590,000,000	728,408,100	
第１４回利付国債（３０年）	692,000,000	884,895,000	
第１６回利付国債（３０年）	465,000,000	604,155,900	
第１８回利付国債（３０年）	540,000,000	691,956,000	
第１９回利付国債（３０年）	470,000,000	604,260,200	
第２１回利付国債（３０年）	345,000,000	446,122,950	
第２２回利付国債（３０年）	315,000,000	417,192,300	
第２３回利付国債（３０年）	329,000,000	437,221,260	

第２４回利付国債（３０年）	310,000,000	413,059,500	
第２５回利付国債（３０年）	380,000,000	496,390,200	
第２６回利付国債（３０年）	363,000,000	480,641,040	
第２７回利付国債（３０年）	420,000,000	565,551,000	
第２８回利付国債（３０年）	386,000,000	522,501,180	
第２９回利付国債（３０年）	177,000,000	237,764,100	
第３０回利付国債（３０年）	442,000,000	588,611,400	
第３１回利付国債（３０年）	325,000,000	428,727,000	
第３２回利付国債（３０年）	390,000,000	523,146,000	
第３３回利付国債（３０年）	378,000,000	488,345,760	
第３４回利付国債（３０年）	457,000,000	609,212,990	
第３５回利付国債（３０年）	350,000,000	455,059,500	
第３６回利付国債（３０年）	90,000,000	117,412,200	
第３７回利付国債（３０年）	355,000,000	457,800,900	
第３８回利付国債（３０年）	360,000,000	458,478,000	
第３９回利付国債（３０年）	300,000,000	388,938,000	
第４０回利付国債（３０年）	270,000,000	344,749,500	
第４１回利付国債（３０年）	270,000,000	339,684,300	
第４２回利付国債（３０年）	260,000,000	327,444,000	
第４３回利付国債（３０年）	305,000,000	384,525,700	
第４４回利付国債（３０年）	300,000,000	378,612,000	
第４５回利付国債（３０年）	325,000,000	396,457,750	
第４６回利付国債（３０年）	315,000,000	384,514,200	
第４７回利付国債（３０年）	340,000,000	423,041,600	
第４８回利付国債（３０年）	405,000,000	486,287,550	
第４９回利付国債（３０年）	345,000,000	414,441,600	
第５０回利付国債（３０年）	335,000,000	356,557,250	
第５１回利付国債（３０年）	345,000,000	326,911,650	
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	47,730,600	
第５５回利付国債（３０年）	325,000,000	344,503,250	
第５６回利付国債（３０年）	430,000,000	455,503,300	
第５７回利付国債（３０年）	355,000,000	375,799,450	
第５８回利付国債（３０年）	420,000,000	444,297,000	
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	410,320,200	
第６１回利付国債（３０年）	345,000,000	354,746,250	
第６２回利付国債（３０年）	105,000,000	102,519,900	
第６３回利付国債（３０年）	360,000,000	341,640,000	
第６４回利付国債（３０年）	325,000,000	307,563,750	
第６５回利付国債（３０年）	325,000,000	307,063,250	
第６６回利付国債（３０年）	310,000,000	292,410,600	
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	355,614,000	
第７０回利付国債（３０年）	360,000,000	365,360,400	
第７１回利付国債（３０年）	370,000,000	374,613,900	
第６４回利付国債（２０年）	1,025,000,000	1,066,902,000	
第６５回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,066,736,400	
第６９回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,076,987,400	
第７０回利付国債（２０年）	780,000,000	834,568,800	
第７２回利付国債（２０年）	753,000,000	803,646,780	
第７４回利付国債（２０年）	664,000,000	712,365,760	
第７５回利付国債（２０年）	490,000,000	528,303,300	
第７８回利付国債（２０年）	590,000,000	634,975,700	
第８２回利付国債（２０年）	620,000,000	675,446,600	
第８４回利付国債（２０年）	850,000,000	926,916,500	
第８５回利付国債（２０年）	645,000,000	709,680,600	
第８８回利付国債（２０年）	742,000,000	827,493,240	
第８９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,208,600	
第９０回利付国債（２０年）	580,000,000	647,291,600	
第９２回利付国債（２０年）	734,000,000	819,305,480	
第９３回利付国債（２０年）	632,000,000	705,400,480	
第９５回利付国債（２０年）	305,000,000	347,358,400	
第９７回利付国債（２０年）	677,000,000	770,818,660	
第９９回利付国債（２０年）	693,000,000	788,426,100	
第１００回利付国債（２０年）	207,000,000	237,985,830	
第１０１回利付国債（２０年）	355,000,000	412,794,000	
第１０２回利付国債（２０年）	457,000,000	534,109,610	
第１０５回利付国債（２０年）	390,000,000	449,853,300	
第１０６回利付国債（２０年）	370,000,000	429,396,100	

第１０７回利付国債（２０年）	378,000,000	437,924,340	
第１０８回利付国債（２０年）	390,000,000	446,128,800	
第１０９回利付国債（２０年）	340,000,000	390,452,600	
第１１１回利付国債（２０年）	386,000,000	453,897,400	
第１１３回利付国債（２０年）	427,000,000	500,913,700	
第１１４回利付国債（２０年）	363,000,000	427,621,260	
第１１６回利付国債（２０年）	200,000,000	238,176,000	
第１１８回利付国債（２０年）	200,000,000	235,480,000	
第１１９回利付国債（２０年）	295,000,000	342,152,800	
第１２０回利付国債（２０年）	200,000,000	228,454,000	
第１２１回利付国債（２０年）	55,000,000	64,453,950	
第１２２回利付国債（２０年）	330,000,000	383,743,800	
第１２３回利付国債（２０年）	80,000,000	95,482,400	
第１２４回利付国債（２０年）	190,000,000	225,011,300	
第１２５回利付国債（２０年）	205,000,000	247,324,300	
第１２６回利付国債（２０年）	180,000,000	213,744,600	
第１２７回利付国債（２０年）	145,000,000	170,807,100	
第１２８回利付国債（２０年）	65,000,000	76,799,450	
第１３０回利付国債（２０年）	155,000,000	182,131,200	
第１３１回利付国債（２０年）	380,000,000	442,726,600	
第１３２回利付国債（２０年）	450,000,000	525,582,000	
第１３３回利付国債（２０年）	190,000,000	223,852,300	
第１３４回利付国債（２０年）	200,000,000	236,238,000	
第１３５回利付国債（２０年）	155,000,000	181,466,250	
第１３６回利付国債（２０年）	120,000,000	139,237,200	
第１３７回利付国債（２０年）	25,000,000	29,339,000	
第１３９回利付国債（２０年）	20,000,000	23,257,600	
第１４０回利付国債（２０年）	340,000,000	399,942,000	
第１４１回利付国債（２０年）	200,000,000	235,788,000	
第１４２回利付国債（２０年）	110,000,000	130,909,900	
第１４３回利付国債（２０年）	190,000,000	222,317,100	
第１４４回利付国債（２０年）	90,000,000	104,283,900	
第１４５回利付国債（２０年）	110,000,000	130,317,000	
第１４６回利付国債（２０年）	145,000,000	172,144,000	
第１４７回利付国債（２０年）	220,000,000	259,052,200	
第１４８回利付国債（２０年）	309,000,000	360,686,430	

	第１４９回利付国債（２０年）	675,000,000	789,149,250	
	第１５０回利付国債（２０年）	261,000,000	302,274,540	
	第１５１回利付国債（２０年）	690,000,000	782,218,500	
	第１５２回利付国債（２０年）	265,000,000	300,661,050	
	第１５３回利付国債（２０年）	267,000,000	306,967,230	
	第１５４回利付国債（２０年）	580,000,000	659,541,200	
	第１５５回利付国債（２０年）	410,000,000	455,186,100	
	第１５６回利付国債（２０年）	420,000,000	430,327,800	
	第１５７回利付国債（２０年）	415,000,000	412,925,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	360,000,000	373,568,400	
	第１５９回利付国債（２０年）	418,000,000	439,514,460	
	第１６０回利付国債（２０年）	355,000,000	378,291,550	
	第１６１回利付国債（２０年）	350,000,000	367,465,000	
	第１６２回利付国債（２０年）	250,000,000	262,265,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	490,000,000	513,598,400	
	第１６４回利付国債（２０年）	415,000,000	428,060,050	
	第１６５回利付国債（２０年）	490,000,000	504,837,200	
	第１６６回利付国債（２０年）	295,000,000	313,343,100	
	第１６７回利付国債（２０年）	490,000,000	503,607,300	
	第１６８回利付国債（２０年）	330,000,000	332,996,400	
	第１６９回利付国債（２０年）	400,000,000	395,992,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	315,000,000	311,273,550	
	第１７１回利付国債（２０年）	425,000,000	419,190,250	
	第１７２回利付国債（２０年）	520,000,000	521,346,800	
	第１７３回利付国債（２０年）	515,000,000	515,448,050	
	第１７４回利付国債（２０年）	500,000,000	499,555,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	515,000,000	523,276,050	
	第１７６回利付国債（２０年）	540,000,000	548,283,600	
	第１７７回利付国債（２０年）	450,000,000	447,948,000	
国債証券合計		102,642,000,000	111,186,696,550	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	102,726,000	
	第１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	123,336,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,025,000	
	第８回東京都公募公債（３０年）	400,000,000	519,952,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	500,000,000	637,815,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	100,547,000	

第７１０回東京都公募公債	100,000,000	100,623,000	
平成２４年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,615,000	
平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,160,000	
平成２６年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	101,469,000	
平成２９年度第６回北海道公募公債（５年）	300,000,000	299,997,000	
第１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	107,066,000	
第３回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	107,947,000	
第７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,070,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	201,450,000	
第３７３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,604,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,536,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,067,000	
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	325,482,000	
第７回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	129,854,000	
平成２０年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	108,756,000	
平成２２年度第８回愛知県公募公債（２０年）	200,000,000	232,398,000	
平成２９年度第２回埼玉県公募公債（５年）	200,000,000	200,004,000	
平成２５年度第１１回福岡県公募公債	100,000,000	101,697,000	
平成２６年度第１０回福岡県公募公債	100,000,000	101,552,000	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,467,000	
第９回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	100,962,000	
第１１１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,392,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,089,000	
第１１３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,731,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,841,000	
第１１５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,786,000	
第１１８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,148,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,310,000	
第１７２回共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,705,000	
第１８３回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,464,000	
第１回名古屋市公募公債（２０年）	200,000,000	209,042,000	
第３回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	107,644,000	
第５回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	111,439,000	
第１回京都市公募公債（３０年）	100,000,000	134,291,000	
第７回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	116,322,000	

	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	100,931,000	
	第４回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,130,000	
	第９回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,189,000	
	第１４回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	114,815,000	
	第４７回横浜市公募公債（５年）	100,000,000	100,048,000	
	平成２６年度第４回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,485,000	
	平成２４年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	100,912,000	
	平成２３年度第９回福岡市公募公債	147,000,000	147,805,560	
	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		8,197,000,000	8,765,062,560	
特殊債券	第３回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	209,518,000	
	第３４回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,036,000	
	第３６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,289,000	
	第９回道路債券	100,000,000	128,529,000	
	第１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	150,796,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	438,858,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,775,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	347,304,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,068,000	
	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	231,894,000	
	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	132,524,000	
	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	349,725,000	
	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	118,065,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	404,292,000	
	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	116,244,000	
	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	118,601,000	
	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	232,434,000	
	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	203,352,000	

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	304,830,000	
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	189,000,000	
第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,712,000	
第３回公営企業債券（２０年）	100,000,000	101,559,000	
第５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,236,000	
第１７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	110,737,000	
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	112,080,000	
第２２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	112,994,000	
第２４回公営企業債券（２０年）	200,000,000	229,266,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,962,000	
第４５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,294,000	
第６１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,873,000	
第６２回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,020,000	
第６３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,662,000	
第６７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,535,000	
第１０１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,038,000	
第１０６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,888,000	
第３４２回東京交通債券	100,000,000	101,839,000	
第５１回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,060,000	
第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	9,609,000	9,619,473	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,529,000	11,791,745	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	9,969,000	9,982,059	
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,994,000	13,448,530	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	22,098,000	22,481,179	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,213,000	13,759,225	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	34,314,000	35,065,476	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,980,000	13,411,714	
第１１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,983,000	14,633,489	
第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	20,150,000	20,288,833	
第１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,789,000	17,726,665	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,716,000	36,898,247	

第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,487,000	56,584,432	
第２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,507,000	20,702,584	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,164,000	22,514,263	
第２９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,547,000	10,640,762	
第２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,762,000	25,437,458	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,408,000	25,036,026	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,803,000	12,011,913	
第３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,118,000	48,932,120	
第３５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,658,000	13,019,132	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,602,000	25,070,752	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,922,000	24,219,155	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,426,000	11,652,920	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,357,000	12,728,574	
第４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,396,000	24,028,627	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,298,000	31,023,652	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,584,000	24,963,664	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,704,000	47,187,754	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,443,000	23,628,888	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,353,000	11,636,030	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,720,000	53,336,644	
第５２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,591,000	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,084,000	12,433,831	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,276,000	76,246,843	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,440,000	36,329,034	
第５８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,125,000	40,245,512	
第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,730,000	77,915,652	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,112,000	119,099,018	
第６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,823,000	38,653,471	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,464,000	44,391,016	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,892,000	90,623,790	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,798,000	78,580,534	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,585,000	44,964,649	
第９５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,546,000	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,558,000	65,982,737	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,695,000	82,907,353	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,636,000	82,627,877	

	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,855,000	82,846,264	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,265,000	84,145,943	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,515,000	83,506,005	
	第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,023,000	85,241,333	
	第１３０回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	234,214,000	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,982,000	88,356,315	
	第１６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,392,000	99,598,285	
	第２２６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,030,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,302,000	22,711,241	
	第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,938,000	25,681,651	
	第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,966,000	12,260,004	
	第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,559,000	11,796,884	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	25,222,000	25,936,539	
	い第８１０号農林債	300,000,000	300,288,000	
	第１２回国際協力機構債券	100,000,000	100,690,000	
	第４５回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,906,000	
	第８５回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,315,000	
	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	101,558,000	
特殊債券合計		10,665,840,000	11,461,135,766	
社債券	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	200,000,000	201,082,000	
	第１３回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,481,000	
	第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,614,000	
	第３０回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,807,000	
	第５６回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	201,186,000	
	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	100,383,000	
	第１６回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,583,000	
	第２２回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,564,000	
	第６３回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,239,000	
	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	113,628,000	
	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	101,255,000	

	第８回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,544,000	
	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	101,274,000	
	第９回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	110,422,000	
	第１７回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,252,000	
	第９３回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	401,420,000	
	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	100,096,000	
	第５８回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	126,689,000	
	第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,306,000	
	第３８回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,712,000	
	第１１０回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	121,747,000	
	第１６９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	199,156,000	
	第４１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,437,000	
	第４２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,852,000	
	第４５回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	100,265,000	
	第２７回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,063,000	
	第５４６回中部電力株式会社社債	200,000,000	199,706,000	
	第４７２回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,153,000	
	第５０８回東北電力株式会社社債	200,000,000	203,444,000	
	第３７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,380,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,330,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	200,380,000	
	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	101,306,000	
社債券合計		4,700,000,000	4,847,751,000	
合計			136,260,645,876	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	28,244,153	28,230,847
金銭信託	-	46,197,872
コール・ローン	166,884,994	89,508,827
国債証券	22,544,039,146	25,996,834,784
派生商品評価勘定	146,340,301	76,050,089
未収入金	995,732	-
未収利息	133,939,108	103,268,257
前払費用	9,879,119	16,220,442
流動資産合計	23,030,322,553	26,356,311,118
資産合計	23,030,322,553	26,356,311,118
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	48,792,353	8,174,992
未払金	512,912	-
未払解約金	22,000,000	4,000,000
未払利息	487	197
その他未払費用	4,364	5,858
流動負債合計	71,310,116	12,181,047
負債合計	71,310,116	12,181,047
純資産の部		
元本等		
元本	14,934,455,373	17,348,369,874
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	8,024,557,064	8,995,760,197
元本等合計	22,959,012,437	26,344,130,071
純資産合計	22,959,012,437	26,344,130,071
負債純資産合計	23,030,322,553	26,356,311,118

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日

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

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	14,934,455,373口	17,348,369,874口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.5373円 (10,000口当たりの純資産額　15,373円)	1口当たり純資産額　1.5185円 (10,000口当たりの純資産額　15,185円)

（金融商品に関する注記）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係る	(1)金融商品の内容

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,692,931,748	-	22,595,383,800	97,547,948
	米ドル	9,866,560,212	-	9,911,097,600	△44,537,388
	カナダドル	439,984,922	-	437,231,400	2,753,522
	メキシコペソ	172,350,035	-	176,605,000	△4,254,965
	ユーロ	9,431,597,533	-	9,342,535,800	89,061,733
	英ポンド	1,506,705,928	-	1,467,468,800	39,237,128
	スウェーデンクローナ	73,333,936	-	72,597,200	736,736
	ノルウェークローネ	51,047,808	-	49,476,000	1,571,808
	デンマーククローネ	123,330,982	-	122,235,000	1,095,982
	ポーランドズロチ	154,996,078	-	151,823,600	3,172,478
	オーストラリアドル	562,178,910	-	554,780,400	7,398,510
	シンガポールドル	218,720,003	-	218,224,600	495,403
	イスラエルシュケル	92,125,401	-	91,308,400	817,001
合計		22,692,931,748	-	22,595,383,800	97,547,948

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	26,175,092,934	-	26,107,217,837	67,875,097
	米ドル	11,975,159,024	-	11,928,042,984	47,116,040
	カナダドル	517,271,409	-	513,864,150	3,407,259
	メキシコペソ	187,361,443	-	188,368,636	△1,007,193
	ユーロ	10,582,515,583	-	10,558,995,400	23,520,183
	英ポンド	1,636,445,041	-	1,642,201,150	△5,756,109
	スウェーデンクローナ	76,726,905	-	76,635,313	91,592
	ノルウェークローネ	63,160,376	-	63,129,987	30,389
	デンマーククローネ	134,909,117	-	134,616,600	292,517
	ポーランドズロチ	153,611,554	-	152,767,645	843,909
	オーストラリアドル	485,561,160	-	486,972,850	△1,411,690
	シンガポールドル	241,569,305	-	241,059,250	510,055
	イスラエルシュケル	120,802,017	-	120,563,872	238,145
合計		26,175,092,934	-	26,107,217,837	67,875,097

（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。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,979,833,935円
同期中における追加設定元本額	9,281,056,738円
同期中における一部解約元本額	12,326,435,300円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,239,062,689円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	643,981,489円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	14,020,472円
イオン・バランス戦略ファンド	485,835,396円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	746,127,691円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	251,850,646円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	405,713,683円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	89,843,936円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	17,236,408円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	16,988,243円
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Ⅱ＜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＞	445,116,870円
合計	14,934,455,373円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	14,934,455,373円
同期中における追加設定元本額	11,195,951,243円
同期中における一部解約元本額	8,782,036,742円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	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	888,469,164円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,479,467,989円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	556,318,037円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	920,172,878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	32,203,455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Ⅱ＜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
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＞	266,955,679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＞	289,265,961円
合計	17,348,369,874円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

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	929,818.36	
		US TREASURY N/B 0.125	1,650,000.00	1,649,162.11	
		US TREASURY N/B 0.125	1,200,000.00	1,199,203.12	
		US TREASURY N/B 0.125	940,000.00	939,155.46	
		US TREASURY N/B 0.125	1,600,000.00	1,598,437.49	
		US TREASURY N/B 0.125	320,000.00	319,425.00	
		US TREASURY N/B 0.125	750,000.00	748,564.45	
		US TREASURY N/B 0.125	1,100,000.00	1,097,421.87	
		US TREASURY N/B 0.125	460,000.00	458,706.25	
		US TREASURY N/B 0.125	1,030,000.00	1,025,131.64	

		US TREASURY N/B 0.125	1,300,000.00	1,293,703.12	
		US TREASURY N/B 0.25	500,000.00	500,566.40	
		US TREASURY N/B 0.25	910,000.00	909,217.97	
		US TREASURY N/B 0.25	1,460,000.00	1,456,407.02	
		US TREASURY N/B 0.25	890,000.00	886,766.79	
		US TREASURY N/B 0.25	620,000.00	617,505.45	
		US TREASURY N/B 0.25	100,000.00	98,746.09	
		US TREASURY N/B 0.25	650,000.00	641,011.72	
		US TREASURY N/B 0.25	630,000.00	619,516.40	
		US TREASURY N/B 0.25	720,000.00	707,596.86	
		US TREASURY N/B 0.375	980,000.00	980,114.84	
		US TREASURY N/B 0.375	820,000.00	819,071.09	
		US TREASURY N/B 0.375	1,010,000.00	1,002,306.63	
		US TREASURY N/B 0.375	650,000.00	641,849.61	
		US TREASURY N/B 0.375	620,000.00	611,717.19	
		US TREASURY N/B 0.375	530,000.00	522,339.84	
		US TREASURY N/B 0.5	1,570,000.00	1,566,749.59	
		US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	494,921.87	
		US TREASURY N/B 0.5	560,000.00	547,946.87	
		US TREASURY N/B 0.5	330,000.00	322,497.65	
		US TREASURY N/B 0.5	1,340,000.00	1,308,698.44	
		US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	487,304.69	
		US TREASURY N/B 0.5	1,030,000.00	1,001,312.88	
		US TREASURY N/B 0.625	550,000.00	545,832.03	
		US TREASURY N/B 0.625	440,000.00	434,001.56	
		US TREASURY N/B 0.625	580,000.00	567,675.00	
		US TREASURY N/B 0.625	570,000.00	557,063.67	
		US TREASURY N/B 0.625	920,000.00	874,395.30	
		US TREASURY N/B 0.625	1,190,000.00	1,127,106.64	
		US TREASURY N/B 0.75	1,020,000.00	1,020,677.34	
		US TREASURY N/B 0.75	430,000.00	423,230.85	
		US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	1,004,375.00	
		US TREASURY N/B 0.875	1,300,000.00	1,257,089.84	
		US TREASURY N/B 1	500,000.00	497,617.19	
		US TREASURY N/B 1.125	1,100,000.00	1,107,777.34	

		US TREASURY N/B 1.125	1,120,000.00	1,105,474.99	
		US TREASURY N/B 1.125	80,000.00	71,506.25	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	623,902.34	
		US TREASURY N/B 1.25	1,150,000.00	1,178,345.70	
		US TREASURY N/B 1.25	660,000.00	669,384.37	
		US TREASURY N/B 1.25	320,000.00	324,475.00	
		US TREASURY N/B 1.25	690,000.00	699,029.29	
		US TREASURY N/B 1.25	1,080,000.00	1,093,246.87	
		US TREASURY N/B 1.25	360,000.00	358,185.93	
		US TREASURY N/B 1.25	380,000.00	324,142.96	
		US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	970,707.03	
		US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	306,726.56	
		US TREASURY N/B 1.375	470,000.00	483,365.62	
		US TREASURY N/B 1.375	580,000.00	539,037.50	
		US TREASURY N/B 1.375	870,000.00	765,803.91	
		US TREASURY N/B 1.5	1,150,000.00	1,173,314.45	
		US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	464,537.11	
		US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	568,906.25	
		US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	465,539.06	
		US TREASURY N/B 1.5	900,000.00	921,164.06	
		US TREASURY N/B 1.625	200,000.00	203,492.18	
		US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	815,031.24	
		US TREASURY N/B 1.625	880,000.00	900,487.50	
		US TREASURY N/B 1.625	520,000.00	533,020.31	
		US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	823,187.50	
		US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	624,000.00	
		US TREASURY N/B 1.625	860,000.00	894,635.15	
		US TREASURY N/B 1.625	900,000.00	936,738.27	
		US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	520,566.40	
		US TREASURY N/B 1.625	440,000.00	455,348.42	
		US TREASURY N/B 1.625	1,220,000.00	1,257,791.39	
		US TREASURY N/B 1.625	840,000.00	786,121.87	
		US TREASURY N/B 1.75	350,000.00	355,947.26	
		US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	718,128.90	
		US TREASURY N/B 1.75	500,000.00	522,636.71	

		US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	508,476.56	
		US TREASURY N/B 1.875	900,000.00	916,523.44	
		US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	312,761.71	
		US TREASURY N/B 1.875	750,000.00	788,994.13	
		US TREASURY N/B 1.875	1,110,000.00	1,122,747.66	
		US TREASURY N/B 1.875	720,000.00	715,246.87	
		US TREASURY N/B 2	100,000.00	102,113.28	
		US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,026,132.81	
		US TREASURY N/B 2	200,000.00	208,632.81	
		US TREASURY N/B 2	500,000.00	521,953.12	
		US TREASURY N/B 2	600,000.00	627,117.18	
		US TREASURY N/B 2	600,000.00	632,343.75	
		US TREASURY N/B 2	600,000.00	613,007.81	
		US TREASURY N/B 2	320,000.00	327,375.00	
		US TREASURY N/B 2.125	430,000.00	440,985.15	
		US TREASURY N/B 2.125	280,000.00	292,621.87	
		US TREASURY N/B 2.125	410,000.00	430,115.62	
		US TREASURY N/B 2.125	320,000.00	340,400.00	
		US TREASURY N/B 2.25	550,000.00	574,621.09	
		US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	481,310.93	
		US TREASURY N/B 2.25	770,000.00	808,379.68	
		US TREASURY N/B 2.25	580,000.00	612,851.56	
		US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	528,222.65	
		US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	528,789.06	
		US TREASURY N/B 2.25	420,000.00	448,628.90	
		US TREASURY N/B 2.25	450,000.00	483,310.54	
		US TREASURY N/B 2.25	570,000.00	613,573.82	
		US TREASURY N/B 2.25	700,000.00	753,757.81	
		US TREASURY N/B 2.25	810,000.00	869,800.77	
		US TREASURY N/B 2.25	400,000.00	428,968.75	
		US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	495,416.39	
		US TREASURY N/B 2.375	600,000.00	634,054.68	
		US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	430,000.00	
		US TREASURY N/B 2.375	480,000.00	523,537.49	
		US TREASURY N/B 2.375	520,000.00	574,803.12	

		US TREASURY N/B 2.375	760,000.00	843,718.73	
		US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	313,171.87	
		US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	746,867.19	
		US TREASURY N/B 2.5	390,000.00	436,464.83	
		US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	560,859.37	
		US TREASURY N/B 2.5	360,000.00	404,254.68	
		US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	536,660.15	
		US TREASURY N/B 2.625	430,000.00	465,810.93	
		US TREASURY N/B 2.625	720,000.00	797,343.75	
		US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	943,417.97	
		US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	948,128.90	
		US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	538,339.84	
		US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	648,539.06	
		US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	649,875.00	
		US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	332,707.03	
		US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	464,906.25	
		US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	353,332.03	
		US TREASURY N/B 2.75	250,000.00	294,677.73	
		US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	951,960.94	
		US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	216,671.87	
		US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	650,320.31	
		US TREASURY N/B 2.875	720,000.00	785,812.50	
		US TREASURY N/B 2.875	500,000.00	559,765.62	
		US TREASURY N/B 2.875	660,000.00	740,282.81	
		US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	237,164.06	
		US TREASURY N/B 2.875	110,000.00	131,394.14	
		US TREASURY N/B 2.875	370,000.00	444,578.12	
		US TREASURY N/B 2.875	630,000.00	764,859.37	
		US TREASURY N/B 3	620,000.00	678,076.56	
		US TREASURY N/B 3	290,000.00	350,129.68	
		US TREASURY N/B 3	400,000.00	486,046.87	
		US TREASURY N/B 3	290,000.00	353,358.20	
		US TREASURY N/B 3	300,000.00	366,574.21	
		US TREASURY N/B 3	250,000.00	307,197.26	
		US TREASURY N/B 3	300,000.00	368,988.28	

		US TREASURY N/B 3	400,000.00	493,390.62	
		US TREASURY N/B 3	480,000.00	593,381.25	
		US TREASURY N/B 3	550,000.00	682,000.00	
		US TREASURY N/B 3.125	380,000.00	433,363.28	
		US TREASURY N/B 3.125	210,000.00	258,004.68	
		US TREASURY N/B 3.125	150,000.00	184,640.62	
		US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	492,375.00	
		US TREASURY N/B 3.125	110,000.00	136,210.93	
		US TREASURY N/B 3.125	470,000.00	593,301.56	
		US TREASURY N/B 3.375	450,000.00	578,320.31	
		US TREASURY N/B 3.375	230,000.00	303,761.71	
		US TREASURY N/B 3.5	100,000.00	128,484.37	
		US TREASURY N/B 3.625	230,000.00	304,902.73	
		US TREASURY N/B 3.625	400,000.00	532,171.87	
		US TREASURY N/B 3.875	120,000.00	162,206.25	
		US TREASURY N/B 4.25	170,000.00	238,717.18	
		US TREASURY N/B 4.25	140,000.00	198,351.56	
		US TREASURY N/B 4.375	40,000.00	56,378.12	
		US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	428,343.75	
		US TREASURY N/B 4.375	430,000.00	616,646.87	
		US TREASURY N/B 4.375	120,000.00	173,193.75	
		US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	140,148.43	
		US TREASURY N/B 4.625	100,000.00	147,234.37	
		US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	258,171.87	
		US TREASURY N/B 5.375	80,000.00	109,756.25	
		US TREASURY N/B 5.5	120,000.00	155,962.50	
	米ドル 小計		103,930,000.00	108,433,127.36 (11,903,788,721)	
	カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	90,000.00	89,972.10	
		CANADA-GOV'T 0.25	300,000.00	299,190.00	
		CANADA-GOV'T 0.25	250,000.00	248,437.50	
		CANADA-GOV'T 0.25	170,000.00	165,903.00	
		CANADA-GOV'T 0.5	210,000.00	208,173.00	
		CANADA-GOV'T 0.5	300,000.00	282,240.00	
		CANADA-GOV'T 1	150,000.00	150,943.50	

	CANADA-GOV'T 1.25	440,000.00	444,527.60	
	CANADA-GOV'T 1.5	130,000.00	132,585.70	
	CANADA-GOV'T 1.5	320,000.00	328,816.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	170,000.00	175,491.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	160,000.00	163,600.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	490,000.00	500,373.30	
	CANADA-GOV'T 2	300,000.00	309,375.00	
	CANADA-GOV'T 2	170,000.00	181,371.30	
	CANADA-GOV'T 2	330,000.00	349,965.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	250,000.00	260,855.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	130,000.00	137,605.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	190,000.00	207,166.50	
	CANADA-GOV'T 2.5	290,000.00	305,549.80	
	CANADA-GOV'T 2.75	230,000.00	282,009.90	
	CANADA-GOV'T 2.75	50,000.00	63,651.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	120,000.00	163,486.80	
	CANADA-GOV'T 4	110,000.00	155,065.90	
	CANADA-GOV'T 5	70,000.00	104,790.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	90,000.00	121,343.40	
	CANADA-GOV'T 5.75	60,000.00	88,503.00	
カナダドル 小計		5,570,000.00	5,920,990.30 (513,290,649)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	2,700,000.00	2,995,038.18	
	MEXICAN BONOS 5.75	3,180,000.00	3,081,895.25	
	MEXICAN BONOS 6.75	850,000.00	865,002.50	
	MEXICAN BONOS 7.5	3,300,000.00	3,418,133.07	
	MEXICAN BONOS 7.75	2,380,000.00	2,514,755.60	
	MEXICAN BONOS 7.75	1,960,000.00	2,064,899.20	
	MEXICAN BONOS 7.75	2,500,000.00	2,572,112.99	
	MEXICAN BONOS 8	4,360,000.00	4,554,840.10	
	MEXICAN BONOS 8	3,000,000.00	3,146,340.00	
	MEXICAN BONOS 8	1,800,000.00	1,891,830.78	
	MEXICAN BONOS 8.5	3,640,000.00	3,989,530.27	
	MEXICAN BONOS 8.5	2,300,000.00	2,538,384.42	
メキシコペソ 小計		31,970,000.00	33,632,762.36 (185,242,528)	

ユーロ	BELGIAN 0326 4	50,000.00	71,759.50	
	BELGIAN 0	205,000.00	210,979.85	
	BELGIAN 0.1	130,000.00	133,555.50	
	BELGIAN 0.2	80,000.00	81,552.00	
	BELGIAN 0.4	50,000.00	49,532.00	
	BELGIAN 0.8	240,000.00	253,344.00	
	BELGIAN 0.8	310,000.00	333,873.10	
	BELGIAN 0.8	130,000.00	140,875.80	
	BELGIAN 0291 5.5	170,000.00	238,115.60	
	BELGIAN 0304 5	160,000.00	265,704.00	
	BELGIAN 0320 4.25	170,000.00	290,949.90	
	BELGIAN 0324 4.5	80,000.00	98,958.40	
	BELGIAN 0325 4.25	70,000.00	73,638.60	
	BELGIAN 0328 2.25	100,000.00	105,291.00	
	BELGIAN 0332 2.6	240,000.00	262,269.60	
	BELGIAN 0333 3	120,000.00	164,510.40	
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	103,718.00	
	BELGIAN 0344 1.45	110,000.00	130,028.80	
	BELGIAN 0347 0.9	170,000.00	186,121.10	
	BELGIAN 0348 1.7	100,000.00	125,386.00	
	BELGIAN 0352 0	90,000.00	90,509.40	
	BELGIAN 0353 0.65	30,000.00	26,693.10	
	BELGIAN 1	200,000.00	215,222.00	
	BELGIAN 1	160,000.00	177,728.00	
	BELGIAN 1.25	130,000.00	149,120.40	
	BELGIAN 1.6	120,000.00	146,559.60	
	BELGIAN 1.9	170,000.00	213,812.40	
	BELGIAN 2.15	130,000.00	191,656.40	
	BELGIAN 3.75	130,000.00	221,691.60	
	BTPS 0	250,000.00	252,092.50	
	BTPS 0	100,000.00	100,770.00	
	BTPS 0.3	100,000.00	101,406.00	
	BTPS 0.35	300,000.00	305,856.00	
	BTPS 0.5	50,000.00	51,227.00	
	BTPS 0.5	270,000.00	273,507.30	

		BTPS 0.6	360,000.00	357,663.60	
		BTPS 0.65	300,000.00	306,810.00	
		BTPS 0.85	280,000.00	291,463.20	
		BTPS 0.9	240,000.00	246,175.20	
		BTPS 0.95	340,000.00	347,143.40	
		BTPS 0.95	720,000.00	735,530.40	
		BTPS 0.95	130,000.00	136,016.40	
		BTPS 0.95	210,000.00	217,329.00	
		BTPS 0.95	180,000.00	184,096.80	
		BTPS 0.95	100,000.00	97,301.00	
		BTPS 1.25	200,000.00	212,618.00	
		BTPS 1.35	560,000.00	599,989.60	
		BTPS 1.45	200,000.00	203,924.00	
		BTPS 1.45	250,000.00	263,612.50	
		BTPS 1.45	240,000.00	254,467.20	
		BTPS 1.45	100,000.00	105,315.00	
		BTPS 1.5	420,000.00	446,233.20	
		BTPS 1.5	80,000.00	80,488.80	
		BTPS 1.6	380,000.00	409,096.60	
		BTPS 1.65	230,000.00	251,873.00	
		BTPS 1.65	370,000.00	404,387.80	
		BTPS 1.7	140,000.00	141,258.60	
		BTPS 1.8	220,000.00	236,104.00	
		BTPS 1.85	300,000.00	317,592.00	
		BTPS 2	220,000.00	239,577.80	
		BTPS 2	320,000.00	356,144.00	
		BTPS 2.05	320,000.00	355,507.20	
		BTPS 2.1	280,000.00	308,540.40	
		BTPS 2.15	50,000.00	51,167.00	
		BTPS 2.2	290,000.00	324,524.50	
		BTPS 2.25	310,000.00	359,984.40	
		BTPS 2.45	420,000.00	444,897.60	
		BTPS 2.45	130,000.00	153,305.10	
		BTPS 2.45	180,000.00	213,217.20	
		BTPS 2.5	260,000.00	283,127.00	

BTPS 2.5		210,000.00	232,995.00	
BTPS 2.7		260,000.00	321,659.00	
BTPS 2.8		240,000.00	282,285.60	
BTPS 2.8		60,000.00	73,414.80	
BTPS 2.95		150,000.00	189,850.50	
BTPS 3		170,000.00	204,159.80	
BTPS 3.1		100,000.00	129,298.00	
BTPS 3.25		160,000.00	216,385.60	
BTPS 3.35		210,000.00	272,386.80	
BTPS 3.45		80,000.00	112,125.60	
BTPS 3.75		100,000.00	112,018.00	
BTPS 3.85		180,000.00	270,180.00	
BTPS 4		250,000.00	350,437.50	
BTPS 4.5		70,000.00	78,423.10	
BTPS 4.5		300,000.00	361,404.00	
BTPS 4.75		300,000.00	329,667.00	
BTPS 4.75		270,000.00	352,390.50	
BTPS 4.75		270,000.00	442,573.20	
BTPS 5		300,000.00	354,645.00	
BTPS 5		310,000.00	462,749.40	
BTPS 5		250,000.00	399,790.00	
BTPS 5		180,000.00	291,340.80	
BTPS 5.25		410,000.00	569,006.20	
BTPS 5.5		350,000.00	373,824.50	
BTPS 5.75		200,000.00	308,048.00	
BTPS 6		250,000.00	376,882.50	
BTPS 6.5		190,000.00	263,049.30	
BTPS 9		170,000.00	204,266.90	
BUNDESOBL-120 0		340,000.00	348,935.20	
BUNDESOBL-120 0		250,000.00	257,937.50	
BUNDESOBL-176 0		250,000.00	251,942.50	
BUNDESOBL-177 0		380,000.00	384,503.00	
BUNDESOBL-178 0		350,000.00	355,533.50	
BUNDESOBL-179 0		490,000.00	499,506.00	
BUNDESOBL-180 0		700,000.00	716,352.00	

		BUNDESOBL-183 0	60,000.00	61,950.00	
		BUNDESOBL-184 0	90,000.00	93,083.40	
		BUNDESSCHATZANW 0	320,000.00	323,571.20	
		DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	310,305.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	190,000.00	197,305.50	
		DEUTSCHLAND REP 0	100,000.00	103,943.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	250,000.00	260,385.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	156,252.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	680,000.00	707,682.80	
		DEUTSCHLAND REP 0	380,000.00	394,801.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	40,000.00	41,466.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	260,000.00	265,891.60	
		DEUTSCHLAND REP 0	180,000.00	182,759.40	
		DEUTSCHLAND REP 0	240,000.00	231,420.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	130,000.00	126,842.30	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	330,000.00	346,625.40	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	170,000.00	179,975.60	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	190,000.00	201,567.20	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	330,000.00	344,269.20	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	410,000.00	432,304.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	380,000.00	406,090.80	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	310,000.00	332,555.60	
		DEUTSCHLAND REP 1	100,000.00	105,201.00	
		DEUTSCHLAND REP 1	230,000.00	245,801.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.25	280,000.00	367,141.60	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	450,000.00	459,940.50	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	250,000.00	259,457.50	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	240,000.00	254,664.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.75	200,000.00	212,310.00	
		DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	263,405.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.5	390,000.00	616,601.70	
		DEUTSCHLAND REP 2.5	280,000.00	452,858.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.25	210,000.00	356,855.10	
		DEUTSCHLAND REP 4	350,000.00	579,264.00	
		DEUTSCHLAND REP 4.25	200,000.00	359,188.00	

DEUTSCHLAND REP 4.75	170,000.00	233,636.10	
DEUTSCHLAND REP 4.75	180,000.00	299,716.20	
DEUTSCHLAND REP 4.75	250,000.00	482,977.50	
DEUTSCHLAND REP 5.5	80,000.00	125,836.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	160,000.00	224,952.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	290,000.00	458,281.20	
DEUTSCHLAND REP 6.5	160,000.00	228,254.40	
FINNISH GOV'T 0	120,000.00	121,777.20	
FINNISH GOV'T 0	70,000.00	71,475.60	
FINNISH GOV'T 0.125	40,000.00	41,113.60	
FINNISH GOV'T 0.125	20,000.00	18,470.00	
FINNISH GOV'T 0.25	70,000.00	70,365.40	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	105,208.00	
FINNISH GOV'T 0.5	40,000.00	42,470.80	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	106,680.00	
FINNISH GOV'T 0.75	30,000.00	32,802.00	
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	106,206.00	
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	114,367.00	
FINNISH GOV'T 1.375	50,000.00	63,365.50	
FINNISH GOV'T 1.5	100,000.00	103,639.00	
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	102,426.00	
FINNISH GOV'T 2.625	40,000.00	59,824.40	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	122,332.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	303,030.00	
FRANCE O.A.T. 0	430,000.00	434,622.50	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	345,535.20	
FRANCE O.A.T. 0	450,000.00	457,695.00	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	347,435.80	
FRANCE O.A.T. 0	380,000.00	389,363.20	
FRANCE O.A.T. 0	270,000.00	276,779.70	
FRANCE O.A.T. 0	480,000.00	488,875.20	
FRANCE O.A.T. 0	510,000.00	516,216.90	
FRANCE O.A.T. 0	230,000.00	230,841.80	
FRANCE O.A.T. 0.25	410,000.00	426,391.80	
FRANCE O.A.T. 0.5	80,000.00	66,304.00	

		FRANCE 0.A.T. 0.5	440,000.00	458,356.80	
		FRANCE 0.A.T. 0.5	470,000.00	493,344.90	
		FRANCE 0.A.T. 0.5	420,000.00	445,389.00	
		FRANCE 0.A.T. 0.5	240,000.00	242,726.40	
		FRANCE 0.A.T. 0.5	70,000.00	69,300.00	
		FRANCE 0.A.T. 0.75	640,000.00	689,126.40	
		FRANCE 0.A.T. 0.75	580,000.00	625,936.00	
		FRANCE 0.A.T. 0.75	350,000.00	349,265.00	
		FRANCE 0.A.T. 0.75	120,000.00	118,736.40	
		FRANCE 0.A.T. 1	350,000.00	373,607.50	
		FRANCE 0.A.T. 1	280,000.00	303,598.40	
		FRANCE 0.A.T. 1.25	380,000.00	433,135.40	
		FRANCE 0.A.T. 1.25	490,000.00	560,966.70	
		FRANCE 0.A.T. 1.5	540,000.00	624,639.60	
		FRANCE 0.A.T. 1.5	350,000.00	422,313.50	
		FRANCE 0.A.T. 1.75	640,000.00	666,822.40	
		FRANCE 0.A.T. 1.75	570,000.00	614,192.10	
		FRANCE 0.A.T. 1.75	410,000.00	511,069.10	
		FRANCE 0.A.T. 1.75	150,000.00	198,745.50	
		FRANCE 0.A.T. 2	290,000.00	386,216.20	
		FRANCE 0.A.T. 2.25	120,000.00	123,973.20	
		FRANCE 0.A.T. 2.25	430,000.00	464,344.10	
		FRANCE 0.A.T. 2.5	640,000.00	792,608.00	
		FRANCE 0.A.T. 2.75	420,000.00	503,571.60	
		FRANCE 0.A.T. 3.25	280,000.00	448,893.20	
		FRANCE 0.A.T. 3.5	490,000.00	582,972.60	
		FRANCE 0.A.T. 4	230,000.00	372,149.20	
		FRANCE 0.A.T. 4	170,000.00	333,065.70	
		FRANCE 0.A.T. 4	170,000.00	349,057.60	
		FRANCE 0.A.T. 4.25	480,000.00	530,769.60	
		FRANCE 0.A.T. 4.5	470,000.00	832,539.20	
		FRANCE 0.A.T. 4.75	270,000.00	438,758.10	
		FRANCE 0.A.T. 5.5	390,000.00	565,320.60	
		FRANCE 0.A.T. 5.75	340,000.00	559,463.20	
		FRANCE 0.A.T. 6	400,000.00	510,240.00	

		FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	229,976.00	
		IRISH GOVT 0.2	120,000.00	124,413.60	
		IRISH GOVT 0.2	150,000.00	154,200.00	
		IRISH GOVT 0.9	120,000.00	130,159.20	
		IRISH GOVT 1	220,000.00	235,917.00	
		IRISH GOVT 1.1	130,000.00	143,586.30	
		IRISH GOVT 1.3	150,000.00	171,322.50	
		IRISH GOVT 1.35	60,000.00	68,350.80	
		IRISH GOVT 1.5	70,000.00	84,110.60	
		IRISH GOVT 1.7	100,000.00	121,105.00	
		IRISH GOVT 2	70,000.00	92,360.80	
		IRISH GOVT 2.4	100,000.00	122,681.00	
		IRISH GOVT 3.4	80,000.00	88,171.20	
		IRISH GOVT 3.9	50,000.00	53,493.00	
		IRISH GOVT 5.4	50,000.00	60,612.00	
		NETHERLANDS GOVT 0	170,000.00	172,963.10	
		NETHERLANDS GOVT 0	120,000.00	123,740.40	
		NETHERLANDS GOVT 0	180,000.00	185,194.80	
		NETHERLANDS GOVT 0	100,000.00	102,440.00	
		NETHERLANDS GOVT 0	50,000.00	49,611.50	
		NETHERLANDS GOVT 0	80,000.00	75,008.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.25	200,000.00	207,264.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.25	130,000.00	136,678.10	
		NETHERLANDS GOVT 0.5	230,000.00	242,852.40	
		NETHERLANDS GOVT 0.5	200,000.00	217,216.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	170,000.00	183,287.20	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	108,616.00	
		NETHERLANDS GOVT 1.75	160,000.00	167,444.80	
		NETHERLANDS GOVT 2	200,000.00	215,710.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.5	140,000.00	183,460.20	
		NETHERLANDS GOVT 2.75	170,000.00	282,285.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	100,000.00	106,075.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	190,000.00	332,279.60	
		NETHERLANDS GOVT 4	260,000.00	422,349.20	
		NETHERLANDS GOVT 5.5	150,000.00	208,266.00	

REP OF AUSTRIA 0		180,000.00	182,550.60	
REP OF AUSTRIA 0		90,000.00	91,878.30	
REP OF AUSTRIA 0		120,000.00	122,462.40	
REP OF AUSTRIA 0		290,000.00	294,141.20	
REP OF AUSTRIA 0		120,000.00	113,066.40	
REP OF AUSTRIA 0.5		310,000.00	328,286.90	
REP OF AUSTRIA 0.5		30,000.00	31,880.40	
REP OF AUSTRIA 0.75		200,000.00	213,686.00	
REP OF AUSTRIA 0.75		130,000.00	140,211.50	
REP OF AUSTRIA 0.75		80,000.00	86,007.20	
REP OF AUSTRIA 1.2		40,000.00	43,114.80	
REP OF AUSTRIA 1.5		70,000.00	97,001.80	
REP OF AUSTRIA 1.5		70,000.00	88,540.90	
REP OF AUSTRIA 1.75		80,000.00	84,286.40	
REP OF AUSTRIA 2.4		100,000.00	130,237.00	
REP OF AUSTRIA 3.15		40,000.00	65,004.00	
REP OF AUSTRIA 3.4		200,000.00	209,904.00	
REP OF AUSTRIA 3.8		150,000.00	324,187.50	
REP OF AUSTRIA 4.15		120,000.00	194,731.20	
REP OF AUSTRIA 4.85		100,000.00	125,366.00	
SPANISH GOV'T 0		180,000.00	181,800.00	
SPANISH GOV'T 0		350,000.00	355,050.50	
SPANISH GOV'T 0		290,000.00	295,054.70	
SPANISH GOV'T 0		210,000.00	213,534.30	
SPANISH GOV'T 0.1		280,000.00	276,536.40	
SPANISH GOV'T 0.25		390,000.00	399,005.10	
SPANISH GOV'T 0.35		300,000.00	305,460.00	
SPANISH GOV'T 0.45		300,000.00	303,738.00	
SPANISH GOV'T 0.5		440,000.00	455,219.60	
SPANISH GOV'T 0.5		170,000.00	173,350.70	
SPANISH GOV'T 0.6		220,000.00	230,049.60	
SPANISH GOV'T 0.8		100,000.00	106,066.00	
SPANISH GOV'T 0.85		210,000.00	212,902.20	
SPANISH GOV'T 1		180,000.00	170,964.00	
SPANISH GOV'T 1.2		60,000.00	63,146.40	

		SPANISH GOV'T 1.25	240,000.00	263,671.20	
		SPANISH GOV'T 1.3	250,000.00	271,377.50	
		SPANISH GOV'T 1.4	250,000.00	275,567.50	
		SPANISH GOV'T 1.4	290,000.00	320,513.80	
		SPANISH GOV'T 1.45	20,000.00	18,591.40	
		SPANISH GOV'T 1.45	350,000.00	385,871.50	
		SPANISH GOV'T 1.45	230,000.00	255,881.90	
		SPANISH GOV'T 1.5	290,000.00	319,501.70	
		SPANISH GOV'T 1.85	160,000.00	187,006.40	
		SPANISH GOV'T 1.95	220,000.00	244,037.20	
		SPANISH GOV'T 1.95	200,000.00	232,452.00	
		SPANISH GOV'T 2.15	250,000.00	277,207.50	
		SPANISH GOV'T 2.35	300,000.00	367,149.00	
		SPANISH GOV'T 2.7	270,000.00	369,311.40	
		SPANISH GOV'T 2.75	150,000.00	165,651.00	
		SPANISH GOV'T 2.9	190,000.00	267,084.90	
		SPANISH GOV'T 3.45	160,000.00	255,435.20	
		SPANISH GOV'T 4.2	100,000.00	152,473.00	
		SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	332,370.00	
		SPANISH GOV'T 4.65	590,000.00	708,985.30	
		SPANISH GOV'T 4.7	270,000.00	459,391.50	
		SPANISH GOV'T 4.8	100,000.00	112,998.00	
		SPANISH GOV'T 4.9	230,000.00	396,464.80	
		SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	275,316.00	
		SPANISH GOV'T 5.15	130,000.00	242,678.80	
		SPANISH GOV'T 5.75	260,000.00	411,951.80	
		SPANISH GOV'T 5.9	270,000.00	353,486.70	
		SPANISH GOV'T 6	180,000.00	261,309.60	
	ユーロ 小計		69,205,000.00	80,868,035.15 (10,497,479,642)	
英ポンド		UK TSY GILT 0.125	260,000.00	260,000.00	
		UK TSY GILT 0.125	260,000.00	259,407.20	
		UK TSY GILT 0.125	320,000.00	317,107.20	
		UK TSY GILT 0.125	140,000.00	136,897.60	
		UK TSY GILT 0.25	220,000.00	209,829.40	

		UK TSY GILT 0.375	100,000.00	99,822.00	
		UK TSY GILT 0.375	180,000.00	175,343.40	
		UK TSY GILT 0.5	140,000.00	118,837.60	
		UK TSY GILT 0.625	250,000.00	253,397.50	
		UK TSY GILT 0.625	220,000.00	210,727.00	
		UK TSY GILT 0.625	230,000.00	204,902.40	
		UK TSY GILT 0.75	280,000.00	283,206.00	
		UK TSY GILT 0.875	170,000.00	173,996.70	
		UK TSY GILT 0.875	130,000.00	124,044.70	
		UK TSY GILT 1	150,000.00	153,168.00	
		UK TSY GILT 1.125	300,000.00	303,969.00	
		UK TSY GILT 1.25	150,000.00	157,269.00	
		UK TSY GILT 1.25	150,000.00	155,214.00	
		UK TSY GILT 1.25	250,000.00	261,145.00	
		UK TSY GILT 1.5	80,000.00	84,507.20	
		UK TSY GILT 1.5	310,000.00	339,899.50	
		UK TSY GILT 1.625	80,000.00	104,556.00	
		UK TSY GILT 1.625	220,000.00	237,501.00	
		UK TSY GILT 1.625	80,000.00	92,932.00	
		UK TSY GILT 1.75	310,000.00	315,180.10	
		UK TSY GILT 1.75	220,000.00	244,747.80	
		UK TSY GILT 1.75	90,000.00	104,594.40	
		UK TSY GILT 1.75	220,000.00	269,227.20	
		UK TSY GILT 2	130,000.00	138,929.70	
		UK TSY GILT 2.25	250,000.00	260,460.00	
		UK TSY GILT 2.5	140,000.00	217,912.80	
		UK TSY GILT 2.75	90,000.00	96,820.20	
		UK TSY GILT 3.25	180,000.00	258,096.60	
		UK TSY GILT 3.5	250,000.00	375,765.00	
		UK TSY GILT 3.5	170,000.00	335,761.90	
		UK TSY GILT 4	140,000.00	275,622.20	
		UK TSY GILT 4.25	200,000.00	246,874.00	
		UK TSY GILT 4.25	140,000.00	190,447.60	
		UK TSY GILT 4.25	180,000.00	261,439.20	
		UK TSY GILT 4.25	140,000.00	215,111.40	

	UK TSY GILT 4.25	190,000.00	297,186.60	
	UK TSY GILT 4.25	90,000.00	153,206.10	
	UK TSY GILT 4.25	90,000.00	160,247.70	
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	386,800.00	
	UK TSY GILT 4.5	210,000.00	304,010.70	
	UK TSY GILT 4.5	260,000.00	431,298.40	
	UK TSY GILT 4.75	160,000.00	218,835.20	
	UK TSY GILT 4.75	70,000.00	112,057.40	
	UK TSY GILT 5	80,000.00	93,182.40	
	UK TSY GILT 6	60,000.00	83,398.80	
英ポンド 小計		8,930,000.00	10,764,892.80 (1,635,725,460)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.125	500,000.00	496,650.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	950,000.00	995,923.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	810,000.00	851,366.70	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	640,000.00	676,121.60	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1,010,000.00	1,049,491.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.25	300,000.00	363,366.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	800,000.00	879,920.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	430,000.00	645,270.90	
スウェーデンクローナ 小計		5,440,000.00	5,958,109.20 (76,025,473)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.25	410,000.00	406,433.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.375	330,000.00	332,181.30	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	650,000.00	662,285.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	250,000.00	256,535.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	680,000.00	702,317.60	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	460,000.00	477,162.60	
	NORWEGIAN GOV'T 2	700,000.00	716,191.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	400,000.00	420,580.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	920,000.00	968,438.00	
ノルウェークローネ 小計		4,800,000.00	4,942,123.50 (62,567,283)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0	390,000.00	395,772.00	
	DENMARK - BULLET 0	550,000.00	553,355.00	
	DENMARK - BULLET 0.25	220,000.00	222,079.00	

	DENMARK - BULLET 0.25	450,000.00	435,285.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	660,000.00	694,782.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	1,090,000.00	1,152,893.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	1,100,000.00	1,147,850.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	690,000.00	754,515.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	1,190,000.00	2,119,152.00	
	DENMARK - BULLET 7	90,000.00	111,699.00	
デンマーククローネ 小計		6,430,000.00	7,587,382.00 (132,475,689)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	460,000.00	456,691.98	
	POLAND GOVT BOND 0.25	140,000.00	132,090.00	
	POLAND GOVT BOND 0.75	850,000.00	845,826.50	
	POLAND GOVT BOND 1.25	200,000.00	190,514.00	
	POLAND GOVT BOND 2.25	560,000.00	584,656.80	
	POLAND GOVT BOND 2.5	500,000.00	523,605.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	70,000.00	74,121.60	
	POLAND GOVT BOND 2.75	510,000.00	550,325.70	
	POLAND GOVT BOND 2.75	170,000.00	183,435.10	
	POLAND GOVT BOND 3.25	470,000.00	510,222.60	
	POLAND GOVT BOND 4	260,000.00	279,346.60	
	POLAND GOVT BOND 5.75	720,000.00	932,558.40	
ポーランドズロチ 小計		4,910,000.00	5,263,394.28 (150,312,013)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	200,000.00	199,751.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	320,000.00	316,486.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 0.5	320,000.00	317,249.28	
	AUSTRALIAN GOVT. 1	310,000.00	304,514.86	
	AUSTRALIAN GOVT. 1	220,000.00	214,354.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.25	190,000.00	189,072.04	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	250,000.00	256,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	220,000.00	229,664.38	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	180,000.00	164,178.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	140,000.00	143,705.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	210,000.00	228,490.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	380,000.00	423,662.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	330,000.00	353,622.72	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	270,000.00	301,293.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	130,000.00	146,109.86	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	283,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	150,000.00	172,455.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	130,000.00	147,030.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	120,000.00	141,194.04	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	230,000.00	253,529.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	232,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	80,000.00	97,248.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	150,000.00	192,765.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	210,000.00	244,881.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	140,000.00	188,132.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	200,000.00	217,566.00	
オーストラリアドル 小計		5,530,000.00	5,959,455.48 (482,179,542)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.875	90,000.00	90,397.35	
	SINGAPORE GOV'T 2	120,000.00	124,428.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.125	340,000.00	360,964.40	
	SINGAPORE GOV'T 2.25	120,000.00	128,773.20	
	SINGAPORE GOV'T 2.375	90,000.00	98,460.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	210,000.00	230,475.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	330,000.00	344,190.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	115,285.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	150,000.00	175,125.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	210,000.00	235,851.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	200,000.00	225,760.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	322,290.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	180,000.00	184,932.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	298,625.00	
シンガポールドル 小計		2,690,000.00	2,935,556.45 (239,981,739)	
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 1.5	990,000.00	1,020,353.40	
	ISRAEL FIXED 1.5	360,000.00	345,200.40	
	ISRAEL FIXED 1.75	330,000.00	348,282.00	
	ISRAEL FIXED 2.25	570,000.00	625,711.80	

		ISRAEL FIXED 3.75	370,000.00	478,994.60	
		ISRAEL FIXED 6.25	480,000.00	619,862.40	
	イスラエルシュケル 小計		3,100,000.00	3,438,404.60 (117,766,045)	
合計				25,996,834,784 (25,996,834,784)	

（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	45.2%	45.8%
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	39.8%	40.4%
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%	1.9%
シンガポールドル	国債証券	14銘柄	0.9%	0.9%
イスラエルシュケル	国債証券	6銘柄	0.4%	0.5%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	358,456,809	116,030,775
金銭信託	-	156,415,906
コール・ローン	585,525,253	303,057,345
国債証券	164,257,613,313	158,834,336,056
未収利息	924,002,069	836,019,849

前払費用	30,790,787	26,225,070
流動資産合計	166,156,388,231	160,272,085,001
資産合計	166,156,388,231	160,272,085,001
負債の部		
流動負債		
未払金	46,356,918	-
未払解約金	206,852,998	40,798,941
未払利息	1,712	668
その他未払費用	14,488	10,504
流動負債合計	253,226,116	40,810,113
負債合計	253,226,116	40,810,113
純資産の部		
元本等		
元本	86,651,796,345	81,240,238,352
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	79,251,365,770	78,991,036,536
元本等合計	165,903,162,115	160,231,274,888
純資産合計	165,903,162,115	160,231,274,888
負債純資産合計	166,156,388,231	160,272,085,001

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	86,651,796,345口	81,240,238,352口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9146円 (10,000口当たりの純資産額　19,146円)	1口当たり純資産額　1.9723円 (10,000口当たりの純資産額　19,723円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

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11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	85,552,532,956円
同期中における追加設定元本額	21,945,133,013円
同期中における一部解約元本額	20,845,869,624円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	22,708,464,861円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	657,808,704円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,765,641,515円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	885,355,779円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	135,214,150円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	7,442,392円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	28,932,686円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	88,963,745円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	147,123,191円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	86,958,263円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	169,760,535円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	23,589,170円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	152,976,060円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	177,017,525円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	125,667,599円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	8,400,078円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	48,233,958円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	28,737,397円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	68,259,528円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	21,374,275円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	13,787,073円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	56,728,071円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	59,355,709円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	3,401,354円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	11,013,159円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	5,661,161円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,437,654円
ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,325,407,859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＞	62,516,303円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	8,969,125,020円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,882,034,678円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	11,081,288,238円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	34,927,566円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜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ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	364,139円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	667,821,535円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	117,038,834円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,130,698,774円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,406,378,119円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,693,637,685円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	5,375,225,533円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,096,475円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	8,991,550,157円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	372,710,683円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	156,656,035円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	94,741,730円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	35,622,173円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	12,330,649円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	114,449,543円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	457,949,726円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	131,485,417円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	41,665,026円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,430,860円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	1,136,440,664円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	5,339,525円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,434,006,438円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,193,432,057円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	5,014,430,246円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	523,340,928円
ＳＭＡＭ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションⅡ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	62,703,933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＞	53,516,287円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	188,026,035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＞	243,881,171円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	1,054,566,362円
合計	86,651,796,345円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	

期首における当該親投資信託の元本額	86,651,796,345円
同期中における追加設定元本額	8,899,935,389円
同期中における一部解約元本額	14,311,493,382円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	24,390,596,375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）	2,095,214,066円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,103,670,901円
ＳＭＡＭ・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）	138,581,301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）	238,457,653円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	24,289,186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ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	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）	27,675,437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・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	101,717,793円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	199,947,568円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	12,052,227円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	32,752,949円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	22,100,213円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,172,899円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	504,541円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	3,009,093円
ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,310,597,405円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	45,899,893円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	7,801,603,636円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,694,680,423円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	10,840,471,131円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	35,901,694円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	95,696,295円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	724,470,054円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	117,631,749円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,068,564,548円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,431,714,372円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,598,287,873円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	5,023,496,861円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	622,437円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	8,421,225,670円

三井住友・外国債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	341,011,119円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	151,272,369円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	85,197,734円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	34,472,321円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,926,289円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	101,951,512円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	438,469,208円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	112,773,770円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	40,181,590円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,263,229円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	1,073,075,999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＞	684,038,861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＞	999,642,200円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,485,462,252円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	451,612,674円
ＳＭＡＭ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションⅡ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	16,664,143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＞	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II＜適格機関投資家限定＞	324,022,967円
合計	81,240,238,352円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

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	1,799,648.44	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,292,273.45	
		US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,984,687.52	
		US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,683,968.75	
		US TREASURY N/B 0.125	7,700,000.00	7,662,703.12	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,005,664.05	

		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,705,714.86	
		US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	2,997,421.89	
		US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,366,812.51	
		US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,251,531.25	
		US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,966,718.76	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,977,148.43	
		US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,974,921.88	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,959,921.89	
		US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,551,289.08	
		US TREASURY N/B 0.375	7,800,000.00	7,536,750.00	
		US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,496,894.53	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,935,429.68	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,931,796.89	
		US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,297,218.77	
		US TREASURY N/B 0.625	3,600,000.00	3,572,718.76	
		US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,479,550.78	
		US TREASURY N/B 0.625	2,100,000.00	2,055,375.00	
		US TREASURY N/B 0.625	7,200,000.00	7,036,593.76	
		US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	7,128,222.67	
		US TREASURY N/B 0.625	8,800,000.00	8,334,906.27	
		US TREASURY N/B 0.75	6,700,000.00	6,594,527.32	
		US TREASURY N/B 0.875	7,000,000.00	6,768,945.33	
		US TREASURY N/B 1	3,200,000.00	3,184,750.01	
		US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,530,234.37	
		US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,028,828.12	
		US TREASURY N/B 1.125	8,500,000.00	8,389,765.62	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,059,648.43	
		US TREASURY N/B 1.25	2,200,000.00	2,188,914.06	
		US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	4,350,339.83	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,054,531.24	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,052,031.25	
		US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	510,898.44	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,556,054.70	
		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	2,673,937.50	
		US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	3,961,054.71	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,549,902.33	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,059,062.50	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,060,820.32	
		US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,064,609.38	
		US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,034,531.25	
		US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,605,820.33	
		US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,014,570.31	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,561,113.29	
		US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,075,156.24	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,069,843.75	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,075,117.18	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,086,953.14	
		US TREASURY N/B 1.625	4,700,000.00	4,888,000.00	
		US TREASURY N/B 1.625	14,950,000.00	15,552,087.92	
		US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,059,199.20	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,123,398.43	
		US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,605,228.50	
		US TREASURY N/B 1.625	1,100,000.00	1,134,074.21	
		US TREASURY N/B 1.625	3,200,000.00	2,994,750.01	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,050,976.57	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,066,093.75	
		US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,769,925.78	
		US TREASURY N/B 1.75	6,200,000.00	6,437,343.75	
		US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	883,136.72	
		US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,515,125.00	
		US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,181,093.76	
		US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,881,375.02	
		US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,059,648.43	
		US TREASURY N/B 1.875	2,800,000.00	2,919,109.36	
		US TREASURY N/B 1.875	5,800,000.00	5,761,710.95	
		US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,573,964.83	
		US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,113,671.90	
		US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,899,304.67	

		US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,086,328.12	
		US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,444,890.62	
		US TREASURY N/B 2	4,100,000.00	4,285,300.76	
		US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,674,179.70	
		US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,531,796.87	
		US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,299,218.75	
		US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,860,703.13	
		US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,069,140.64	
		US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,102,187.52	
		US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,226,058.58	
		US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,088,906.26	
		US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,793,007.84	
		US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,671,718.75	
		US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,205,000.00	
		US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,895,132.80	
		US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,175,625.00	
		US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,134,296.89	
		US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,301,921.88	
		US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	3,989,406.25	
		US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,584,960.94	
		US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,655,605.45	
		US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,278,492.20	
		US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,262,656.24	
		US TREASURY N/B 2.25	13,300,000.00	14,206,581.98	
		US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,725,703.13	
		US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,521,070.30	
		US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,737,906.27	
		US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	3,056,402.35	
		US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,769,472.66	
		US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,236,703.12	
		US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,885,867.20	
		US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,917,843.73	
		US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,301,187.50	
		US TREASURY N/B 2.375	4,100,000.00	4,471,882.83	
		US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	2,100,242.19	

		US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,219,531.25	
		US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,024,187.50	
		US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,627,640.64	
		US TREASURY N/B 2.5	8,500,000.00	9,169,707.01	
		US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,588,476.58	
		US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,252,984.37	
		US TREASURY N/B 2.5	3,600,000.00	4,042,546.88	
		US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,143,593.76	
		US TREASURY N/B 2.625	1,900,000.00	2,000,863.28	
		US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,468,636.71	
		US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,761,281.27	
		US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,924,859.37	
		US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,204,882.83	
		US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,020,871.10	
		US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,043,750.00	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,096,484.38	
		US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	3,988,070.32	
		US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,424,601.55	
		US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,399,027.33	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,153,359.38	
		US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	4,972,132.82	
		US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,274,562.50	
		US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,323,312.51	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,324,531.26	
		US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	348,679.68	
		US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,475,539.07	
		US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,768,066.41	
		US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,055,507.81	
		US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,115,468.76	
		US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,383,390.63	
		US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,192,253.90	
		US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,728,515.62	
		US TREASURY N/B 2.875	9,000,000.00	10,075,781.25	
		US TREASURY N/B 2.875	500,000.00	560,820.31	
		US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,845,968.74	

		US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,419,621.10	
		US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,325,625.00	
		US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,699,687.50	
		US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,374,687.52	
		US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,395,105.46	
		US TREASURY N/B 3	800,000.00	965,875.00	
		US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,252,910.16	
		US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,655,429.68	
		US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,299,167.96	
		US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,071,972.65	
		US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,705,914.06	
		US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,823,777.33	
		US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,675,539.07	
		US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,712,000.00	
		US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,789,804.69	
		US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,351,453.12	
		US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,230,937.50	
		US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,831,156.25	
		US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	4,086,328.12	
		US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	3,029,625.00	
		US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,855,468.75	
		US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,094,179.70	
		US TREASURY N/B 3.5	200,000.00	256,968.75	
		US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,181,593.74	
		US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,789,546.88	
		US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	2,005,429.69	
		US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	945,984.37	
		US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	675,859.37	
		US TREASURY N/B 4.25	300,000.00	421,265.62	
		US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	850,078.12	
		US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	999,468.75	
		US TREASURY N/B 4.375	900,000.00	1,290,656.25	
		US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	432,984.37	
		US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	433,921.87	
		US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	883,406.25	

	US TREASURY N/B 4.75	900,000.00	1,356,257.81	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	645,429.69	
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	439,025.00	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	649,843.75	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,231,796.88	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,312,031.25	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	893,437.50	
米ドル 小計		625,520,000.00	662,603,372.90 (72,740,598,276)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	800,000.00	793,040.00	
	CANADA-GOV'T 1	2,800,000.00	2,820,020.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,600,000.00	1,610,064.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	5,600,000.00	5,657,624.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,039,780.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,027,550.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	2,993,670.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,123,287.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,237,500.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,700,000.00	1,813,713.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,043,420.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,481,900.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,199,385.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,212,602.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,348,743.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	636,510.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,771,107.00	
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,114,535.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,170,650.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	337,065.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	737,525.00	
カナダドル 小計		32,900,000.00	36,169,690.00 (3,135,550,426)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	35,496,748.80	
	MEXICAN BONOS 5.75	15,000,000.00	14,537,241.75	
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,894,947.50	

	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,056,620.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	18,963,360.00	
	MEXICAN BONOS 8	34,000,000.00	35,519,395.40	
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,255,085.50	
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	25,208,570.40	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	44,145,816.00	
メキシコペソ 小計		193,000,000.00	206,077,785.35 (1,135,035,226)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	717,595.00	
	BELGIAN 0.1	700,000.00	719,145.00	
	BELGIAN 0.4	300,000.00	297,192.00	
	BELGIAN 0.8	800,000.00	844,480.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,077,010.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,083,660.00	
	BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,540,748.00	
	BELGIAN 0304 5	1,000,000.00	1,660,650.00	
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,053,764.00	
	BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	865,886.00	
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,788,366.00	
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,579,365.00	
	BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,513,417.00	
	BELGIAN 0333 3	200,000.00	274,184.00	
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,037,180.00	
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	726,680.00	
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	472,832.00	
	BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,423,279.00	
	BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	626,930.00	
	BELGIAN 0353 0.65	600,000.00	533,862.00	
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,506,554.00	
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,110,800.00	
	BELGIAN 1.25	400,000.00	458,832.00	
	BELGIAN 1.6	850,000.00	1,038,130.50	
	BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,257,720.00	
	BELGIAN 2.15	500,000.00	737,140.00	
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,364,256.00	
	BTPS 0.35	2,700,000.00	2,752,704.00	

BTPS 0.5	1,000,000.00	1,024,540.00	
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,045,400.00	
BTPS 0.85	1,700,000.00	1,769,598.00	
BTPS 0.9	1,200,000.00	1,230,876.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,042,020.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,043,140.00	
BTPS 0.95	800,000.00	837,024.00	
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,862,820.00	
BTPS 1.25	800,000.00	850,472.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,039,240.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,898,010.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,060,280.00	
BTPS 1.45	200,000.00	210,630.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,868,642.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,291,884.00	
BTPS 1.65	2,200,000.00	2,409,220.00	
BTPS 1.65	700,000.00	765,058.00	
BTPS 1.7	1,500,000.00	1,513,485.00	
BTPS 1.85	3,000,000.00	3,175,920.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,076,140.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,415,687.00	
BTPS 2	3,900,000.00	4,340,505.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,666,440.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,101,930.00	
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,573,815.00	
BTPS 2.25	500,000.00	580,620.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,297,197.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,066,086.00	
BTPS 2.5	600,000.00	653,370.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,329,950.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,917,582.50	
BTPS 2.8	300,000.00	352,857.00	
BTPS 2.8	600,000.00	734,148.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,645,371.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,203,290.00	

		BTPS 3.1	900,000.00	1,163,682.00	
		BTPS 3.25	1,500,000.00	2,028,615.00	
		BTPS 3.35	850,000.00	1,102,518.00	
		BTPS 3.45	1,400,000.00	1,962,198.00	
		BTPS 3.5	4,400,000.00	5,505,544.00	
		BTPS 3.75	1,500,000.00	1,680,270.00	
		BTPS 3.85	900,000.00	1,350,900.00	
		BTPS 4	2,600,000.00	3,644,550.00	
		BTPS 4.5	2,300,000.00	2,488,508.00	
		BTPS 4.5	1,000,000.00	1,120,330.00	
		BTPS 4.5	1,800,000.00	2,168,424.00	
		BTPS 4.75	2,500,000.00	2,747,225.00	
		BTPS 4.75	2,000,000.00	2,610,300.00	
		BTPS 4.75	1,600,000.00	2,622,656.00	
		BTPS 5	1,000,000.00	1,182,150.00	
		BTPS 5	2,070,000.00	3,089,971.80	
		BTPS 5	1,800,000.00	2,878,488.00	
		BTPS 5	1,700,000.00	2,751,552.00	
		BTPS 5.5	1,200,000.00	1,269,744.00	
		BTPS 5.5	2,000,000.00	2,136,140.00	
		BTPS 5.75	1,700,000.00	2,618,408.00	
		BTPS 6	2,200,000.00	3,316,566.00	
		BTPS 6.5	1,700,000.00	2,353,599.00	
		BTPS 7.25	400,000.00	549,000.00	
		BTPS 9	300,000.00	360,471.00	
		BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,591,980.00	
		BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,015,540.00	
		BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,922,515.00	
		BUNDESOBL-178 0	1,600,000.00	1,625,296.00	
		BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,325,220.00	
		BUNDESOBL-180 0	1,100,000.00	1,125,696.00	
		BUNDESOBL-182 0	1,800,000.00	1,853,316.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,645,390.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,354,184.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	3,800,000.00	3,954,698.00	

DEUTSCHLAND REP 0		2,100,000.00	2,147,586.00	
DEUTSCHLAND REP 0		3,100,000.00	2,989,175.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25		3,800,000.00	3,991,444.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25		900,000.00	952,812.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25		3,300,000.00	3,500,904.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5		2,500,000.00	2,608,100.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5		3,100,000.00	3,268,640.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5		3,400,000.00	3,633,444.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5		2,100,000.00	2,252,796.00	
DEUTSCHLAND REP 1		1,300,000.00	1,367,613.00	
DEUTSCHLAND REP 1		2,050,000.00	2,190,835.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25		1,650,000.00	2,163,513.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5		2,100,000.00	2,168,418.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5		1,300,000.00	1,349,179.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5		3,600,000.00	3,819,960.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75		2,200,000.00	2,335,410.00	
DEUTSCHLAND REP 2		2,000,000.00	2,107,240.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5		2,200,000.00	3,478,266.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5		2,500,000.00	4,043,375.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25		700,000.00	1,189,517.00	
DEUTSCHLAND REP 4		1,800,000.00	2,979,072.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25		950,000.00	1,706,143.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75		1,600,000.00	2,198,928.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75		600,000.00	999,054.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75		1,650,000.00	3,187,651.50	
DEUTSCHLAND REP 5.5		900,000.00	1,415,655.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625		1,000,000.00	1,405,950.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25		1,200,000.00	1,396,440.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25		500,000.00	790,140.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5		1,000,000.00	1,426,590.00	
FINNISH GOV'T 0.25		300,000.00	301,566.00	
FINNISH GOV'T 0.5		400,000.00	426,012.00	
FINNISH GOV'T 0.5		800,000.00	853,440.00	
FINNISH GOV'T 0.75		500,000.00	546,700.00	
FINNISH GOV'T 1.375		300,000.00	380,193.00	

		FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,036,390.00	
		FINNISH GOV'T 1.625	800,000.00	819,408.00	
		FINNISH GOV'T 2	600,000.00	643,134.00	
		FINNISH GOV'T 2.625	1,000,000.00	1,495,610.00	
		FINNISH GOV'T 2.75	400,000.00	489,328.00	
		FINNISH GOV'T 4	600,000.00	708,990.00	
		FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,021,500.00	
		FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,930,932.00	
		FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,068,400.00	
		FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,941,553.00	
		FRANCE O.A.T. 0	3,100,000.00	3,176,384.00	
		FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,583,205.00	
		FRANCE O.A.T. 0	3,900,000.00	3,947,541.00	
		FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,495,952.00	
		FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	745,920.00	
		FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,020,988.00	
		FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,673,845.00	
		FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,969,260.00	
		FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,553,308.00	
		FRANCE O.A.T. 0.75	2,000,000.00	2,158,400.00	
		FRANCE O.A.T. 0.75	2,700,000.00	2,694,330.00	
		FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,188,272.50	
		FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,710,700.00	
		FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,735,592.00	
		FRANCE O.A.T. 1.25	3,400,000.00	3,892,422.00	
		FRANCE O.A.T. 1.5	2,550,000.00	2,949,687.00	
		FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,895,864.00	
		FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,376,022.00	
		FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,801,578.00	
		FRANCE O.A.T. 1.75	1,800,000.00	2,243,718.00	
		FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,059,976.00	
		FRANCE O.A.T. 2	2,200,000.00	2,929,916.00	
		FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	1,962,909.00	
		FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,671,558.00	
		FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,334,575.00	

FRANCE O.A.T. 2.75		3,850,000.00	4,616,073.00	
FRANCE O.A.T. 3.25		1,700,000.00	2,725,423.00	
FRANCE O.A.T. 3.5		2,500,000.00	2,974,350.00	
FRANCE O.A.T. 4		2,000,000.00	3,236,080.00	
FRANCE O.A.T. 4		1,370,000.00	2,684,117.70	
FRANCE O.A.T. 4		1,400,000.00	2,874,592.00	
FRANCE O.A.T. 4.25		4,000,000.00	4,423,080.00	
FRANCE O.A.T. 4.5		2,300,000.00	4,074,128.00	
FRANCE O.A.T. 4.75		2,200,000.00	3,575,066.00	
FRANCE O.A.T. 5.5		2,750,000.00	3,986,235.00	
FRANCE O.A.T. 5.75		800,000.00	1,316,384.00	
FRANCE O.A.T. 6		3,000,000.00	3,826,800.00	
FRANCE O.A.T. 8.5		600,000.00	689,928.00	
IRISH GOVT 0		400,000.00	402,832.00	
IRISH GOVT 0.9		700,000.00	759,262.00	
IRISH GOVT 1		1,000,000.00	1,072,350.00	
IRISH GOVT 1.1		1,600,000.00	1,767,216.00	
IRISH GOVT 1.3		600,000.00	685,290.00	
IRISH GOVT 1.35		500,000.00	569,590.00	
IRISH GOVT 1.5		500,000.00	600,790.00	
IRISH GOVT 1.7		300,000.00	363,315.00	
IRISH GOVT 2		1,000,000.00	1,319,440.00	
IRISH GOVT 2.4		600,000.00	736,086.00	
IRISH GOVT 3.4		500,000.00	551,070.00	
IRISH GOVT 3.9		500,000.00	534,930.00	
IRISH GOVT 5.4		800,000.00	969,792.00	
NETHERLANDS GOVT 0		1,000,000.00	1,017,430.00	
NETHERLANDS GOVT 0		1,900,000.00	1,954,834.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25		1,700,000.00	1,761,744.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25		500,000.00	525,685.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5		1,700,000.00	1,794,996.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5		1,700,000.00	1,846,336.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75		400,000.00	431,264.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75		1,500,000.00	1,629,240.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75		1,600,000.00	1,674,448.00	

NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,078,550.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	600,000.00	786,258.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	1,992,600.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	500,000.00	530,375.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,273,492.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,800,000.00	2,923,956.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	971,908.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,115,587.00	
REP OF AUSTRIA 0	900,000.00	918,468.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	847,192.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	550,000.00	584,474.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	961,587.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	754,985.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,100,000.00	1,182,599.00	
REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	148,587.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,077,870.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	277,148.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	885,409.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	800,000.00	860,040.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,053,580.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,172,133.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	975,060.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	900,000.00	944,568.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,512,875.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	500,000.00	811,380.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	626,830.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,404,420.00	
SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,017,430.00	
SPANISH GOV'T 0.25	700,000.00	716,163.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	506,230.00	
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,034,590.00	
SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	424,264.00	
SPANISH GOV'T 1	300,000.00	284,940.00	
SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	526,220.00	
SPANISH GOV'T 1.25	3,000,000.00	3,295,890.00	

		SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,930,877.00	
		SPANISH GOV'T 1.4	2,200,000.00	2,424,994.00	
		SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,768,352.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	400,000.00	371,828.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,866,474.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,226,337.00	
		SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,322,076.00	
		SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,831,274.00	
		SPANISH GOV'T 1.85	2,700,000.00	3,155,733.00	
		SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,884,076.00	
		SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,975,842.00	
		SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,661,192.00	
		SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,223,830.00	
		SPANISH GOV'T 2.7	1,250,000.00	1,709,775.00	
		SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,319,114.00	
		SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,967,994.00	
		SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,756,117.00	
		SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,562,666.00	
		SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,515,804.50	
		SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,215,800.00	
		SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,163,006.00	
		SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,552,175.00	
		SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,389,940.00	
		SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,585,640.00	
		SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,064,870.00	
		SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,866,760.00	
		SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,438,685.00	
		SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,376,645.00	
		SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	654,605.00	
		SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,193,784.00	
	ユーロ 小計		416,740,000.00	493,994,303.00 (64,125,400,472)	
	英ポンド	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	700,000.00	
		UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,486,440.00	
		UK TSY GILT 0.375	2,000,000.00	1,948,260.00	

		UK TSY GILT 0.625	800,000.00	810,872.00	
		UK TSY GILT 0.625	600,000.00	574,710.00	
		UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,680,342.50	
		UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,023,510.00	
		UK TSY GILT 1	800,000.00	816,896.00	
		UK TSY GILT 1.25	1,200,000.00	1,258,152.00	
		UK TSY GILT 1.5	1,300,000.00	1,373,242.00	
		UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,863,965.00	
		UK TSY GILT 1.625	1,800,000.00	1,943,190.00	
		UK TSY GILT 1.625	500,000.00	580,825.00	
		UK TSY GILT 1.75	900,000.00	915,039.00	
		UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,334,988.00	
		UK TSY GILT 1.75	850,000.00	987,836.00	
		UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,175,559.00	
		UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,812,968.00	
		UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,490,432.00	
		UK TSY GILT 2.75	600,000.00	645,468.00	
		UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,294,192.00	
		UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,480,049.00	
		UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,863,851.50	
		UK TSY GILT 3.75	1,200,000.00	2,054,304.00	
		UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,346,841.00	
		UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,728,118.00	
		UK TSY GILT 4.25	700,000.00	952,238.00	
		UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,525,062.00	
		UK TSY GILT 4.25	1,250,000.00	1,920,637.50	
		UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,033,382.00	
		UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,553,435.00	
		UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,602,477.00	
		UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,287,800.00	
		UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,592,437.00	
		UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,239,434.00	
		UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,572,878.00	
		UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,920,984.00	
		UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,514,214.00	

	UK TSY GILT 6	650,000.00	903,487.00	
英ポンド 小計		49,650,000.00	65,808,515.50 (9,999,603,930)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,193,360.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	6,000,000.00	6,306,420.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	5,900,000.00	6,232,996.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,273,700.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,499,500.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,902,898.00	
スウェーデンクローナ 小計		32,500,000.00	36,408,874.00 (464,577,232)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,013,220.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,566,150.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,078,420.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	4,200,000.00	4,356,702.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,092,520.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,463,050.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,210,600.00	
ノルウェークローネ 小計		29,700,000.00	30,780,662.00 (389,683,180)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,257,490.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	10,100,000.00	10,632,270.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,230,800.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	6,000,000.00	6,261,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,561,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	9,800,000.00	17,451,840.00	
デンマーククローネ 小計		37,200,000.00	46,394,400.00 (810,046,224)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	2,400,000.00	2,382,806.35	
	POLAND GOVT BOND 0.75	6,100,000.00	6,070,049.00	
	POLAND GOVT BOND 1.25	1,800,000.00	1,714,626.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,900,000.00	5,046,216.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,712,445.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	6,000,000.00	6,474,420.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	5,300,000.00	5,718,859.00	

ポーランドズロチ 小計		31,000,000.00	32,119,421.35 (917,266,435)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	1,100,000.00	1,087,922.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	2,500,000.00	2,567,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	800,000.00	729,680.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,539,705.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,800,000.00	3,046,540.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,850,000.00	2,062,565.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,678,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,785,440.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	200,000.00	224,784.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,300,000.00	3,736,920.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	919,760.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,647,263.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,094,370.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,300,000.00	1,512,550.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	3,099,780.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,542,120.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,090,165.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,100,000.00	1,478,180.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	1,400,000.00	1,522,962.00	
オーストラリアドル 小計		32,450,000.00	36,366,667.20 (2,942,427,043)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,073,110.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	439,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,251,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	461,142.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	817,250.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	500,000.00	564,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	752,010.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	700,000.00	719,180.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	750,000.00	895,875.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,703,700.00	
シンガポールドル 小計		7,850,000.00	8,677,267.00 (709,366,577)	
マレーシアリンギット	MALAYSIA GOVT 3.478	2,500,000.00	2,576,224.75	

		MALAYSIA GOVT 3.502	7,700,000.00	7,938,101.71	
		MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,579,760.50	
		MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,472,028.50	
		MALAYSIA GOVT 4.736	6,400,000.00	6,846,030.08	
	マレーシアリンギット 小計		26,900,000.00	28,412,145.54 (752,029,715)	
	イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.15	6,600,000.00	6,605,280.00	
		ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	2,988,914.00	
		ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,646,610.00	
		ISRAEL FIXED 3.75	4,100,000.00	5,307,778.00	
		ISRAEL FIXED 6.25	3,300,000.00	4,261,554.00	
	イスラエルシュケル 小計		18,400,000.00	20,810,136.00 (712,751,320)	
合計				158,834,336,056 (158,834,336,056)	

（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	45.4%	45.8%
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	40.0%	40.4%
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%	1.9%
シンガポールドル	国債証券　10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　5銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券　5銘柄	0.4%	0.4%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	396,959	674,283,873
コール・ローン	1,924,077,371	1,305,798,539
株式	171,265,905,610	207,943,757,270
派生商品評価勘定	11,871,100	11,265,900
未収入金	323,400	5,454,800
未収配当金	78,005,333	84,277,534
差入委託証拠金	24,345,000	75,463,000
流動資産合計	173,304,924,773	210,100,300,916
資産合計	173,304,924,773	210,100,300,916
負債の部		
流動負債		
前受金	11,980,000	11,322,000
未払解約金	371,068,201	529,677,177
未払利息	5,626	2,880
その他未払費用	46,575	74,091
流動負債合計	383,100,402	541,076,148
負債合計	383,100,402	541,076,148
純資産の部		
元本等		
元本	65,642,531,273	60,456,249,906
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	107,279,293,098	149,102,974,862
元本等合計	172,921,824,371	209,559,224,768
純資産合計	172,921,824,371	209,559,224,768
負債純資産合計	173,304,924,773	210,100,300,916

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日

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

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式　2,782,000,000円	――――――
２．　当計算期間の末日における受益権の総数	65,642,531,273口	60,456,249,906口
３．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.6343円 (10,000口当たりの純資産額　26,343円)	1口当たり純資産額　3.4663円 (10,000口当たりの純資産額　34,663円)

（金融商品に関する注記）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「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10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100
	東証株価指数先物	1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100
合計		1,582,028,900	-	1,593,900,000	11,871,100

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900
	東証株価指数先物	1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900
合計		1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900

（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11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,012,358,207円
同期中における追加設定元本額	16,719,008,847円
同期中における一部解約元本額	18,088,835,781円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,813,378,482円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	953,041,285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
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	131,539,547円
三井住友・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）	129,852,969円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	94,086,891円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	193,204,597円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,493,615,700円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	14,225,871,549円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	557,959,858円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	630,495,924円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	447,100,100円
イオン・バランス戦略ファンド	79,845,037円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	18,359,609円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	106,722,289円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	84,278,805円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	274,421,727円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	142,865,288円

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	159,916,843円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	20,691,114円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	84,086,424円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	4,992,000円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	28,393,555円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	20,856,396円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,094,930円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,486,612,046円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	19,476,993円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	186,206,344円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	2,812,194,105円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	2,214,774,108円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	8,246,410,160円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	51,276,484円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	205,573,161円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	540,428円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	875,143,551円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	57,132,852円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	353,640,333円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,043,896,738円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	830,900,906円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	2,647,623,830円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	804,861円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	56,901,418円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	69,745,478円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,825,793円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	21,322,488円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	169,576,105円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	335,050,151円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	96,790,701円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	51,654,165円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	9,439,355円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	62,708,516円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	834,474,721円
ＳＭＡＭ・国内株式インデックスファンド・ＶＡ（適格機関投資家専用）	192,328,030円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	5,300,553円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	651,269,490円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	170,212,578円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,464,565,051円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	112,200,588円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	16,640,426円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	57,544,240円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	74,945,830円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII＜適格機関投資家限定＞	512,787,716円
合計	65,642,531,273円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	65,642,531,273円
同期中における追加設定元本額	9,902,713,440円
同期中における一部解約元本額	15,088,994,807円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,379,403,856円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	909,675,852円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,455,635,202円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,352,534,788円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	143,884,400円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	4,736,179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）	20,511,740円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	62,883,753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）	143,476,016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）	118,710,414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）	215,267,876円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,181,014,563円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	17,257,669,739円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	201,345,776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）	133,196,842円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	447,445,953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）	261,468,545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	382,708,260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	382,137円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,918,982,335円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	13,424,861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＞	1,963,923,797円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,748,611,027円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,626,254,632円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	43,639,644円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	177,043,333円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	777,143,594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＞	47,588,920円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	279,517,682円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	896,070,775円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	642,840,596円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	2,010,301,600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＞	51,538,337円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	35,737,801円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	16,949,666円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	122,030,038円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	266,425,624円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	68,194,442円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	41,736,057円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	7,545,581円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	48,295,560円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	646,556,597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＞	327,199,136円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	74,013,645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＞	27,701,727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＞	58,420,144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＞	63,463,668円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	72,621,282円
合計	60,456,249,906円

附属明細表

①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	3,600	3,095.00	11,142,000	
日本水産	90,300	632.00	57,069,600	
マルハニチロ	15,100	2,646.00	39,954,600	
雪国まいたけ	8,500	1,657.00	14,084,500	
カネコ種苗	4,900	1,545.00	7,570,500	

サカタのタネ	11,500	3,685.00	42,377,500	
ホクト	8,100	1,979.00	16,029,900	
日鉄鉱業	2,400	7,200.00	17,280,000	
ＩＮＰＥＸ	398,700	784.00	312,580,800	
石油資源開発	13,800	1,915.00	26,427,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,100	1,374.00	8,381,400	
ヒノキヤグループ	3,300	2,385.00	7,870,500	
ショーボンドホールディングス	14,100	5,160.00	72,756,000	
ミライト・ホールディングス	33,000	2,302.00	75,966,000	
タマホーム	6,300	3,095.00	19,498,500	
ベステラ	3,900	1,484.00	5,787,600	
スペースバリューホールディングス	14,600	849.00	12,395,400	
安藤・間	61,900	842.00	52,119,800	
東急建設	30,800	802.00	24,701,600	
コムシスホールディングス	34,700	3,135.00	108,784,500	
ビーアールホールディングス	13,600	528.00	7,180,800	
高松コンストラクショングループ	6,200	2,150.00	13,330,000	
東建コーポレーション	2,900	11,150.00	32,335,000	
オリエンタル白石	39,700	272.00	10,798,400	
大成建設	70,500	3,625.00	255,562,500	
大林組	225,700	939.00	211,932,300	
清水建設	211,800	821.00	173,887,800	
飛島建設	9,400	1,138.00	10,697,200	
長谷工コーポレーション	73,900	1,585.00	117,131,500	
松井建設	11,800	831.00	9,805,800	
錢高組	1,700	4,250.00	7,225,000	
鹿島建設	166,000	1,506.00	249,996,000	
不動テトラ	6,900	1,806.00	12,461,400	
大末建設	7,100	995.00	7,064,500	
鉄建建設	6,500	1,845.00	11,992,500	
西松建設	16,300	3,640.00	59,332,000	
三井住友建設	54,500	494.00	26,923,000	
大豊建設	5,200	3,975.00	20,670,000	
前田建設工業	58,300	842.00	49,088,600	
奥村組	12,300	3,200.00	39,360,000	
東鉄工業	8,900	2,536.00	22,570,400	

淺沼組	3,200	4,655.00	14,896,000	
戸田建設	93,600	846.00	79,185,600	
熊谷組	10,200	2,811.00	28,672,200	
北野建設	2,500	2,208.00	5,520,000	
矢作建設工業	13,000	800.00	10,400,000	
ピーエス三菱	10,400	661.00	6,874,400	
日本ハウスホールディングス	24,200	433.00	10,478,600	
大東建託	24,900	13,270.00	330,423,000	
新日本建設	10,500	920.00	9,660,000	
ＮＩＰＰＯ	18,400	4,000.00	73,600,000	
東亜道路工業	1,900	4,640.00	8,816,000	
前田道路	14,500	1,936.00	28,072,000	
日本道路	2,200	8,670.00	19,074,000	
東亜建設工業	6,800	2,418.00	16,442,400	
日本国土開発	22,200	600.00	13,320,000	
若築建設	6,500	2,177.00	14,150,500	
東洋建設	26,200	575.00	15,065,000	
五洋建設	97,300	767.00	74,629,100	
世紀東急工業	13,300	890.00	11,837,000	
福田組	2,800	4,995.00	13,986,000	
住友林業	58,400	2,249.00	131,341,600	
巴コーポレーション	15,200	503.00	7,645,600	
大和ハウス工業	210,000	3,752.00	787,920,000	
ライト工業	12,100	2,003.00	24,236,300	
積水ハウス	246,600	2,362.50	582,592,500	
北陸電気工事	4,900	1,332.00	6,526,800	
ユアテック	14,700	755.00	11,098,500	
日本リーテック	5,800	1,816.00	10,532,800	
中電工	9,900	2,387.00	23,631,300	
関電工	34,100	975.00	33,247,500	
きんでん	46,100	1,980.00	91,278,000	
東京エネシス	9,600	1,108.00	10,636,800	
トーエネック	2,900	3,850.00	11,165,000	
住友電設	6,300	2,462.00	15,510,600	
日本電設工業	11,500	1,870.00	21,505,000	
協和エクシオ	33,900	2,943.00	99,767,700	

新日本空調	6,400	2,515.00	16,096,000	
九電工	15,900	4,190.00	66,621,000	
三機工業	14,900	1,582.00	23,571,800	
日揮ホールディングス	76,000	998.00	75,848,000	
中外炉工業	4,300	1,882.00	8,092,600	
ヤマト	10,000	780.00	7,800,000	
太平電業	5,400	2,903.00	15,676,200	
高砂熱学工業	19,500	2,214.00	43,173,000	
朝日工業社	2,500	3,525.00	8,812,500	
明星工業	17,300	770.00	13,321,000	
大氣社	10,600	3,615.00	38,319,000	
ダイダン	5,000	2,820.00	14,100,000	
日比谷総合設備	7,400	1,971.00	14,585,400	
テスホールディングス	4,800	2,539.00	12,187,200	
東洋エンジニアリング	10,000	877.00	8,770,000	
レイズネクスト	12,100	1,199.00	14,507,900	
ニップン	19,000	1,675.00	31,825,000	
日清製粉グループ本社	81,600	1,908.00	155,692,800	
昭和産業	5,500	2,837.00	15,603,500	
鳥越製粉	8,500	794.00	6,749,000	
中部飼料	9,200	1,157.00	10,644,400	
フィード・ワン	10,500	777.00	8,158,500	
日本甜菜製糖	5,100	1,657.00	8,450,700	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	5,700	1,990.00	11,343,000	
日新製糖	4,200	1,709.00	7,177,800	
森永製菓	17,100	4,110.00	70,281,000	
中村屋	2,000	3,900.00	7,800,000	
江崎グリコ	19,900	4,280.00	85,172,000	
名糖産業	3,800	1,795.00	6,821,000	
井村屋グループ	4,600	2,356.00	10,837,600	
不二家	5,100	2,412.00	12,301,200	
山崎製パン	54,700	1,942.00	106,227,400	
モロゾフ	1,700	5,540.00	9,418,000	
亀田製菓	4,100	4,695.00	19,249,500	
寿スピリッツ	7,100	7,270.00	51,617,000	
カルビー	33,200	2,831.00	93,989,200	

森永乳業	13,500	7,280.00	98,280,000	
六甲バター	6,200	1,674.00	10,378,800	
ヤクルト本社	50,000	5,710.00	285,500,000	
明治ホールディングス	47,800	7,090.00	338,902,000	
雪印メグミルク	17,400	2,333.00	40,594,200	
プリマハム	9,700	3,115.00	30,215,500	
日本ハム	27,700	4,550.00	126,035,000	
丸大食品	6,700	1,817.00	12,173,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,500	3,175.00	20,637,500	
柿安本店	3,000	2,639.00	7,917,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	41,500	761.00	31,581,500	
サッポロホールディングス	24,900	2,533.00	63,071,700	
アサヒグループホールディングス	171,900	5,443.00	935,651,700	
キリンホールディングス	268,800	2,076.50	558,163,200	
宝ホールディングス	53,500	1,618.00	86,563,000	
オエノンホールディングス	25,200	396.00	9,979,200	
養命酒製造	3,700	1,886.00	6,978,200	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	50,900	1,619.00	82,407,100	
サントリー食品インターナショナル	48,500	4,700.00	227,950,000	
ダイドーグループホールディングス	3,900	5,900.00	23,010,000	
伊藤園	22,100	7,470.00	165,087,000	
キーコーヒー	6,600	2,272.00	14,995,200	
日清オイリオグループ	8,400	3,140.00	26,376,000	
不二製油グループ本社	17,900	2,603.00	46,593,700	
かどや製油	1,400	4,150.00	5,810,000	
Ｊ－オイルミルズ	6,300	1,868.00	11,768,400	
キッコーマン	52,300	9,200.00	481,160,000	
味の素	173,100	3,528.00	610,696,800	
ブルドックソース	4,300	2,097.00	9,017,100	
キユーピー	40,600	2,780.00	112,868,000	
ハウス食品グループ本社	27,100	3,720.00	100,812,000	
カゴメ	27,700	3,050.00	84,485,000	
焼津水産化学工業	7,000	1,019.00	7,133,000	
アリアケジャパン	6,700	6,760.00	45,292,000	
ニチレイ	34,700	2,961.00	102,746,700	

東洋水産	37,300	5,130.00	191,349,000	
イートアンドホールディングス	4,300	2,253.00	9,687,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,500	775.00	4,262,500	
日清食品ホールディングス	28,500	9,060.00	258,210,000	
永谷園ホールディングス	4,500	2,165.00	9,742,500	
一正蒲鉾	5,600	948.00	5,308,800	
フジッコ	7,400	1,938.00	14,341,200	
ロック・フィールド	8,300	1,692.00	14,043,600	
日本たばこ産業	390,200	2,193.00	855,708,600	
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,606.00	8,672,400	
わらべや日洋ホールディングス	5,600	2,440.00	13,664,000	
なとり	5,500	2,000.00	11,000,000	
ピックルスコーポレーション	4,400	2,090.00	9,196,000	
ファーマフーズ	7,000	2,778.00	19,446,000	
北の達人コーポレーション	25,600	508.00	13,004,800	
ユーグレナ	37,800	928.00	35,078,400	
ミヨシ油脂	4,800	1,344.00	6,451,200	
理研ビタミン	8,100	1,893.00	15,333,300	
片倉工業	7,600	1,570.00	11,932,000	
グンゼ	5,100	4,550.00	23,205,000	
東洋紡	29,200	1,441.00	42,077,200	
ユニチカ	24,700	370.00	9,139,000	
富士紡ホールディングス	3,800	4,450.00	16,910,000	
倉敷紡績	6,600	2,032.00	13,411,200	
シキボウ	6,900	949.00	6,548,100	
日本毛織	22,300	1,053.00	23,481,900	
帝国繊維	8,400	2,134.00	17,925,600	
帝人	66,700	1,666.00	111,122,200	
東レ	516,000	746.10	384,987,600	
住江織物	2,800	1,899.00	5,317,200	
アツギ	10,200	646.00	6,589,200	
ダイニック	6,000	770.00	4,620,000	
セーレン	17,600	2,160.00	38,016,000	
小松マテーレ	13,000	1,039.00	13,507,000	
ワコールホールディングス	18,200	2,423.00	44,098,600	
ホギメディカル	9,500	3,415.00	32,442,500	

ＴＳＩホールディングス	28,900	338.00	9,768,200	
マツオカコーポレーション	3,300	1,542.00	5,088,600	
ワールド	10,200	1,432.00	14,606,400	
オンワードホールディングス	46,900	323.00	15,148,700	
ゴールドウイン	11,900	7,320.00	87,108,000	
デサント	12,300	3,975.00	48,892,500	
特種東海製紙	4,400	4,590.00	20,196,000	
王子ホールディングス	318,500	594.00	189,189,000	
日本製紙	31,600	1,234.00	38,994,400	
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	1,240.00	6,696,000	
大王製紙	33,900	2,179.00	73,868,100	
レンゴー	73,700	926.00	68,246,200	
トーモク	5,400	1,979.00	10,686,600	
ザ・パック	5,800	2,992.00	17,353,600	
クラレ	104,300	1,091.00	113,791,300	
旭化成	470,500	1,235.00	581,067,500	
昭和電工	50,700	2,632.00	133,442,400	
住友化学	555,600	594.00	330,026,400	
住友精化	3,600	3,740.00	13,464,000	
日産化学	39,000	6,920.00	269,880,000	
ラサ工業	2,800	2,055.00	5,754,000	
クレハ	6,000	8,240.00	49,440,000	
多木化学	3,000	6,830.00	20,490,000	
テイカ	6,100	1,406.00	8,576,600	
石原産業	13,700	1,223.00	16,755,100	
日本曹達	9,800	3,710.00	36,358,000	
東ソー	109,400	2,182.00	238,710,800	
トクヤマ	21,200	2,249.00	47,678,800	
セントラル硝子	13,900	2,208.00	30,691,200	
東亞合成	43,700	1,370.00	59,869,000	
大阪ソーダ	6,900	2,913.00	20,099,700	
関東電化工業	17,300	1,130.00	19,549,000	
デンカ	25,900	4,135.00	107,096,500	
信越化学工業	131,300	20,620.00	2,707,406,000	
堺化学工業	5,500	2,312.00	12,716,000	

第一稀元素化学工業	8,000	1,771.00	14,168,000	
エア・ウォーター	72,400	1,888.00	136,691,200	
日本酸素ホールディングス	58,500	3,060.00	179,010,000	
日本化学工業	2,500	3,605.00	9,012,500	
日本パーカライジング	36,800	1,246.00	45,852,800	
高圧ガス工業	13,300	785.00	10,440,500	
四国化成工業	9,400	1,441.00	13,545,400	
ステラ　ケミファ	4,200	3,165.00	13,293,000	
保土谷化学工業	2,400	5,380.00	12,912,000	
日本触媒	13,000	6,090.00	79,170,000	
大日精化工業	5,600	2,700.00	15,120,000	
カネカ	18,300	4,790.00	87,657,000	
三菱瓦斯化学	70,900	2,453.00	173,917,700	
三井化学	61,100	3,940.00	240,734,000	
ＪＳＲ	71,300	4,175.00	297,677,500	
東京応化工業	12,200	8,060.00	98,332,000	
大阪有機化学工業	6,500	4,135.00	26,877,500	
三菱ケミカルホールディングス	474,600	1,014.00	481,244,400	
ＫＨネオケム	11,800	3,145.00	37,111,000	
ダイセル	95,900	908.00	87,077,200	
住友ベークライト	11,300	5,300.00	59,890,000	
積水化学工業	147,600	2,015.00	297,414,000	
日本ゼオン	64,400	1,684.00	108,449,600	
アイカ工業	19,900	3,960.00	78,804,000	
宇部興産	35,400	2,331.00	82,517,400	
積水樹脂	10,500	2,320.00	24,360,000	
タキロンシーアイ	17,000	660.00	11,220,000	
旭有機材	5,100	1,554.00	7,925,400	
ニチバン	4,800	1,855.00	8,904,000	
リケンテクノス	19,800	615.00	12,177,000	
大倉工業	3,800	2,307.00	8,766,600	
積水化成品工業	12,000	615.00	7,380,000	
群栄化学工業	2,600	3,030.00	7,878,000	
ダイキョーニシカワ	16,300	694.00	11,312,200	
森六ホールディングス	4,600	2,216.00	10,193,600	
恵和	1,600	5,040.00	8,064,000	

日本化薬	44,400	1,300.00	57,720,000	
カーリットホールディングス	9,500	935.00	8,882,500	
日本精化	6,100	2,349.00	14,328,900	
扶桑化学工業	5,400	5,010.00	27,054,000	
トリケミカル研究所	6,700	3,720.00	24,924,000	
ＡＤＥＫＡ	32,700	2,782.00	90,971,400	
日油	26,700	6,810.00	181,827,000	
新日本理化	18,000	300.00	5,400,000	
ハリマ化成グループ	7,100	928.00	6,588,800	
花王	160,800	6,961.00	1,119,328,800	
第一工業製薬	2,700	3,400.00	9,180,000	
ニイタカ	2,400	2,429.00	5,829,600	
三洋化成工業	4,100	6,200.00	25,420,000	
大日本塗料	10,100	890.00	8,989,000	
日本ペイントホールディングス	268,300	1,395.00	374,278,500	
関西ペイント	79,900	2,940.00	234,906,000	
中国塗料	18,000	913.00	16,434,000	
日本特殊塗料	6,700	1,091.00	7,309,700	
藤倉化成	12,600	559.00	7,043,400	
太陽ホールディングス	5,200	6,210.00	32,292,000	
ＤＩＣ	29,700	3,310.00	98,307,000	
サカタインクス	13,700	1,203.00	16,481,100	
東洋インキＳＣホールディングス	13,900	2,147.00	29,843,300	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,200	859.00	7,043,800	
富士フイルムホールディングス	127,500	9,626.00	1,227,315,000	
資生堂	135,300	8,232.00	1,113,789,600	
ライオン	87,500	1,911.00	167,212,500	
高砂香料工業	4,600	3,020.00	13,892,000	
マンダム	15,400	1,676.00	25,810,400	
ミルボン	8,900	6,880.00	61,232,000	
ファンケル	26,400	3,975.00	104,940,000	
コーセー	13,700	13,950.00	191,115,000	
コタ	6,000	1,673.00	10,038,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	31,200	2,689.00	83,896,800	
ノエビアホールディングス	6,100	6,090.00	37,149,000	
新日本製薬	2,700	2,050.00	5,535,000	

エステー	5,600	1,850.00	10,360,000	
アグロ　カネショウ	3,800	1,541.00	5,855,800	
コニシ	11,900	1,833.00	21,812,700	
長谷川香料	12,400	2,981.00	36,964,400	
小林製薬	20,300	9,190.00	186,557,000	
荒川化学工業	7,000	1,316.00	9,212,000	
メック	5,200	3,685.00	19,162,000	
タカラバイオ	18,900	3,215.00	60,763,500	
ＪＣＵ	8,000	4,520.00	36,160,000	
デクセリアルズ	20,300	2,353.00	47,765,900	
アース製薬	5,400	6,830.00	36,882,000	
北興化学工業	7,800	1,188.00	9,266,400	
大成ラミック	3,300	2,899.00	9,566,700	
クミアイ化学工業	27,500	950.00	26,125,000	
日本農薬	16,800	568.00	9,542,400	
アキレス	6,200	1,381.00	8,562,200	
有沢製作所	11,500	941.00	10,821,500	
日東電工	43,700	9,410.00	411,217,000	
レック	9,800	1,146.00	11,230,800	
三光合成	11,500	461.00	5,301,500	
藤森工業	6,100	4,900.00	29,890,000	
未来工業	3,700	1,700.00	6,290,000	
ＪＳＰ	5,200	1,692.00	8,798,400	
エフピコ	13,600	4,325.00	58,820,000	
天馬	5,300	3,040.00	16,112,000	
信越ポリマー	11,900	1,051.00	12,506,900	
東リ	26,000	240.00	6,240,000	
ニフコ	26,700	3,675.00	98,122,500	
バルカー	6,100	2,247.00	13,706,700	
ユニ・チャーム	140,100	5,205.00	729,220,500	
協和キリン	84,800	4,035.00	342,168,000	
武田薬品工業	603,500	3,751.00	2,263,728,500	
アステラス製薬	628,600	1,902.00	1,195,597,200	
大日本住友製薬	54,000	2,083.00	112,482,000	
塩野義製薬	91,200	7,469.00	681,172,800	
日本新薬	20,600	9,380.00	193,228,000	

中外製薬	226,700	4,175.00	946,472,500	
科研製薬	12,500	5,040.00	63,000,000	
エーザイ	80,100	8,300.00	664,830,000	
ロート製薬	34,600	3,580.00	123,868,000	
小野薬品工業	166,400	2,684.00	446,617,600	
久光製薬	21,000	4,510.00	94,710,000	
持田製薬	10,200	3,620.00	36,924,000	
参天製薬	126,200	1,700.00	214,540,000	
扶桑薬品工業	3,400	2,588.00	8,799,200	
日本ケミファ	2,200	2,310.00	5,082,000	
ツムラ	24,400	3,845.00	93,818,000	
日医工	20,800	915.00	19,032,000	
キッセイ薬品工業	12,900	2,607.00	33,630,300	
生化学工業	12,800	1,127.00	14,425,600	
栄研化学	12,900	2,239.00	28,883,100	
鳥居薬品	4,800	3,045.00	14,616,000	
ＪＣＲファーマ	20,600	2,992.00	61,635,200	
東和薬品	10,100	3,265.00	32,976,500	
富士製薬工業	6,500	1,175.00	7,637,500	
ゼリア新薬工業	12,800	2,176.00	27,852,800	
第一三共	570,000	2,870.50	1,636,185,000	
キョーリン製薬ホールディングス	15,400	1,881.00	28,967,400	
大幸薬品	10,000	988.00	9,880,000	
ダイト	4,800	3,655.00	17,544,000	
大塚ホールディングス	150,600	4,953.00	745,921,800	
大正製薬ホールディングス	17,300	6,530.00	112,969,000	
ペプチドリーム	38,200	3,960.00	151,272,000	
あすか製薬ホールディングス	9,200	1,099.00	10,110,800	
サワイグループホールディングス	16,000	5,170.00	82,720,000	
日本コークス工業	80,300	131.00	10,519,300	
ニチレキ	9,300	1,350.00	12,555,000	
ユシロ化学工業	7,200	1,221.00	8,791,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,100	1,205.00	7,350,500	
出光興産	80,100	2,714.00	217,391,400	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,089,600	448.30	488,467,680	
コスモエネルギーホールディングス	23,000	2,317.00	53,291,000	

横浜ゴム	42,300	1,992.00	84,261,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	38,500	2,031.00	78,193,500	
ブリヂストン	208,900	5,305.00	1,108,214,500	
住友ゴム工業	64,900	1,385.00	89,886,500	
オカモト	4,500	4,600.00	20,700,000	
ニッタ	7,400	2,883.00	21,334,200	
住友理工	15,300	746.00	11,413,800	
三ツ星ベルト	9,100	2,157.00	19,628,700	
バンドー化学	14,700	956.00	14,053,200	
日東紡績	11,100	3,765.00	41,791,500	
ＡＧＣ	66,600	5,740.00	382,284,000	
日本板硝子	21,100	589.00	12,427,900	
日本電気硝子	27,100	2,477.00	67,126,700	
オハラ	3,700	1,527.00	5,649,900	
住友大阪セメント	13,700	3,195.00	43,771,500	
太平洋セメント	41,400	2,588.00	107,143,200	
日本ヒューム	11,000	759.00	8,349,000	
日本コンクリート工業	24,200	314.00	7,598,800	
三谷セキサン	3,600	6,450.00	23,220,000	
アジアパイルホールディングス	16,900	510.00	8,619,000	
東海カーボン	59,100	1,604.00	94,796,400	
日本カーボン	4,200	4,385.00	18,417,000	
東洋炭素	4,900	3,050.00	14,945,000	
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,455.00	19,156,500	
ＴＯＴＯ	51,900	6,490.00	336,831,000	
日本碍子	79,800	1,939.00	154,732,200	
日本特殊陶業	55,600	1,798.00	99,968,800	
ＭＡＲＵＷＡ	2,500	11,800.00	29,500,000	
品川リフラクトリーズ	2,200	4,140.00	9,108,000	
黒崎播磨	1,600	5,140.00	8,224,000	
ヨータイ	8,000	1,320.00	10,560,000	
東京窯業	14,800	339.00	5,017,200	
フジミインコーポレーテッド	5,900	6,760.00	39,884,000	
ニチアス	18,400	2,911.00	53,562,400	
ニチハ	10,200	3,335.00	34,017,000	
日本製鉄	342,600	2,301.00	788,322,600	

神戸製鋼所	131,300	734.00	96,374,200	
中山製鋼所	9,000	461.00	4,149,000	
合同製鐵	4,700	1,587.00	7,458,900	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	206,900	1,862.00	385,247,800	
東京製鐵	28,200	1,275.00	35,955,000	
共英製鋼	8,900	1,500.00	13,350,000	
大和工業	15,500	4,145.00	64,247,500	
東京鐵鋼	3,900	1,665.00	6,493,500	
大阪製鐵	5,000	1,258.00	6,290,000	
淀川製鋼所	9,200	2,600.00	23,920,000	
丸一鋼管	23,500	2,910.00	68,385,000	
モリ工業	2,800	2,562.00	7,173,600	
大同特殊鋼	11,800	5,180.00	61,124,000	
日本冶金工業	6,100	2,843.00	17,342,300	
山陽特殊製鋼	9,000	1,932.00	17,388,000	
愛知製鋼	4,200	2,857.00	11,999,400	
日立金属	65,600	2,140.00	140,384,000	
大平洋金属	5,500	2,050.00	11,275,000	
新日本電工	48,600	340.00	16,524,000	
栗本鐵工所	4,400	1,734.00	7,629,600	
三菱製鋼	8,700	1,446.00	12,580,200	
日本精線	1,500	5,180.00	7,770,000	
大紀アルミニウム工業所	10,600	1,848.00	19,588,800	
日本軽金属ホールディングス	19,900	2,115.00	42,088,500	
三井金属鉱業	19,200	3,515.00	67,488,000	
東邦亜鉛	4,600	2,711.00	12,470,600	
三菱マテリアル	47,100	2,344.00	110,402,400	
住友金属鉱山	91,700	4,384.00	402,012,800	
ＤＯＷＡホールディングス	18,000	5,000.00	90,000,000	
古河機械金属	11,500	1,299.00	14,938,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,100	824.00	8,322,400	
東邦チタニウム	13,400	1,273.00	17,058,200	
ＵＡＣＪ	10,800	2,983.00	32,216,400	
ＣＫサンエツ	2,000	3,435.00	6,870,000	
古河電気工業	22,400	2,429.00	54,409,600	
住友電気工業	250,400	1,537.50	384,990,000	

フジクラ	86,700	663.00	57,482,100	
昭和電線ホールディングス	7,500	2,232.00	16,740,000	
タツタ電線	14,900	554.00	8,254,600	
平河ヒューテック	5,400	1,256.00	6,782,400	
リョービ	9,400	1,338.00	12,577,200	
アサヒホールディングス	27,000	2,285.00	61,695,000	
稲葉製作所	4,700	1,499.00	7,045,300	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,724.00	8,716,800	
トーカロ	18,300	1,427.00	26,114,100	
アルファＣｏ	5,300	1,284.00	6,805,200	
ＳＵＭＣＯ	91,600	2,624.00	240,358,400	
川田テクノロジーズ	1,900	3,810.00	7,239,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,400	6,580.00	15,792,000	
東洋製罐グループホールディングス	46,000	1,420.00	65,320,000	
ホッカンホールディングス	5,300	1,479.00	7,838,700	
横河ブリッジホールディングス	12,000	2,384.00	28,608,000	
駒井ハルテック	2,900	1,785.00	5,176,500	
三和ホールディングス	68,200	1,560.00	106,392,000	
文化シヤッター	20,500	1,159.00	23,759,500	
三協立山	11,300	800.00	9,040,000	
アルインコ	7,000	1,065.00	7,455,000	
ＬＩＸＩＬ	99,000	3,340.00	330,660,000	
ノーリツ	15,000	1,964.00	29,460,000	
長府製作所	6,600	2,148.00	14,176,800	
リンナイ	13,900	13,230.00	183,897,000	
日東精工	13,100	682.00	8,934,200	
岡部	17,800	697.00	12,406,600	
ジーテクト	9,100	1,548.00	14,086,800	
東プレ	13,700	1,412.00	19,344,400	
高周波熱錬	19,000	700.00	13,300,000	
東京製綱	6,600	1,023.00	6,751,800	
パイオラックス	10,100	1,600.00	16,160,000	
エイチワン	9,100	750.00	6,825,000	
日本発條	71,900	835.00	60,036,500	
立川ブラインド工業	4,500	1,310.00	5,895,000	
三益半導体工業	5,500	2,634.00	14,487,000	

日本製鋼所	22,100	3,035.00	67,073,500	
三浦工業	31,100	5,200.00	161,720,000	
タクマ	24,000	1,722.00	41,328,000	
ツガミ	14,700	1,910.00	28,077,000	
オークマ	8,300	5,750.00	47,725,000	
芝浦機械	7,500	2,730.00	20,475,000	
アマダ	104,300	1,237.00	129,019,100	
アイダエンジニアリング	18,600	1,154.00	21,464,400	
ＦＵＪＩ	28,300	3,130.00	88,579,000	
牧野フライス製作所	8,400	4,390.00	36,876,000	
オーエスジー	33,800	2,123.00	71,757,400	
旭ダイヤモンド工業	21,200	539.00	11,426,800	
DMG森精機	42,300	2,161.00	91,410,300	
ソディック	17,500	943.00	16,502,500	
ディスコ	9,800	35,750.00	350,350,000	
日東工器	4,300	2,044.00	8,789,200	
日進工具	6,300	1,477.00	9,305,100	
豊和工業	5,500	856.00	4,708,000	
石川製作所	2,700	1,678.00	4,530,600	
島精機製作所	10,500	2,367.00	24,853,500	
オプトラン	9,100	2,419.00	22,012,900	
フリュー	8,300	1,650.00	13,695,000	
ヤマシンフィルタ	15,100	663.00	10,011,300	
日阪製作所	10,600	902.00	9,561,200	
やまびこ	13,800	1,332.00	18,381,600	
平田機工	3,400	6,880.00	23,392,000	
マルマエ	3,500	2,282.00	7,987,000	
タツモ	3,800	1,738.00	6,604,400	
ナブテスコ	41,000	4,800.00	196,800,000	
三井海洋開発	7,700	1,725.00	13,282,500	
レオン自動機	7,800	1,549.00	12,082,200	
ＳＭＣ	21,200	76,550.00	1,622,860,000	
ホソカワミクロン	2,600	7,250.00	18,850,000	
ユニオンツール	2,900	4,095.00	11,875,500	
オイレス工業	9,700	1,743.00	16,907,100	
日精エー・エス・ビー機械	2,600	4,310.00	11,206,000	

サトーホールディングス	9,500	2,800.00	26,600,000	
技研製作所	6,400	4,855.00	31,072,000	
日本エアーテック	3,900	1,304.00	5,085,600	
日精樹脂工業	7,000	1,206.00	8,442,000	
ワイエイシイホールディングス	4,800	978.00	4,694,400	
小松製作所	328,500	2,797.50	918,978,750	
住友重機械工業	41,200	3,120.00	128,544,000	
日立建機	33,900	3,290.00	111,531,000	
日工	13,600	690.00	9,384,000	
巴工業	3,700	2,496.00	9,235,200	
井関農機	8,500	1,817.00	15,444,500	
ＴＯＷＡ	7,000	2,927.00	20,489,000	
北川鉄工所	4,300	1,666.00	7,163,800	
ローツェ	3,100	9,350.00	28,985,000	
クボタ	354,000	2,391.00	846,414,000	
荏原実業	4,000	2,825.00	11,300,000	
三菱化工機	3,000	2,532.00	7,596,000	
月島機械	13,600	1,199.00	16,306,400	
帝国電機製作所	6,200	1,401.00	8,686,200	
新東工業	17,600	815.00	14,344,000	
澁谷工業	6,400	3,265.00	20,896,000	
アイチ　コーポレーション	13,200	792.00	10,454,400	
小森コーポレーション	18,200	872.00	15,870,400	
鶴見製作所	6,300	1,870.00	11,781,000	
酒井重工業	2,100	2,625.00	5,512,500	
荏原製作所	30,100	6,130.00	184,513,000	
酉島製作所	10,300	969.00	9,980,700	
北越工業	9,100	1,048.00	9,536,800	
ダイキン工業	92,400	29,155.00	2,693,922,000	
オルガノ	2,300	6,970.00	16,031,000	
トーヨーカネツ	3,500	2,615.00	9,152,500	
栗田工業	39,200	5,780.00	226,576,000	
椿本チエイン	10,000	3,560.00	35,600,000	
大同工業	5,100	1,127.00	5,747,700	
木村化工機	7,500	773.00	5,797,500	
アネスト岩田	12,500	1,061.00	13,262,500	

ダイフク	39,800	11,000.00	437,800,000	
サムコ	2,300	3,350.00	7,705,000	
加藤製作所	6,000	930.00	5,580,000	
タダノ	34,300	1,230.00	42,189,000	
フジテック	25,300	3,015.00	76,279,500	
ＣＫＤ	16,700	2,552.00	42,618,400	
キトー	7,200	1,780.00	12,816,000	
平和	20,300	2,089.00	42,406,700	
理想科学工業	6,300	2,455.00	15,466,500	
ＳＡＮＫＹＯ	17,500	2,884.00	50,470,000	
日本金銭機械	11,900	612.00	7,282,800	
マースグループホールディングス	5,600	1,724.00	9,654,400	
フクシマガリレイ	5,000	5,100.00	25,500,000	
竹内製作所	12,000	2,740.00	32,880,000	
アマノ	19,200	2,998.00	57,561,600	
ＪＵＫＩ	12,000	817.00	9,804,000	
蛇の目ミシン工業	8,300	749.00	6,216,700	
マックス	9,700	2,000.00	19,400,000	
グローリー	18,900	2,431.00	45,945,900	
新晃工業	6,800	2,300.00	15,640,000	
大和冷機工業	11,600	1,286.00	14,917,600	
セガサミーホールディングス	66,200	1,608.00	106,449,600	
リケン	4,300	2,955.00	12,706,500	
ＴＰＲ	9,900	1,533.00	15,176,700	
ツバキ・ナカシマ	14,200	1,583.00	22,478,600	
ホシザキ	21,200	10,780.00	228,536,000	
大豊工業	7,400	904.00	6,689,600	
日本精工	149,100	774.00	115,403,400	
ＮＴＮ	167,600	258.00	43,240,800	
ジェイテクト	68,700	988.00	67,875,600	
不二越	6,600	4,750.00	31,350,000	
日本トムソン	23,100	586.00	13,536,600	
ＴＨＫ	42,200	2,773.00	117,020,600	
ユーシン精機	7,100	852.00	6,049,200	
前澤給装工業	6,800	1,061.00	7,214,800	
イーグル工業	9,900	1,284.00	12,711,600	

日本ピラー工業	7,400	2,938.00	21,741,200	
キッツ	23,000	858.00	19,734,000	
マキタ	94,500	6,820.00	644,490,000	
日立造船	58,000	915.00	53,070,000	
三菱重工業	113,800	3,034.00	345,269,200	
ＩＨＩ	48,800	2,654.00	129,515,200	
スター精密	11,400	1,605.00	18,297,000	
日清紡ホールディングス	44,500	844.00	37,558,000	
イビデン	34,900	6,750.00	235,575,000	
コニカミノルタ	147,900	590.00	87,261,000	
ブラザー工業	88,300	2,528.00	223,222,400	
ミネベアミツミ	124,300	2,972.00	369,419,600	
日立製作所	348,700	6,567.00	2,289,912,900	
東芝	143,700	4,785.00	687,604,500	
三菱電機	725,000	1,564.50	1,134,262,500	
富士電機	43,700	5,290.00	231,173,000	
安川電機	77,900	5,900.00	459,610,000	
シンフォニアテクノロジー	10,300	1,255.00	12,926,500	
明電舎	12,500	2,589.00	32,362,500	
オリジン	4,300	1,309.00	5,628,700	
山洋電気	3,600	7,570.00	27,252,000	
デンヨー	6,600	2,248.00	14,836,800	
東芝テック	7,800	4,885.00	38,103,000	
芝浦メカトロニクス	1,500	7,750.00	11,625,000	
マブチモーター	17,100	4,010.00	68,571,000	
日本電産	174,600	13,255.00	2,314,323,000	
トレックス・セミコンダクター	4,800	2,783.00	13,358,400	
東光高岳	4,800	1,547.00	7,425,600	
ダイヘン	7,800	5,090.00	39,702,000	
ヤーマン	12,100	1,148.00	13,890,800	
ＪＶＣケンウッド	65,900	220.00	14,498,000	
ミマキエンジニアリング	11,200	952.00	10,662,400	
Ｉ－ＰＥＸ	4,300	2,081.00	8,948,300	
日新電機	17,000	1,460.00	24,820,000	
大崎電気工業	18,300	572.00	10,467,600	
オムロン	60,100	11,350.00	682,135,000	

日東工業	10,600	1,799.00	19,069,400	
ＩＤＥＣ	10,000	2,352.00	23,520,000	
正興電機製作所	3,000	1,517.00	4,551,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	26,300	2,699.00	70,983,700	
メルコホールディングス	2,700	5,330.00	14,391,000	
日本電気	92,100	6,200.00	571,020,000	
富士通	65,200	21,970.00	1,432,444,000	
沖電気工業	28,800	1,007.00	29,001,600	
電気興業	4,000	2,319.00	9,276,000	
サンケン電気	8,600	6,130.00	52,718,000	
アイホン	5,100	2,366.00	12,066,600	
ルネサスエレクトロニクス	393,100	1,370.00	538,547,000	
セイコーエプソン	90,100	2,315.00	208,581,500	
ワコム	53,100	749.00	39,771,900	
アルバック	13,400	6,630.00	88,842,000	
ＥＩＺＯ	6,200	4,405.00	27,311,000	
日本信号	17,700	973.00	17,222,100	
京三製作所	19,700	491.00	9,672,700	
能美防災	9,700	2,178.00	21,126,600	
ホーチキ	6,500	1,223.00	7,949,500	
エレコム	16,600	1,937.00	32,154,200	
パナソニック	773,400	1,436.50	1,110,989,100	
シャープ	96,700	1,464.00	141,568,800	
アンリツ	43,700	2,051.00	89,628,700	
富士通ゼネラル	22,400	2,999.00	67,177,600	
ソニーグループ	454,400	12,235.00	5,559,584,000	
ＴＤＫ	35,000	12,680.00	443,800,000	
帝国通信工業	6,400	1,600.00	10,240,000	
タムラ製作所	27,400	772.00	21,152,800	
アルプスアルパイン	59,700	1,261.00	75,281,700	
鈴木	4,600	891.00	4,098,600	
メイコー	6,000	3,305.00	19,830,000	
日本トリム	2,300	3,870.00	8,901,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,500	3,080.00	16,940,000	
フォスター電機	8,900	944.00	8,401,600	
ＳＭＫ	2,500	2,500.00	6,250,000	

ヨコオ	5,400	2,717.00	14,671,800	
ホシデン	19,500	964.00	18,798,000	
ヒロセ電機	11,200	19,440.00	217,728,000	
日本航空電子工業	16,900	1,740.00	29,406,000	
ＴＯＡ	10,800	880.00	9,504,000	
マクセルホールディングス	15,000	1,327.00	19,905,000	
古野電気	10,500	1,133.00	11,896,500	
ユニデンホールディングス	2,600	2,864.00	7,446,400	
スミダコーポレーション	7,500	1,345.00	10,087,500	
アイコム	3,500	2,507.00	8,774,500	
リオン	3,700	2,754.00	10,189,800	
横河電機	72,600	1,946.00	141,279,600	
新電元工業	2,900	4,375.00	12,687,500	
アズビル	49,100	5,110.00	250,901,000	
東亜ディーケーケー	6,200	900.00	5,580,000	
日本光電工業	30,200	3,925.00	118,535,000	
共和電業	16,200	393.00	6,366,600	
日本電子材料	3,500	2,051.00	7,178,500	
堀場製作所	13,400	8,210.00	110,014,000	
アドバンテスト	53,800	11,100.00	597,180,000	
エスペック	7,000	2,362.00	16,534,000	
キーエンス	71,200	74,000.00	5,268,800,000	
日置電機	3,600	9,500.00	34,200,000	
シスメックス	56,600	14,360.00	812,776,000	
日本マイクロニクス	13,100	1,571.00	20,580,100	
メガチップス	7,500	3,480.00	26,100,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,400	4,155.00	14,127,000	
コーセル	10,400	1,082.00	11,252,800	
イリソ電子工業	6,200	5,010.00	31,062,000	
オプテックスグループ	12,400	1,585.00	19,654,000	
千代田インテグレ	4,500	2,010.00	9,045,000	
レーザーテック	31,800	28,250.00	898,350,000	
スタンレー電気	50,600	2,920.00	147,752,000	
岩崎電気	4,100	2,069.00	8,482,900	
ウシオ電機	37,500	2,256.00	84,600,000	
日本セラミック	7,700	3,120.00	24,024,000	

古河電池	5,700	1,685.00	9,604,500	
山一電機	5,500	1,692.00	9,306,000	
図研	5,000	4,095.00	20,475,000	
日本電子	13,200	8,880.00	117,216,000	
カシオ計算機	58,600	1,885.00	110,461,000	
ファナック	63,700	26,305.00	1,675,628,500	
日本シイエムケイ	20,300	433.00	8,789,900	
エンプラス	3,700	3,400.00	12,580,000	
大真空	3,000	3,860.00	11,580,000	
ローム	30,100	11,490.00	345,849,000	
浜松ホトニクス	51,900	7,050.00	365,895,000	
三井ハイテック	7,100	7,080.00	50,268,000	
新光電気工業	24,000	4,115.00	98,760,000	
京セラ	110,500	7,317.00	808,528,500	
太陽誘電	32,200	7,250.00	233,450,000	
村田製作所	213,100	10,345.00	2,204,519,500	
双葉電子工業	14,200	819.00	11,629,800	
北陸電気工業	6,100	1,080.00	6,588,000	
ニチコン	23,100	1,153.00	26,634,300	
日本ケミコン	7,500	2,243.00	16,822,500	
ＫＯＡ	10,500	1,793.00	18,826,500	
市光工業	12,100	695.00	8,409,500	
小糸製作所	43,200	7,160.00	309,312,000	
ミツバ	14,900	685.00	10,206,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,600	10,770.00	135,702,000	
キヤノン電子	7,300	1,670.00	12,191,000	
キヤノン	360,600	2,708.50	976,685,100	
リコー	184,800	1,134.00	209,563,200	
象印マホービン	19,700	1,862.00	36,681,400	
東京エレクトロン	42,500	54,550.00	2,318,375,000	
トヨタ紡織	21,500	2,095.00	45,042,500	
ユニプレス	13,300	961.00	12,781,300	
豊田自動織機	58,500	9,750.00	570,375,000	
モリタホールディングス	12,400	1,671.00	20,720,400	
三櫻工業	10,900	1,141.00	12,436,900	
デンソー	159,800	7,983.00	1,275,683,400	

東海理化電機製作所	19,700	1,669.00	32,879,300	
川崎重工業	56,600	2,501.00	141,556,600	
日本車輌製造	3,800	2,165.00	8,227,000	
三菱ロジスネクスト	10,900	1,140.00	12,426,000	
日産自動車	856,600	571.60	489,632,560	
いすゞ自動車	192,800	1,499.00	289,007,200	
トヨタ自動車	734,900	9,959.00	7,318,869,100	
日野自動車	91,500	1,013.00	92,689,500	
三菱自動車工業	270,100	287.00	77,518,700	
武蔵精密工業	16,500	2,019.00	33,313,500	
日産車体	12,500	753.00	9,412,500	
新明和工業	21,000	967.00	20,307,000	
極東開発工業	12,800	1,760.00	22,528,000	
トピー工業	7,700	1,249.00	9,617,300	
タチエス	11,900	1,347.00	16,029,300	
ＮＯＫ	36,200	1,386.00	50,173,200	
フタバ産業	21,400	498.00	10,657,200	
ＫＹＢ	8,300	3,195.00	26,518,500	
大同メタル工業	21,000	617.00	12,957,000	
プレス工業	37,600	357.00	13,423,200	
太平洋工業	15,900	1,275.00	20,272,500	
河西工業	16,400	396.00	6,494,400	
アイシン	53,000	4,320.00	228,960,000	
マツダ	228,100	975.00	222,397,500	
今仙電機製作所	10,000	712.00	7,120,000	
本田技研工業	571,300	3,431.00	1,960,130,300	
スズキ	144,000	5,063.00	729,072,000	
ＳＵＢＡＲＵ	208,600	2,072.50	432,323,500	
安永	5,400	1,196.00	6,458,400	
ヤマハ発動機	95,500	3,080.00	294,140,000	
ＴＢＫ	16,700	421.00	7,030,700	
エクセディ	10,100	1,745.00	17,624,500	
豊田合成	23,700	2,360.00	55,932,000	
愛三工業	14,200	881.00	12,510,200	
ヨロズ	8,200	1,280.00	10,496,000	
エフ・シー・シー	12,100	1,593.00	19,275,300	

シマノ	29,200	34,480.00	1,006,816,000	
テイ・エス　テック	34,000	1,530.00	52,020,000	
ジャムコ	7,000	1,024.00	7,168,000	
テルモ	222,500	5,200.00	1,157,000,000	
日機装	23,000	957.00	22,011,000	
日本エム・ディ・エム	4,700	2,353.00	11,059,100	
島津製作所	93,200	5,400.00	503,280,000	
ＪＭＳ	8,100	850.00	6,885,000	
長野計器	6,500	1,192.00	7,748,000	
ブイ・テクノロジー	3,500	4,865.00	17,027,500	
東京計器	6,400	1,046.00	6,694,400	
インターアクション	4,000	2,871.00	11,484,000	
東京精密	12,200	5,150.00	62,830,000	
マニー	29,000	2,263.00	65,627,000	
ニコン	111,200	1,343.00	149,341,600	
トプコン	37,200	1,990.00	74,028,000	
オリンパス	380,000	2,422.50	920,550,000	
理研計器	6,300	3,025.00	19,057,500	
タムロン	5,800	2,719.00	15,770,200	
ＨＯＹＡ	141,600	18,495.00	2,618,892,000	
ノーリツ鋼機	6,700	2,740.00	18,358,000	
エー・アンド・デイ	7,000	1,116.00	7,812,000	
朝日インテック	78,100	3,340.00	260,854,000	
シチズン時計	90,800	516.00	46,852,800	
メニコン	11,200	9,220.00	103,264,000	
松風	4,200	2,108.00	8,853,600	
セイコーホールディングス	10,100	2,278.00	23,007,800	
ニプロ	55,000	1,200.00	66,000,000	
スノーピーク	4,500	6,040.00	27,180,000	
パラマウントベッドホールディングス	13,900	2,191.00	30,454,900	
トランザクション	5,100	1,204.00	6,140,400	
ニホンフラッシュ	7,200	1,299.00	9,352,800	
前田工繊	7,900	3,520.00	27,808,000	
永大産業	17,900	310.00	5,549,000	
アートネイチャー	10,600	740.00	7,844,000	
バンダイナムコホールディングス	60,100	8,502.00	510,970,200	

ＳＨＯＥＩ	6,800	5,120.00	34,816,000	
フランスベッドホールディングス	11,900	959.00	11,412,100	
パイロットコーポレーション	12,400	4,450.00	55,180,000	
萩原工業	5,400	1,578.00	8,521,200	
トッパン・フォームズ	13,100	1,050.00	13,755,000	
フジシールインターナショナル	15,000	2,639.00	39,585,000	
タカラトミー	32,600	1,182.00	38,533,200	
廣済堂	6,800	1,301.00	8,846,800	
プロネクサス	8,200	1,097.00	8,995,400	
大建工業	5,500	2,422.00	13,321,000	
凸版印刷	109,600	2,025.00	221,940,000	
大日本印刷	85,500	2,738.00	234,099,000	
共同印刷	3,100	2,812.00	8,717,200	
ＮＩＳＳＨＡ	15,300	1,892.00	28,947,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,700	1,815.00	8,530,500	
アシックス	64,400	2,691.00	173,300,400	
ローランド	5,700	5,590.00	31,863,000	
ヤマハ	43,100	7,250.00	312,475,000	
河合楽器製作所	2,600	4,220.00	10,972,000	
ピジョン	43,900	3,270.00	143,553,000	
キングジム	8,400	898.00	7,543,200	
リンテック	15,800	2,638.00	41,680,400	
イトーキ	19,700	362.00	7,131,400	
任天堂	41,500	55,270.00	2,293,705,000	
三菱鉛筆	12,200	1,511.00	18,434,200	
タカラスタンダード	14,600	1,681.00	24,542,600	
コクヨ	35,100	1,961.00	68,831,100	
ナカバヤシ	11,400	608.00	6,931,200	
グローブライド	3,600	8,760.00	31,536,000	
オカムラ	24,900	1,741.00	43,350,900	
美津濃	7,200	2,633.00	18,957,600	
東京電力ホールディングス	614,100	302.00	185,458,200	
中部電力	221,600	1,360.00	301,376,000	
関西電力	275,100	1,129.00	310,587,900	
中国電力	102,800	1,049.00	107,837,200	
北陸電力	68,200	601.00	40,988,200	

東北電力	166,600	866.00	144,275,600	
四国電力	60,600	824.00	49,934,400	
九州電力	157,900	876.00	138,320,400	
北海道電力	69,900	550.00	38,445,000	
沖縄電力	13,800	1,477.00	20,382,600	
電源開発	57,500	1,682.00	96,715,000	
エフオン	5,800	969.00	5,620,200	
イーレックス	10,900	2,832.00	30,868,800	
レノバ	12,400	6,110.00	75,764,000	
東京瓦斯	139,500	2,168.50	302,505,750	
大阪瓦斯	130,200	2,155.00	280,581,000	
東邦瓦斯	35,600	5,380.00	191,528,000	
北海道瓦斯	5,900	1,598.00	9,428,200	
広島ガス	22,700	390.00	8,853,000	
西部ガスホールディングス	8,300	2,526.00	20,965,800	
静岡ガス	20,300	1,340.00	27,202,000	
メタウォーター	8,300	1,968.00	16,334,400	
ＳＢＳホールディングス	5,300	4,090.00	21,677,000	
東武鉄道	74,700	2,908.00	217,227,600	
相鉄ホールディングス	25,100	2,188.00	54,918,800	
東急	181,500	1,513.00	274,609,500	
京浜急行電鉄	92,800	1,321.00	122,588,800	
小田急電鉄	115,700	2,548.00	294,803,600	
京王電鉄	40,400	5,920.00	239,168,000	
京成電鉄	54,200	3,480.00	188,616,000	
富士急行	10,000	4,535.00	45,350,000	
新京成電鉄	3,600	2,149.00	7,736,400	
東日本旅客鉄道	127,700	7,094.00	905,903,800	
西日本旅客鉄道	64,900	5,202.00	337,609,800	
東海旅客鉄道	60,300	16,000.00	964,800,000	
西武ホールディングス	87,700	1,355.00	118,833,500	
鴻池運輸	11,500	1,373.00	15,789,500	
西日本鉄道	20,200	2,819.00	56,943,800	
ハマキョウレックス	5,600	3,420.00	19,152,000	
サカイ引越センター	3,300	4,915.00	16,219,500	
近鉄グループホールディングス	68,500	3,665.00	251,052,500	

阪急阪神ホールディングス	91,400	3,490.00	318,986,000	
南海電気鉄道	33,000	2,363.00	77,979,000	
京阪ホールディングス	30,500	3,140.00	95,770,000	
神戸電鉄	2,900	3,635.00	10,541,500	
名古屋鉄道	56,300	1,975.00	111,192,500	
山陽電気鉄道	6,600	2,038.00	13,450,800	
日本通運	23,600	7,970.00	188,092,000	
ヤマトホールディングス	96,300	2,893.00	278,595,900	
山九	17,400	5,380.00	93,612,000	
丸全昭和運輸	5,800	3,530.00	20,474,000	
センコーグループホールディングス	37,000	1,034.00	38,258,000	
トナミホールディングス	1,900	5,140.00	9,766,000	
ニッコンホールディングス	23,300	2,430.00	56,619,000	
福山通運	8,700	4,900.00	42,630,000	
セイノーホールディングス	51,100	1,428.00	72,970,800	
神奈川中央交通	2,500	3,580.00	8,950,000	
日立物流	15,100	4,750.00	71,725,000	
丸和運輸機関	14,600	1,656.00	24,177,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,700	1,888.00	14,537,600	
九州旅客鉄道	53,300	2,513.00	133,942,900	
ＳＧホールディングス	129,800	3,050.00	395,890,000	
日本郵船	57,100	9,880.00	564,148,000	
商船三井	40,600	9,030.00	366,618,000	
川崎汽船	21,200	6,190.00	131,228,000	
ＮＳユナイテッド海運	4,400	3,765.00	16,566,000	
飯野海運	35,000	537.00	18,795,000	
乾汽船	6,600	2,410.00	15,906,000	
日本航空	167,200	2,416.00	403,955,200	
ＡＮＡホールディングス	186,400	2,631.00	490,418,400	
トランコム	2,200	8,850.00	19,470,000	
日新	6,700	1,638.00	10,974,600	
三菱倉庫	23,900	3,360.00	80,304,000	
三井倉庫ホールディングス	7,500	2,784.00	20,880,000	
住友倉庫	24,600	1,948.00	47,920,800	
澁澤倉庫	4,800	2,387.00	11,457,600	
東陽倉庫	20,900	351.00	7,335,900	

日本トランスシティ	19,000	664.00	12,616,000	
川西倉庫	4,000	1,200.00	4,800,000	
安田倉庫	7,600	1,008.00	7,660,800	
東洋埠頭	5,100	1,557.00	7,940,700	
上組	38,000	2,413.00	91,694,000	
近鉄エクスプレス	13,500	2,790.00	37,665,000	
エーアイテイー	6,800	1,124.00	7,643,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	22,400	2,210.00	49,504,000	
システナ	25,000	2,468.00	61,700,000	
デジタルアーツ	4,200	9,400.00	39,480,000	
日鉄ソリューションズ	10,000	3,990.00	39,900,000	
キューブシステム	5,100	1,152.00	5,875,200	
コア	4,500	1,579.00	7,105,500	
ラクーンホールディングス	5,900	1,651.00	9,740,900	
ソリトンシステムズ	4,300	1,572.00	6,759,600	
ソフトクリエイトホールディングス	3,300	3,385.00	11,170,500	
ＴＩＳ	70,800	3,235.00	229,038,000	
グリー	44,100	688.00	30,340,800	
GMOペパボ	900	3,495.00	3,145,500	
コーエーテクモホールディングス	18,900	5,650.00	106,785,000	
三菱総合研究所	3,100	4,565.00	14,151,500	
ファインデックス	7,800	1,053.00	8,213,400	
ブレインパッド	2,100	6,310.00	13,251,000	
ＫＬａｂ	14,300	656.00	9,380,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,500	1,051.00	11,035,500	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	3,895.00	5,842,500	
ネクソン	160,500	2,059.00	330,469,500	
アイスタイル	24,300	439.00	10,667,700	
エムアップホールディングス	2,200	3,330.00	7,326,000	
エイチーム	6,600	1,515.00	9,999,000	
エニグモ	7,500	1,539.00	11,542,500	
テクノスジャパン	8,900	638.00	5,678,200	
コロプラ	23,700	867.00	20,547,900	
ブロードリーフ	36,500	535.00	19,527,500	
デジタルハーツホールディングス	4,600	2,175.00	10,005,000	

システム情報	6,600	1,055.00	6,963,000	
メディアドゥ	2,900	5,640.00	16,356,000	
じげん	22,000	458.00	10,076,000	
ブイキューブ	7,400	1,792.00	13,260,800	
サイバーリンクス	3,100	1,618.00	5,015,800	
フィックスターズ	9,500	814.00	7,733,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	2,472.00	9,888,000	
オプティム	5,600	2,124.00	11,894,400	
セレス	2,600	3,070.00	7,982,000	
ＳＨＩＦＴ	3,600	26,430.00	95,148,000	
ティーガイア	7,100	2,034.00	14,441,400	
テクマトリックス	11,400	2,057.00	23,449,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	20,600	2,243.00	46,205,800	
GMOペイメントゲートウェイ	13,800	16,160.00	223,008,000	
システムリサーチ	3,000	2,111.00	6,333,000	
インターネットイニシアティブ	18,900	4,245.00	80,230,500	
さくらインターネット	10,300	650.00	6,695,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,800	5,370.00	9,666,000	
ＳＲＡホールディングス	4,700	2,929.00	13,766,300	
朝日ネット	7,900	755.00	5,964,500	
ｅＢＡＳＥ	9,600	843.00	8,092,800	
アバント	8,000	1,563.00	12,504,000	
アドソル日進	3,400	2,310.00	7,854,000	
フリービット	6,400	881.00	5,638,400	
コムチュア	6,500	3,085.00	20,052,500	
アステリア	7,200	738.00	5,313,600	
アイル	4,700	1,995.00	9,376,500	
マークラインズ	3,700	3,080.00	11,396,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,500	1,714.00	14,569,000	
ｇｕｍｉ	11,200	951.00	10,651,200	
テラスカイ	2,800	2,270.00	6,356,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,400	2,125.00	9,350,000	
ＰＣＩホールディングス	4,600	1,145.00	5,267,000	
ネオジャパン	2,200	1,588.00	3,493,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,800	3,260.00	5,868,000	
ラクス	21,400	4,510.00	96,514,000	

ダブルスタンダード	1,400	8,750.00	12,250,000	
オープンドア	4,900	2,429.00	11,902,100	
アカツキ	3,100	3,375.00	10,462,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	3,110.00	7,153,000	
カナミックネットワーク	10,000	635.00	6,350,000	
チェンジ	13,100	2,462.00	32,252,200	
オークネット	5,300	2,132.00	11,299,600	
エイトレッド	2,000	2,599.00	5,198,000	
マクロミル	16,700	810.00	13,527,000	
オロ	2,600	4,085.00	10,621,000	
ユーザーローカル	3,000	2,029.00	6,087,000	
マネーフォワード	10,000	8,550.00	85,500,000	
電算システムホールディングス	3,400	2,862.00	9,730,800	
プロトコーポレーション	9,400	1,640.00	15,416,000	
野村総合研究所	123,400	4,450.00	549,130,000	
サイバネットシステム	7,600	709.00	5,388,400	
インテージホールディングス	9,500	1,666.00	15,827,000	
ソースネクスト	38,400	240.00	9,216,000	
インフォコム	6,500	2,581.00	16,776,500	
ＨＥＲＯＺ	2,300	2,043.00	4,698,900	
ラクスル	8,000	6,130.00	49,040,000	
ＩＰＳ	2,200	2,230.00	4,906,000	
イーソル	5,100	1,025.00	5,227,500	
アルテリア・ネットワークス	8,400	1,827.00	15,346,800	
ＥｄｕＬａｂ	900	3,030.00	2,727,000	
ウイングアーク１ｓｔ	4,200	2,399.00	10,075,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	2,000	1,933.00	3,866,000	
Ｓａｎｓａｎ	6,400	12,190.00	78,016,000	
ギフティ	6,700	3,845.00	25,761,500	
ベース	1,000	5,070.00	5,070,000	
フォーカスシステムズ	6,200	1,076.00	6,671,200	
クレスコ	6,200	2,100.00	13,020,000	
フジ・メディア・ホールディングス	72,600	1,222.00	88,717,200	
オービック	22,400	23,620.00	529,088,000	
ジャストシステム	10,000	7,220.00	72,200,000	
ＴＤＣソフト	7,700	1,459.00	11,234,300	

Ｚホールディングス	979,200	706.10	691,413,120	
トレンドマイクロ	38,000	6,300.00	239,400,000	
ＩＤホールディングス	5,700	974.00	5,551,800	
日本オラクル	14,500	9,850.00	142,825,000	
アルファシステムズ	2,200	4,100.00	9,020,000	
フューチャー	8,800	2,784.00	24,499,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,100	1,736.00	10,589,600	
ＳＢテクノロジー	2,900	3,105.00	9,004,500	
オービックビジネスコンサルタント	6,700	5,780.00	38,726,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	32,100	3,645.00	117,004,500	
アイティフォー	11,200	888.00	9,945,600	
大塚商会	38,300	6,130.00	234,779,000	
サイボウズ	9,400	2,550.00	23,970,000	
電通国際情報サービス	10,700	4,630.00	49,541,000	
ＡＣＣＥＳＳ	10,900	1,132.00	12,338,800	
デジタルガレージ	11,900	5,350.00	63,665,000	
ＥＭシステムズ	13,400	839.00	11,242,600	
ウェザーニューズ	2,500	6,540.00	16,350,000	
ＣＩＪ	6,500	881.00	5,726,500	
WOWOW	3,500	2,523.00	8,830,500	
スカラ	8,600	763.00	6,561,800	
ネットワンシステムズ	29,100	3,900.00	113,490,000	
アルゴグラフィックス	5,500	3,560.00	19,580,000	
マーベラス	13,000	710.00	9,230,000	
エイベックス	12,600	1,537.00	19,366,200	
日本ユニシス	24,700	3,095.00	76,446,500	
兼松エレクトロニクス	3,700	4,090.00	15,133,000	
都築電気	3,800	1,875.00	7,125,000	
ＴＢＳホールディングス	46,900	1,697.00	79,589,300	
日本テレビホールディングス	58,600	1,256.00	73,601,600	
朝日放送グループホールディングス	10,300	744.00	7,663,200	
テレビ朝日ホールディングス	21,900	1,780.00	38,982,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	47,900	443.00	21,219,700	
テレビ東京ホールディングス	5,300	2,185.00	11,580,500	
ビジョン	10,100	1,423.00	14,372,300	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	3,570.00	25,347,000	

コネクシオ	4,500	1,613.00	7,258,500	
日本電信電話	832,000	3,279.00	2,728,128,000	
ＫＤＤＩ	570,700	3,728.00	2,127,569,600	
ソフトバンク	646,700	1,602.00	1,036,013,400	
光通信	8,400	20,980.00	176,232,000	
エムティーアイ	9,500	742.00	7,049,000	
ＧＭＯインターネット	25,500	3,100.00	79,050,000	
ファイバーゲート	3,400	1,593.00	5,416,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	18,400	5,700.00	104,880,000	
学研ホールディングス	9,800	1,254.00	12,289,200	
ゼンリン	13,900	1,101.00	15,303,900	
アイネット	5,100	1,440.00	7,344,000	
松竹	4,800	12,880.00	61,824,000	
東宝	41,900	5,200.00	217,880,000	
東映	2,300	22,320.00	51,336,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	188,400	2,211.00	416,552,400	
ピー・シー・エー	1,400	5,970.00	8,358,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,200	1,757.00	5,622,400	
ＤＴＳ	14,700	2,776.00	40,807,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,400	6,810.00	207,024,000	
シーイーシー	8,500	1,428.00	12,138,000	
カプコン	61,000	3,440.00	209,840,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,298.00	5,451,600	
ジャステック	5,800	1,261.00	7,313,800	
ＳＣＳＫ	16,400	7,580.00	124,312,000	
日本システムウエア	3,000	2,522.00	7,566,000	
アイネス	8,500	1,625.00	13,812,500	
ＴＫＣ	11,600	3,840.00	44,544,000	
富士ソフト	7,400	5,790.00	42,846,000	
ＮＳＤ	22,400	2,154.00	48,249,600	
コナミホールディングス	25,800	7,210.00	186,018,000	
福井コンピュータホールディングス	3,600	4,480.00	16,128,000	
ＪＢＣＣホールディングス	6,000	1,600.00	9,600,000	
ミロク情報サービス	8,200	1,695.00	13,899,000	
ソフトバンクグループ	564,700	7,179.00	4,053,981,300	
伊藤忠食品	2,000	5,440.00	10,880,000	

エレマテック	7,500	1,222.00	9,165,000	
あらた	5,600	4,580.00	25,648,000	
東京エレクトロン　デバイス	2,600	7,830.00	20,358,000	
フィールズ	10,500	523.00	5,491,500	
双日	390,800	353.00	137,952,400	
アルフレッサ　ホールディングス	74,000	1,783.00	131,942,000	
横浜冷凍	19,700	920.00	18,124,000	
アルコニックス	8,400	1,731.00	14,540,400	
神戸物産	55,200	4,605.00	254,196,000	
あい　ホールディングス	10,800	2,436.00	26,308,800	
ダイワボウホールディングス	32,100	2,099.00	67,377,900	
マクニカ・富士エレホールディングス	16,800	2,864.00	48,115,200	
ラクト・ジャパン	3,500	2,868.00	10,038,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,900	817.00	12,173,300	
八洲電機	7,200	1,040.00	7,488,000	
レスターホールディングス	7,700	1,995.00	15,361,500	
ジューテックホールディングス	3,500	1,119.00	3,916,500	
ＴＯＫＡＩホールディングス	33,100	937.00	31,014,700	
三洋貿易	8,900	1,232.00	10,964,800	
ビューティガレージ	1,400	4,245.00	5,943,000	
ウイン・パートナーズ	6,200	995.00	6,169,000	
シップヘルスケアホールディングス	25,500	2,925.00	74,587,500	
コメダホールディングス	16,100	2,142.00	34,486,200	
アセンテック	3,400	1,344.00	4,569,600	
小野建	7,600	1,691.00	12,851,600	
佐鳥電機	7,800	904.00	7,051,200	
伯東	5,700	1,936.00	11,035,200	
コンドーテック	7,600	1,054.00	8,010,400	
ナガイレーベン	9,700	2,740.00	26,578,000	
三菱食品	7,300	3,045.00	22,228,500	
松田産業	5,900	3,100.00	18,290,000	
第一興商	14,000	3,870.00	54,180,000	
メディパルホールディングス	71,200	2,204.00	156,924,800	
ＳＰＫ	4,600	1,403.00	6,453,800	
萩原電気ホールディングス	3,400	2,359.00	8,020,600	
アズワン	5,200	17,510.00	91,052,000	

尾家産業	4,700	1,127.00	5,296,900	
シモジマ	6,300	1,191.00	7,503,300	
ドウシシャ	7,400	1,798.00	13,305,200	
高速	5,200	1,642.00	8,538,400	
丸文	10,900	817.00	8,905,300	
ハピネット	7,100	1,508.00	10,706,800	
日本ライフライン	23,100	1,405.00	32,455,500	
タカショー	8,800	1,024.00	9,011,200	
マルカ	3,600	2,951.00	10,623,600	
ＩＤＯＭ	25,700	1,009.00	25,931,300	
進和	5,300	2,396.00	12,698,800	
ダイトロン	4,100	2,415.00	9,901,500	
シークス	9,800	1,310.00	12,838,000	
オーハシテクニカ	5,300	1,534.00	8,130,200	
伊藤忠商事	499,100	3,523.00	1,758,329,300	
丸紅	703,600	935.70	658,358,520	
長瀬産業	38,800	1,969.00	76,397,200	
蝶理	5,600	1,964.00	10,998,400	
豊田通商	71,300	4,980.00	355,074,000	
三共生興	16,400	550.00	9,020,000	
兼松	27,600	1,481.00	40,875,600	
三井物産	569,500	2,558.50	1,457,065,750	
日本紙パルプ商事	3,900	3,900.00	15,210,000	
カメイ	9,700	1,269.00	12,309,300	
スターゼン	5,900	2,321.00	13,693,900	
山善	26,200	1,166.00	30,549,200	
椿本興業	1,800	3,900.00	7,020,000	
住友商事	450,200	1,629.00	733,375,800	
内田洋行	3,100	5,350.00	16,585,000	
三菱商事	434,500	3,585.00	1,557,682,500	
第一実業	3,400	4,890.00	16,626,000	
キヤノンマーケティングジャパン	17,900	2,635.00	47,166,500	
西華産業	5,600	1,719.00	9,626,400	
佐藤商事	7,900	1,246.00	9,843,400	
菱洋エレクトロ	5,500	2,419.00	13,304,500	
東京産業	10,100	774.00	7,817,400	

ユアサ商事	7,100	3,130.00	22,223,000	
阪和興業	14,100	3,700.00	52,170,000	
正栄食品工業	4,600	4,350.00	20,010,000	
カナデン	7,700	1,068.00	8,223,600	
菱電商事	6,400	1,866.00	11,942,400	
フルサト工業	5,000	2,295.00	11,475,000	
岩谷産業	17,300	6,630.00	114,699,000	
極東貿易	3,200	2,654.00	8,492,800	
アステナホールディングス	11,800	637.00	7,516,600	
三愛石油	17,600	1,466.00	25,801,600	
稲畑産業	16,400	1,826.00	29,946,400	
ＧＳＩクレオス	5,200	1,051.00	5,465,200	
ヤマエ久野	6,800	1,203.00	8,180,400	
ワキタ	14,400	1,062.00	15,292,800	
東邦ホールディングス	23,200	1,902.00	44,126,400	
サンゲツ	20,400	1,652.00	33,700,800	
ミツウロコグループホールディングス	10,600	1,420.00	15,052,000	
シナネンホールディングス	3,300	3,720.00	12,276,000	
伊藤忠エネクス	15,400	1,028.00	15,831,200	
サンリオ	20,600	2,408.00	49,604,800	
サンワテクノス	6,000	1,497.00	8,982,000	
リョーサン	8,200	2,375.00	19,475,000	
新光商事	12,800	856.00	10,956,800	
トーホー	4,900	1,687.00	8,266,300	
三信電気	4,800	1,733.00	8,318,400	
東陽テクニカ	9,200	1,274.00	11,720,800	
モスフードサービス	10,200	3,370.00	34,374,000	
加賀電子	6,700	3,165.00	21,205,500	
ソーダニッカ	12,000	610.00	7,320,000	
立花エレテック	6,100	1,586.00	9,674,600	
ＰＡＬＴＡＣ	11,500	4,920.00	56,580,000	
三谷産業	14,500	389.00	5,640,500	
太平洋興発	7,700	665.00	5,120,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,300	3,940.00	9,062,000	
国際紙パルプ商事	24,700	371.00	9,163,700	
ヤマタネ	4,700	1,694.00	7,961,800	

日鉄物産	4,900	5,460.00	26,754,000	
泉州電業	2,500	4,850.00	12,125,000	
トラスコ中山	15,000	2,985.00	44,775,000	
オートバックスセブン	26,400	1,567.00	41,368,800	
モリト	10,400	690.00	7,176,000	
加藤産業	9,700	3,495.00	33,901,500	
イノテック	5,500	1,485.00	8,167,500	
イエローハット	13,300	2,004.00	26,653,200	
ＪＫホールディングス	8,100	848.00	6,868,800	
日伝	6,100	2,522.00	15,384,200	
杉本商事	4,300	2,927.00	12,586,100	
因幡電機産業	18,100	2,866.00	51,874,600	
東テク	2,900	2,800.00	8,120,000	
ミスミグループ本社	89,600	4,795.00	429,632,000	
タキヒヨー	4,100	1,937.00	7,941,700	
スズケン	30,300	3,295.00	99,838,500	
ジェコス	7,100	918.00	6,517,800	
ローソン	18,200	5,730.00	104,286,000	
サンエー	4,900	4,190.00	20,531,000	
カワチ薬品	5,200	2,374.00	12,344,800	
エービーシー・マート	11,100	5,950.00	66,045,000	
アスクル	11,900	1,757.00	20,908,300	
ゲオホールディングス	9,900	1,225.00	12,127,500	
アダストリア	10,200	1,950.00	19,890,000	
くら寿司	8,600	4,220.00	36,292,000	
キャンドゥ	4,900	1,959.00	9,599,100	
パルグループホールディングス	7,300	1,715.00	12,519,500	
エディオン	28,400	1,091.00	30,984,400	
サーラコーポレーション	16,300	635.00	10,350,500	
ハローズ	3,100	3,100.00	9,610,000	
フジオフードグループ本社	7,900	1,397.00	11,036,300	
あみやき亭	2,700	2,928.00	7,905,600	
大黒天物産	2,300	7,060.00	16,238,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,148.00	7,806,400	
アルペン	5,800	3,390.00	19,662,000	
クオールホールディングス	10,700	1,656.00	17,719,200	

ジンズホールディングス	5,000	7,870.00	39,350,000	
ビックカメラ	41,700	1,084.00	45,202,800	
ＤＣＭホールディングス	43,200	1,115.00	48,168,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	89,900	2,628.00	236,257,200	
アークランドサービスホールディングス	6,500	2,360.00	15,340,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	85,700	998.00	85,528,600	
ドトール・日レスホールディングス	11,400	1,696.00	19,334,400	
マツモトキヨシホールディングス	29,700	5,440.00	161,568,000	
ブロンコビリー	5,000	2,531.00	12,655,000	
ＺＯＺＯ	42,500	4,190.00	178,075,000	
物語コーポレーション	4,000	7,350.00	29,400,000	
ココカラファイン	6,200	9,260.00	57,412,000	
三越伊勢丹ホールディングス	124,300	773.00	96,083,900	
Ｈａｍｅｅ	2,900	1,652.00	4,790,800	
ウエルシアホールディングス	37,800	4,110.00	155,358,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,200	3,920.00	39,984,000	
シュッピン	6,800	1,232.00	8,377,600	
オイシックス・ラ・大地	9,500	4,100.00	38,950,000	
ネクステージ	12,700	2,244.00	28,498,800	
ジョイフル本田	19,800	1,530.00	30,294,000	
ホットランド	7,000	1,350.00	9,450,000	
すかいらーくホールディングス	91,400	1,590.00	145,326,000	
ＳＦＰホールディングス	5,300	1,501.00	7,955,300	
綿半ホールディングス	6,700	1,301.00	8,716,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19,700	1,161.00	22,871,700	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,443.00	8,369,400	
ＢＥＥＮＯＳ	3,900	3,195.00	12,460,500	
あさひ	5,600	1,436.00	8,041,600	
日本調剤	5,500	1,776.00	9,768,000	
コスモス薬品	7,200	19,980.00	143,856,000	
セブン&アイ・ホールディングス	279,500	5,182.00	1,448,369,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	39,300	915.00	35,959,500	
ツルハホールディングス	15,600	14,210.00	221,676,000	
サンマルクホールディングス	7,300	1,595.00	11,643,500	
トリドールホールディングス	18,100	2,524.00	45,684,400	

ＪＭホールディングス	6,100	2,354.00	14,359,400	
アレンザホールディングス	6,400	1,430.00	9,152,000	
バロックジャパンリミテッド	8,000	874.00	6,992,000	
クスリのアオキホールディングス	7,200	8,350.00	60,120,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	41,900	5,240.00	219,556,000	
メディカルシステムネットワーク	8,300	787.00	6,532,100	
ノジマ	12,700	2,944.00	37,388,800	
カッパ・クリエイト	11,300	1,411.00	15,944,300	
良品計画	82,500	2,540.00	209,550,000	
アドヴァングループ	9,400	959.00	9,014,600	
アルビス	3,100	2,484.00	7,700,400	
コナカ	18,700	372.00	6,956,400	
Ｇ－７ホールディングス	3,900	4,420.00	17,238,000	
イオン北海道	11,100	1,294.00	14,363,400	
コジマ	14,000	690.00	9,660,000	
コーナン商事	10,200	3,845.00	39,219,000	
エコス	3,400	2,030.00	6,902,000	
ワタミ	11,400	1,021.00	11,639,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	142,800	2,140.00	305,592,000	
西松屋チェーン	15,900	1,458.00	23,182,200	
ゼンショーホールディングス	38,600	2,846.00	109,855,600	
幸楽苑ホールディングス	6,200	1,500.00	9,300,000	
サイゼリヤ	10,800	2,764.00	29,851,200	
ＶＴホールディングス	29,100	580.00	16,878,000	
フジ・コーポレーション	6,000	1,219.00	7,314,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	1,898.00	16,702,400	
ハイデイ日高	10,300	1,727.00	17,788,100	
コロワイド	24,400	1,745.00	42,578,000	
ピーシーデポコーポレーション	11,700	475.00	5,557,500	
壱番屋	5,100	4,890.00	24,939,000	
スギホールディングス	14,300	8,850.00	126,555,000	
薬王堂ホールディングス	3,500	2,594.00	9,079,000	
スクロール	11,400	915.00	10,431,000	
ヨンドシーホールディングス	7,200	1,849.00	13,312,800	
木曽路	9,700	2,432.00	23,590,400	
ＳＲＳホールディングス	13,400	842.00	11,282,800	

千趣会	19,800	398.00	7,880,400	
リテールパートナーズ	9,500	1,303.00	12,378,500	
ケーヨー	16,300	858.00	13,985,400	
上新電機	8,000	2,586.00	20,688,000	
日本瓦斯	34,900	1,687.00	58,876,300	
ロイヤルホールディングス	12,600	2,092.00	26,359,200	
いなげや	8,200	1,500.00	12,300,000	
チヨダ	11,100	819.00	9,090,900	
ライフコーポレーション	6,700	4,800.00	32,160,000	
リンガーハット	9,400	2,322.00	21,826,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	11,600	680.00	7,888,000	
ＡＯＫＩホールディングス	17,400	667.00	11,605,800	
オークワ	11,600	1,230.00	14,268,000	
コメリ	10,900	2,704.00	29,473,600	
青山商事	18,100	735.00	13,303,500	
しまむら	8,300	9,990.00	82,917,000	
高島屋	52,300	1,144.00	59,831,200	
松屋	17,400	1,030.00	17,922,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	33,600	936.00	31,449,600	
近鉄百貨店	3,200	2,588.00	8,281,600	
丸井グループ	60,700	2,085.00	126,559,500	
アクシアル　リテイリング	5,900	4,205.00	24,809,500	
イオン	274,700	3,137.00	861,733,900	
イズミ	14,700	3,670.00	53,949,000	
平和堂	12,600	2,349.00	29,597,400	
フジ	8,700	2,259.00	19,653,300	
ヤオコー	8,200	7,380.00	60,516,000	
ゼビオホールディングス	10,400	1,127.00	11,720,800	
ケーズホールディングス	60,500	1,227.00	74,233,500	
日産東京販売ホールディングス	20,900	249.00	5,204,100	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,600	5,270.00	18,972,000	
ブックオフグループホールディングス	6,100	988.00	6,026,800	
アインホールディングス	10,500	7,430.00	78,015,000	
元気寿司	2,900	2,761.00	8,006,900	
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	1,679.00	19,140,600	

ニトリホールディングス	28,400	22,500.00	639,000,000	
グルメ杵屋	6,900	1,015.00	7,003,500	
吉野家ホールディングス	23,800	2,162.00	51,455,600	
松屋フーズホールディングス	3,700	3,660.00	13,542,000	
サガミホールディングス	12,900	1,046.00	13,493,400	
関西スーパーマーケット	6,600	2,160.00	14,256,000	
王将フードサービス	4,600	6,140.00	28,244,000	
プレナス	8,300	2,118.00	17,579,400	
ミニストップ	6,900	1,560.00	10,764,000	
アークス	13,200	2,404.00	31,732,800	
バローホールディングス	14,000	2,560.00	35,840,000	
ベルク	3,600	6,250.00	22,500,000	
ファーストリテイリング	9,500	75,880.00	720,860,000	
サンドラッグ	26,900	3,765.00	101,278,500	
ベルーナ	15,800	872.00	13,777,600	
じもとホールディングス	7,000	739.00	5,173,000	
めぶきフィナンシャルグループ	366,400	257.00	94,164,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,500	1,650.00	15,675,000	
九州フィナンシャルグループ	141,200	429.00	60,574,800	
ゆうちょ銀行	201,100	969.00	194,865,900	
富山第一銀行	22,100	308.00	6,806,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	433,000	450.00	194,850,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	47,600	734.00	34,938,400	
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,495.00	10,016,500	
第四北越フィナンシャルグループ	11,600	2,720.00	31,552,000	
ひろぎんホールディングス	106,500	649.00	69,118,500	
新生銀行	58,100	1,740.00	101,094,000	
あおぞら銀行	42,200	2,754.00	116,218,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,895,700	632.30	3,095,551,110	
りそなホールディングス	823,100	445.70	366,855,670	
三井住友トラスト・ホールディングス	135,100	3,795.00	512,704,500	
三井住友フィナンシャルグループ	495,200	3,984.00	1,972,876,800	
千葉銀行	235,900	715.00	168,668,500	
群馬銀行	145,100	363.00	52,671,300	
武蔵野銀行	11,000	1,847.00	20,317,000	
千葉興業銀行	23,000	293.00	6,739,000	

筑波銀行	39,400	185.00	7,289,000	
七十七銀行	22,400	1,299.00	29,097,600	
青森銀行	5,600	2,210.00	12,376,000	
秋田銀行	4,300	1,496.00	6,432,800	
山形銀行	9,700	886.00	8,594,200	
岩手銀行	5,500	1,774.00	9,757,000	
東邦銀行	67,000	220.00	14,740,000	
東北銀行	4,000	1,057.00	4,228,000	
みちのく銀行	4,500	897.00	4,036,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,800	2,112.00	134,745,600	
静岡銀行	173,100	918.00	158,905,800	
十六銀行	8,900	2,291.00	20,389,900	
スルガ銀行	64,200	401.00	25,744,200	
八十二銀行	153,900	397.00	61,098,300	
山梨中央銀行	9,000	855.00	7,695,000	
大垣共立銀行	14,200	1,974.00	28,030,800	
福井銀行	6,200	1,654.00	10,254,800	
北國銀行	7,000	2,214.00	15,498,000	
清水銀行	3,900	1,650.00	6,435,000	
富山銀行	1,500	2,160.00	3,240,000	
滋賀銀行	14,200	1,945.00	27,619,000	
南都銀行	10,500	2,061.00	21,640,500	
百五銀行	66,300	333.00	22,077,900	
京都銀行	25,400	5,240.00	133,096,000	
紀陽銀行	25,100	1,611.00	40,436,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	47,500	877.00	41,657,500	
山陰合同銀行	46,400	573.00	26,587,200	
中国銀行	60,000	910.00	54,600,000	
伊予銀行	91,500	604.00	55,266,000	
百十四銀行	8,600	1,591.00	13,682,600	
四国銀行	12,000	752.00	9,024,000	
阿波銀行	11,000	2,251.00	24,761,000	
大分銀行	4,500	1,835.00	8,257,500	
宮崎銀行	4,700	2,143.00	10,072,100	
佐賀銀行	4,500	1,485.00	6,682,500	
沖縄銀行	7,100	2,849.00	20,227,900	

琉球銀行	17,700	816.00	14,443,200	
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	972,600	1,616.00	1,571,721,600	
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	2,800.00	16,800,000	
北洋銀行	109,800	265.00	29,097,000	
愛知銀行	2,700	3,630.00	9,801,000	
中京銀行	3,000	1,436.00	4,308,000	
愛媛銀行	11,700	807.00	9,441,900	
京葉銀行	32,400	451.00	14,612,400	
栃木銀行	42,400	185.00	7,844,000	
北日本銀行	2,700	1,631.00	4,403,700	
東和銀行	15,300	546.00	8,353,800	
トモニホールディングス	60,000	332.00	19,920,000	
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	92,200	173.00	15,950,600	
ＦＰＧ	26,300	714.00	18,778,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,600	1,384.00	7,750,400	
ＳＢＩホールディングス	87,800	3,020.00	265,156,000	
ジャフコ　グループ	9,400	7,340.00	68,996,000	
大和証券グループ本社	531,100	688.40	365,609,240	
野村ホールディングス	1,089,700	578.00	629,846,600	
岡三証券グループ	61,500	427.00	26,260,500	
丸三証券	24,300	680.00	16,524,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	75,800	432.00	32,745,600	
水戸証券	22,400	322.00	7,212,800	
いちよし証券	16,600	667.00	11,072,200	
松井証券	36,200	855.00	30,951,000	
マネックスグループ	64,600	629.00	40,633,400	
極東証券	11,700	876.00	10,249,200	
岩井コスモホールディングス	8,100	1,472.00	11,923,200	
藍澤證券	13,900	1,144.00	15,901,600	
スパークス・グループ	40,200	298.00	11,979,600	
かんぽ生命保険	89,100	2,057.00	183,278,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	125,800	5,074.00	638,309,200	
アニコム　ホールディングス	23,200	919.00	21,320,800	

ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	174,000	3,827.00	665,898,000	
第一生命ホールディングス	351,600	2,380.00	836,808,000	
東京海上ホールディングス	235,200	5,700.00	1,340,640,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	212,900	1,452.00	309,130,800	
アドバンスクリエイト	4,000	1,090.00	4,360,000	
全国保証	18,800	5,810.00	109,228,000	
日本モーゲージサービス	6,100	1,116.00	6,807,600	
アルヒ	11,800	1,373.00	16,201,400	
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	1,328.00	55,112,000	
芙蓉総合リース	7,400	7,960.00	58,904,000	
みずほリース	11,100	3,720.00	41,292,000	
東京センチュリー	16,600	6,600.00	109,560,000	
日本証券金融	31,400	925.00	29,045,000	
アイフル	123,900	384.00	47,577,600	
リコーリース	6,100	3,855.00	23,515,500	
イオンフィナンシャルサービス	43,500	1,378.00	59,943,000	
アコム	144,000	446.00	64,224,000	
ジャックス	8,500	2,894.00	24,599,000	
オリエントコーポレーション	199,800	161.00	32,167,800	
オリックス	434,700	2,160.00	938,952,000	
三菱ＨＣキャピタル	241,100	608.00	146,588,800	
日本取引所グループ	193,300	2,964.00	572,941,200	
イー・ギャランティ	9,200	2,577.00	23,708,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,600	2,180.00	7,848,000	
いちご	82,300	369.00	30,368,700	
日本駐車場開発	94,200	170.00	16,014,000	
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,466.00	7,916,400	
ＳＲＥホールディングス	1,300	8,390.00	10,907,000	
ヒューリック	151,800	1,384.00	210,091,200	
三栄建築設計	3,500	1,965.00	6,877,500	
野村不動産ホールディングス	40,900	3,090.00	126,381,000	
三重交通グループホールディングス	18,800	530.00	9,964,000	
サムティ	10,100	2,369.00	23,926,900	
ディア・ライフ	16,100	504.00	8,114,400	

日本商業開発	6,800	1,744.00	11,859,200	
プレサンスコーポレーション	11,800	1,936.00	22,844,800	
日本管理センター	5,900	1,292.00	7,622,800	
フージャースホールディングス	13,600	699.00	9,506,400	
オープンハウス	22,700	5,840.00	132,568,000	
東急不動産ホールディングス	194,400	690.00	134,136,000	
飯田グループホールディングス	59,200	2,930.00	173,456,000	
ハウスドゥ	5,300	1,040.00	5,512,000	
ケイアイスター不動産	2,400	5,940.00	14,256,000	
グッドコムアセット	4,000	1,410.00	5,640,000	
ジェイ・エス・ビー	1,800	3,405.00	6,129,000	
パーク２４	38,800	2,149.00	83,381,200	
パラカ	3,900	1,920.00	7,488,000	
三井不動産	326,000	2,744.50	894,707,000	
三菱地所	470,000	1,832.50	861,275,000	
平和不動産	12,200	4,360.00	53,192,000	
東京建物	70,800	1,817.00	128,643,600	
ダイビル	18,700	1,586.00	29,658,200	
京阪神ビルディング	12,900	1,588.00	20,485,200	
住友不動産	161,000	4,014.00	646,254,000	
テーオーシー	16,500	687.00	11,335,500	
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	2,989.00	23,912,000	
フジ住宅	11,800	724.00	8,543,200	
空港施設	11,900	610.00	7,259,000	
ゴールドクレスト	7,400	1,808.00	13,379,200	
日神グループホールディングス	12,800	519.00	6,643,200	
日本エスコン	14,100	819.00	11,547,900	
タカラレーベン	35,000	326.00	11,410,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,800	887.00	6,918,600	
イオンモール	36,100	1,749.00	63,138,900	
カチタス	17,700	4,190.00	74,163,000	
トーセイ	11,500	1,235.00	14,202,500	
サンフロンティア不動産	11,200	1,235.00	13,832,000	
エフ・ジェー・ネクスト	8,100	1,064.00	8,618,400	
ランドビジネス	13,800	270.00	3,726,000	

日本空港ビルデング	25,100	5,050.00	126,755,000	
日本工営	4,400	3,435.00	15,114,000	
ＬＩＦＵＬＬ	29,900	365.00	10,913,500	
ミクシィ	17,600	2,830.00	49,808,000	
ジェイエイシーリクルートメント	5,600	2,077.00	11,631,200	
日本M&Aセンター	114,000	3,555.00	405,270,000	
メンバーズ	2,600	3,330.00	8,658,000	
ＵＴグループ	10,100	3,345.00	33,784,500	
アイティメディア	3,200	2,448.00	7,833,600	
タケエイ	9,100	1,820.00	16,562,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,000	1,325.00	5,300,000	
夢真ビーネックスグループ	18,700	1,339.00	25,039,300	
コシダカホールディングス	19,800	605.00	11,979,000	
パソナグループ	7,900	3,440.00	27,176,000	
リンクアンドモチベーション	15,200	1,062.00	16,142,400	
エス・エム・エス	24,000	4,410.00	105,840,000	
パーソルホールディングス	69,400	2,750.00	190,850,000	
リニカル	7,300	865.00	6,314,500	
クックパッド	29,600	228.00	6,748,800	
スタジオアリス	4,600	2,335.00	10,741,000	
シミックホールディングス	5,300	1,540.00	8,162,000	
綜合警備保障	27,700	5,090.00	140,993,000	
カカクコム	51,500	3,840.00	197,760,000	
アイロムグループ	3,300	2,274.00	7,504,200	
セントケア・ホールディング	6,400	1,057.00	6,764,800	
ルネサンス	7,300	1,214.00	8,862,200	
ディップ	11,000	4,100.00	45,100,000	
デジタルホールディングス	5,400	1,784.00	9,633,600	
新日本科学	11,100	931.00	10,334,100	
ベネフィット・ワン	25,500	5,390.00	137,445,000	
エムスリー	122,400	8,189.00	1,002,333,600	
アウトソーシング	39,700	2,108.00	83,687,600	
ウェルネット	11,700	545.00	6,376,500	
ワールドホールディングス	2,900	2,986.00	8,659,400	
ディー・エヌ・エー	29,700	2,095.00	62,221,500	
博報堂ＤＹホールディングス	96,500	1,900.00	183,350,000	

ぐるなび	15,600	544.00	8,486,400	
タカミヤ	13,400	476.00	6,378,400	
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	1,177.00	9,062,900	
ファンコミュニケーションズ	25,100	435.00	10,918,500	
ライク	2,700	1,921.00	5,186,700	
エスプール	18,300	1,075.00	19,672,500	
ＷＤＢホールディングス	3,700	3,680.00	13,616,000	
手間いらず	1,100	6,010.00	6,611,000	
アドウェイズ	12,400	787.00	9,758,800	
バリューコマース	4,800	4,850.00	23,280,000	
インフォマート	71,200	1,106.00	78,747,200	
ＪＰホールディングス	27,700	281.00	7,783,700	
プレステージ・インターナショナル	26,800	811.00	21,734,800	
アミューズ	4,600	2,376.00	10,929,600	
ドリームインキュベータ	4,400	945.00	4,158,000	
クイック	6,300	1,435.00	9,040,500	
電通グループ	71,900	4,330.00	311,327,000	
イオンファンタジー	3,600	2,005.00	7,218,000	
シーティーエス	8,900	831.00	7,395,900	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	19,900	3,345.00	66,565,500	
アルプス技研	6,800	2,062.00	14,021,600	
日本空調サービス	11,200	738.00	8,265,600	
オリエンタルランド	73,800	16,515.00	1,218,807,000	
ダスキン	16,000	2,712.00	43,392,000	
明光ネットワークジャパン	13,600	601.00	8,173,600	
ファルコホールディングス	4,700	1,817.00	8,539,900	
ラウンドワン	24,400	1,367.00	33,354,800	
リゾートトラスト	32,300	2,009.00	64,890,700	
ビー・エム・エル	8,900	4,525.00	40,272,500	
りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,288.00	13,781,600	
リソー教育	42,000	422.00	17,724,000	
ユー・エス・エス	77,500	1,970.00	152,675,000	
東京個別指導学院	9,400	662.00	6,222,800	
サイバーエージェント	171,200	2,200.00	376,640,000	
楽天グループ	354,400	1,132.00	401,180,800	
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,929.00	9,645,000	

モーニングスター	15,400	519.00	7,992,600	
山田コンサルティンググループ	5,800	1,184.00	6,867,200	
セントラルスポーツ	4,100	2,535.00	10,393,500	
フルキャストホールディングス	6,600	2,295.00	15,147,000	
エン・ジャパン	12,500	4,115.00	51,437,500	
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	15,670.00	45,443,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,000	3,715.00	18,575,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,100	711.00	4,337,100	
イー・ガーディアン	3,300	3,320.00	10,956,000	
ジャパンマテリアル	21,600	1,367.00	29,527,200	
ベクトル	10,000	1,138.00	11,380,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,900	1,699.00	10,024,100	
キャリアリンク	2,800	1,914.00	5,359,200	
ＩＢＪ	7,800	1,016.00	7,924,800	
アサンテ	4,200	1,830.00	7,686,000	
バリューＨＲ	4,100	1,800.00	7,380,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	5,700	5,730.00	32,661,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,663.00	6,485,700	
シグマクシス	4,500	2,971.00	13,369,500	
ウィルグループ	6,600	1,314.00	8,672,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,800	225.00	4,005,000	
メドピア	5,400	4,435.00	23,949,000	
リクルートホールディングス	496,500	6,987.00	3,469,045,500	
エラン	9,500	1,336.00	12,692,000	
日本郵政	524,400	969.80	508,563,120	
ベルシステム２４ホールディングス	12,100	1,745.00	21,114,500	
鎌倉新書	8,200	1,006.00	8,249,200	
アトラエ	5,400	2,695.00	14,553,000	
ストライク	2,800	4,305.00	12,054,000	
ソラスト	17,200	1,595.00	27,434,000	
セラク	2,800	2,268.00	6,350,400	
インソース	7,000	2,237.00	15,659,000	
ベイカレント・コンサルティング	4,600	60,300.00	277,380,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,200	4,025.00	8,855,000	
アイモバイル	2,900	1,578.00	4,576,200	

グレイステクノロジー	7,600	1,215.00	9,234,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	20,000	2,776.00	55,520,000	
ミダックホールディングス	3,600	4,995.00	17,982,000	
日総工産	7,500	799.00	5,992,500	
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	604.00	5,858,800	
マネジメントソリューションズ	4,000	3,135.00	12,540,000	
プロレド・パートナーズ	1,600	2,583.00	4,132,800	
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	4,365.00	17,896,500	
ポピンズホールディングス	2,200	3,450.00	7,590,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,800	6,910.00	19,348,000	
リログループ	38,300	2,537.00	97,167,100	
東祥	5,300	1,819.00	9,640,700	
エイチ・アイ・エス	16,100	2,485.00	40,008,500	
ラックランド	3,200	2,860.00	9,152,000	
共立メンテナンス	11,700	3,805.00	44,518,500	
イチネンホールディングス	8,600	1,329.00	11,429,400	
建設技術研究所	5,000	2,628.00	13,140,000	
長大	3,500	2,222.00	7,777,000	
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	1,291.00	7,487,800	
ナガワ	2,300	12,800.00	29,440,000	
東京都競馬	4,700	4,090.00	19,223,000	
カナモト	12,400	2,692.00	33,380,800	
西尾レントオール	6,500	3,030.00	19,695,000	
トランス・コスモス	6,900	3,755.00	25,909,500	
乃村工藝社	30,700	980.00	30,086,000	
日本管財	6,700	2,729.00	18,284,300	
トーカイ	6,700	2,437.00	16,327,900	
セコム	68,200	8,585.00	585,497,000	
セントラル警備保障	3,800	2,800.00	10,640,000	
丹青社	15,500	894.00	13,857,000	
メイテック	8,600	6,900.00	59,340,000	
応用地質	8,700	1,472.00	12,806,400	

船井総研ホールディングス	14,600	2,863.00	41,799,800	
オオバ	8,700	866.00	7,534,200	
ベネッセホールディングス	25,700	2,475.00	63,607,500	
イオンディライト	8,400	3,755.00	31,542,000	
ダイセキ	14,160	4,820.00	68,251,200	
合　計	75,707,860		207,943,757,270	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	2,322,343,471	2,488,240,861
金銭信託	-	125,702,117
コール・ローン	271,687,989	243,549,078
株式	229,758,511,547	314,203,048,109
投資証券	5,708,432,598	7,741,154,753
派生商品評価勘定	77,221,722	52,415,131
未収入金	1,701,004	40,874,182
未収配当金	417,053,912	565,016,845
差入委託証拠金	1,721,013,258	1,576,501,388
流動資産合計	240,277,965,501	327,036,502,464
資産合計	240,277,965,501	327,036,502,464
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,135,763	8,866,303
前受金	27,840,759	44,342,544
未払金	31,457,561	-
未払解約金	88,109,992	39,035,999
未払利息	794	537
その他未払費用	7,574	11,928
流動負債合計	196,552,443	92,257,311
負債合計	196,552,443	92,257,311
純資産の部		
元本等		

元本	59,853,159,106	59,015,956,817
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	180,228,253,952	267,928,288,336
元本等合計	240,081,413,058	326,944,245,153
純資産合計	240,081,413,058	326,944,245,153
負債純資産合計	240,277,965,501	327,036,502,464

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	（1）先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 （2）為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	59,853,159,106口	59,015,956,817口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　4.0112円 (10,000口当たりの純資産額　40,112円)	1口当たり純資産額　5.5399円 (10,000口当たりの純資産額　55,399円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,643,464,237	-	4,671,304,996	27,840,759
	SPMINI 2009	3,500,347,325	-	3,521,503,693	21,156,368
	DJ EUR 2009	762,631,386	-	772,294,710	9,663,324
	FTSE 2009	206,807,372	-	207,903,543	1,096,171
	SPI200 2009	173,678,154	-	169,603,050	△4,075,104
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	170,679,600	-	170,924,500	244,900
	米ドル	96,530,600	-	96,651,100	120,500
	カナダドル	8,051,400	-	8,069,000	17,600
	ユーロ	38,829,900	-	38,874,000	44,100
	英ポンド	4,120,800	-	4,138,800	18,000
	スイスフラン	11,622,800	-	11,648,000	25,200
	スウェーデンクローナ	4,967,600	-	4,977,400	9,800
	ノルウェークローネ	940,400	-	942,400	2,000
	デンマーククローネ	2,861,300	-	2,866,200	4,900
	ニュージーランドドル	708,900	-	709,000	100
	香港ドル	956,900	-	959,000	2,100
	シンガポールドル	777,000	-	776,900	△100
	イスラエルシュケル	312,000	-	312,700	700
	売建	9,244,500	-	9,244,200	300
	英ポンド	4,139,100	-	4,138,800	300
	オーストラリアドル	1,543,400	-	1,543,400	-
	香港ドル	3,562,000	-	3,562,000	-
合計		4,823,388,337	-	4,851,473,696	28,085,959

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,906,631,960	-	4,950,974,504	44,342,544
	SPMINI 2109	3,730,567,288	-	3,772,709,909	42,142,621
	DJ EUR 2109	781,489,951	-	786,025,512	4,535,561
	FTSE 2109	214,307,241	-	213,444,165	△863,076
	SPI200 2109	180,267,480	-	178,794,918	△1,472,562
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	217,123,160	-	216,329,444	△793,716
	米ドル	182,965,200	-	182,230,152	△735,048
	カナダドル	5,204,760	-	5,201,178	△3,582
	ユーロ	19,530,450	-	19,472,070	△58,380
	スイスフラン	4,782,320	-	4,790,552	8,232
	スウェーデンクローナ	2,041,920	-	2,041,456	△464
	ノルウェークローネ	379,560	-	379,773	213
	デンマーククローネ	1,400,800	-	1,396,800	△4,000
	シンガポールドル	818,150	-	817,463	△687
合計		5,123,755,120	-	5,167,303,948	43,548,828

（注）１．時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2)為替予約取引の時価の算定方法について

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

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	49,466,918,390円
同期中における追加設定元本額	29,160,154,060円
同期中における一部解約元本額	18,773,913,344円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	27,034,677,257円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	309,137,541円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,275,097,010円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	842,001,443円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	59,512,894円
三井住友・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）	7,345,183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）	44,068,516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）	92,573,242円
外国株式指数ファンド	558,312,178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	7,016,966,881円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	313,577,921円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	352,729,063円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	249,687,520円
イオン・バランス戦略ファンド	68,689,281円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	10,567,496円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	76,921,529円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	61,327,592円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	194,062,543円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	99,496,955円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	109,235,569円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	26,928,571円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	83,521,551円

三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	1,598,370円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	7,890,591円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	5,409,033円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,791,304円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	276,321円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,024,852,716円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	6,086,336円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	59,688,739円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,189,934,147円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,255,200,561円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	5,343,517,229円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	16,031,634円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	86,614,229円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	274,725円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	651,864,841円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	54,595,763円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	154,273,858円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	678,822,097円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	530,085,597円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,278,255,149円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	516,296円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	268,527,607円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	111,955,417円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	14,783,156円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,284,569円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	5,874,741円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	35,545,255円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	90,634,725円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	418,153,613円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	110,332,710円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	4,911,651,620円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	210,853,707円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	1,761,001,918円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	10,193,688円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	36,957,323円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	48,272,628円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	499,025,860円
合計	59,853,159,106円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,853,159,106円
同期中における追加設定元本額	14,565,827,797円

同期中における一部解約元本額	15,403,030,086円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	31,170,342,513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）	1,122,166,488円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	783,254,071円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	65,190,674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）	48,992,318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）	95,184,879円
外国株式指数ファンド	705,331,251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	10,987,662,573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）	126,312,173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	15,007,158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）	93,324,141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）	154,800,475円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	182,268,098円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	35,998,838円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	405,681,734円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	4,206,998円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	17,179,640円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	15,380,398円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,059,243円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	82,757,983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	563,364円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	655,561,055円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	3,977,147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＞	32,980,346円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	777,058,391円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	898,186,841円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,873,800,818円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	13,223,432円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	68,583,205円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	521,940,125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＞	42,750,063円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	111,968,960円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	530,244,129円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	378,468,665円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	886,984,440円

ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	82,477,988円
ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・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
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＞	149,638,035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＞	68,493,967円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,099,888,360円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	137,971,492円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	1,044,221,401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＞	23,459,810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＞	48,604,306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＞	52,827,375円
ＳＭＡＭ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII＜適格機関投資家限定＞	120,158,753円
合計	59,015,956,817円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

通 貨	銘 柄	株 数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	37,418	23.51	879,697.18	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	87.56	1,028,567.32	
	CHEVRON CORPORATION	100,995	96.00	9,695,520.00	
	CONOCOPHILLIPS	70,648	55.58	3,926,615.84	
	DEVON ENERGY CORPORATION	31,182	28.45	887,127.90	
	EOG RESOURCES INC	30,830	67.35	2,076,400.50	
	EXXON MOBIL CORPORATION	220,715	54.09	11,938,474.35	
	HALLIBURTON CO	44,317	19.32	856,204.44	
	HESS CORPORATION	14,344	68.58	983,711.52	
	KINDER MORGAN INC	105,940	15.98	1,692,921.20	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,933	57.25	1,942,664.25	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	25.07	1,217,900.60	
	ONEOK INC	24,725	52.40	1,295,590.00	

PHILLIPS 66	22,492	66.74	1,501,116.08	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,184	150.30	1,831,255.20	
SCHLUMBERGER LTD	73,444	26.62	1,955,079.28	
VALERO ENERGY CORP	21,447	63.54	1,362,742.38	
WILLIAMS COS INC	64,802	24.14	1,564,320.28	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,818	267.12	3,156,824.16	
ALBEMARLE CORPORATION	6,560	243.41	1,596,769.60	
AMCOR PLC	82,302	12.13	998,323.26	
AVERY DENNISON CORP	4,232	224.94	951,946.08	
BALL CORPORATION	17,166	95.46	1,638,666.36	
CELANESE CORPORATION	5,598	152.86	855,710.28	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	45.40	544,890.80	
CORTEVA INC	39,348	43.58	1,714,785.84	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	106.44	730,497.72	
DOW INC	38,654	60.28	2,330,063.12	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	70.30	1,964,463.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	109.37	768,542.99	
ECOLAB INC	13,341	227.51	3,035,210.91	
FMC CORPORATION	6,676	97.50	650,910.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	75,431	34.81	2,625,753.11	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	58.58	1,121,221.20	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,767	150.84	1,925,774.28	
LINDE PLC	27,447	312.70	8,582,676.90	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	91.59	1,275,940.29	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	367.79	1,137,206.68	
MOSAIC CO/THE	18,584	31.57	586,696.88	
NEWMONT CORPORATION	41,882	57.31	2,400,257.42	
NUCOR CORP	15,455	112.57	1,739,769.35	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	151.71	710,306.22	
PPG INDUSTRIES INC	12,256	154.56	1,894,287.36	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	80.84	622,144.64	
SEALED AIR CORP	7,895	58.19	459,410.05	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,616	297.30	4,048,036.80	
STEEL DYNAMICS,INC.	10,191	65.95	672,096.45	
VULCAN MATERIALS CO	6,698	176.00	1,178,848.00	

WESTROCK CO	13,034	51.78	674,900.52	
3M COMPANY	30,604	185.75	5,684,693.00	
ALLEGION PLC	4,764	143.28	682,585.92	
AMETEK INC	12,171	131.76	1,603,650.96	
BOEING CO	28,768	213.94	6,154,625.92	
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	56.73	2,453,742.69	
CATERPILLAR INC	28,430	205.42	5,840,090.60	
CUMMINS INC	7,315	232.98	1,704,248.70	
DEERE & CO	15,722	364.84	5,736,014.48	
DOVER CORP	6,972	174.84	1,218,984.48	
EATON CORP PLC	21,326	161.53	3,444,788.78	
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	100.08	3,120,294.24	
FASTENAL COMPANY	29,892	53.41	1,596,531.72	
FORTIVE CORP	15,750	75.78	1,193,535.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,166	95.82	686,646.12	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	455.24	1,502,292.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	203.81	2,576,566.02	
GENERAL ELECTRIC CO	56,767	103.29	5,863,463.43	
HEICO CORP	1,888	125.11	236,207.68	
HEICO CORP-CLASS A	3,183	111.81	355,891.23	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,260	222.93	8,083,441.80	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	31.67	602,490.08	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	199.33	419,988.31	
IDEX CORP	3,839	217.74	835,903.86	
ILLINOIS TOOL WORKS	16,869	219.99	3,711,011.31	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	53.89	1,132,390.57	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	54.51	626,865.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,803	75.63	2,934,670.89	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	232.05	2,570,881.95	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,527	325.75	497,420.25	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,359	348.93	4,661,355.87	
MASCO CORP	14,885	59.44	884,764.40	
NORDSON CORP	2,884	243.11	701,129.24	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,215	356.78	2,930,947.70	
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	90.48	1,910,123.28	

OWENS CORNING	5,205	93.59	487,135.95	
PACCAR INC	18,041	83.21	1,501,191.61	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	6,691	288.02	1,927,141.82	
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	76.20	626,364.00	
PLUG POWER INC	28,584	25.26	722,031.84	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,825	83.66	6,594,499.50	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	315.03	1,959,171.57	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,657	478.91	2,709,193.87	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	56.04	425,904.00	
SMITH(A.O.) CORP	7,157	70.96	507,860.72	
SNAP-ON INC	3,106	220.31	684,282.86	
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,007	188.55	1,509,719.85	
SUNRUN INC	10,669	44.61	475,944.09	
TEXTRON INC	11,803	71.35	842,144.05	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	190.17	2,426,379.03	
TRANSDIGM GROUP INC	2,681	598.07	1,603,425.67	
UNITED RENTALS INC	3,596	342.08	1,230,119.68	
WABTEC CORP	9,231	89.30	824,328.30	
WW GRAINGER INC	2,390	416.54	995,530.60	
XYLEM INC	9,124	133.94	1,222,068.56	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	82.35	661,188.15	
CINTAS CORP	5,169	400.06	2,067,910.14	
CLARIVATE PLC	19,939	26.38	525,990.82	
COPART INC	10,977	142.09	1,559,721.93	
COSTAR GROUP INC	20,540	89.69	1,842,232.60	
EQUIFAX INC	6,127	275.89	1,690,378.03	
IHS MARKIT LTD	19,584	119.85	2,347,142.40	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	135.55	938,954.85	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	99.06	688,169.82	
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	123.99	1,415,345.85	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	103.33	573,998.15	
ROLLINS INC	11,493	38.58	443,399.94	
TRANSUNION	9,497	124.18	1,179,337.46	
VERISK ANALYTICS INC	7,929	204.86	1,624,334.94	
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	131.24	1,779,089.44	

WASTE MANAGEMENT INC	22,023	153.80	3,387,137.40	
AMERCO	390	655.29	255,563.10	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	6,925	87.28	604,414.00	
CSX CORPORATION	121,827	31.35	3,819,276.45	
DELTA AIR LINES INC	8,299	41.09	341,005.91	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	123.45	1,072,657.05	
FEDEX CORP	13,083	259.22	3,391,375.26	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	172.76	762,044.36	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,866	284.09	1,382,381.94	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	7,940	51.39	408,036.60	
LYFT INC-A	13,145	50.51	663,953.95	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,783	247.62	3,165,326.46	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	289.65	1,426,815.90	
SOUTHWEST AIRLINES	7,076	49.23	348,351.48	
UBER TECHNOLOGIES INC	62,618	40.35	2,526,636.30	
UNION PACIFIC CORP	34,922	210.05	7,335,366.10	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,512	189.01	7,090,143.12	
APTIV PLC	14,147	148.93	2,106,912.71	
AUTOLIV INC	4,001	86.44	345,846.44	
BORGWARNER INC	12,075	42.60	514,395.00	
FORD MOTOR COMPANY	209,141	12.76	2,668,639.16	
GENERAL MOTORS CO	68,943	48.42	3,338,220.06	
LEAR CORP	2,749	156.68	430,713.32	
TESLA INC	42,736	754.86	32,259,696.96	
D.R.HORTON INC	18,162	90.24	1,638,938.88	
GARMIN LTD	8,444	173.11	1,461,740.84	
HASBRO INC	7,491	98.04	734,417.64	
LENNAR CORP-CL A	14,494	100.22	1,452,588.68	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	420.71	2,726,621.51	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	190.34	544,943.42	
NEWELL BRANDS INC	17,587	25.62	450,578.94	
NIKE INC -CL B	66,924	163.34	10,931,366.16	
NVR INC	173	5,098.43	882,028.39	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,599	107.08	1,349,100.92	
PULTE GROUP INC	13,075	48.48	633,876.00	

VF CORP	17,117	72.15	1,234,991.55	
WHIRLPOOL CORP	3,212	217.24	697,774.88	
AIRBNB INC-CLASS A	6,554	166.00	1,087,964.00	
ARAMARK	13,242	33.25	440,296.50	
BOOKING HOLDINGS INC	2,139	2,318.67	4,959,635.13	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,690	106.59	1,139,447.10	
CARNIVAL CORP	40,398	23.28	940,465.44	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,469	1,909.70	2,805,349.30	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,111	148.18	905,527.98	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	516.12	1,094,690.52	
DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	63.67	1,065,963.14	
EXPEDIA GROUP INC	6,894	146.74	1,011,625.56	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	125.75	1,838,087.75	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	43.67	770,076.78	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	136.09	2,002,564.35	
MCDONALD'S CORPORATION	39,232	238.61	9,361,147.52	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,191	13.97	156,338.27	
MGM MIRAGE	22,198	42.76	949,186.48	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	81.65	970,818.50	
STARBUCKS CORP	62,130	118.79	7,380,422.70	
VAIL RESORTS INC	2,038	299.61	610,605.18	
WYNN RESORTS LTD	4,913	103.93	510,608.09	
YUM! BRANDS INC	15,549	129.25	2,009,708.25	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	78.05	3,129,180.60	
ALPHABET INC-CL A	15,714	2,870.82	45,112,065.48	
ALPHABET INC-CL C	15,230	2,898.27	44,140,652.10	
ALTICE USA INC-A	9,667	27.20	262,942.40	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	48.52	1,341,966.16	
CABLE ONE INC	246	1,986.07	488,573.22	
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,002	785.41	5,499,440.82	
COMCAST CORP-CLASS A	239,809	59.56	14,283,024.04	
DISCOVERY INC-A	7,075	26.79	189,539.25	
DISCOVERY INC-C	17,417	25.72	447,965.24	
DISH NETWORK CORP.	12,937	43.89	567,804.93	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	142.31	2,184,743.12	

FACEBOOK INC-A	125,292	378.00	47,360,376.00	
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	36.36	616,738.32	
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	33.67	295,386.91	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	131.36	522,024.64	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	36.82	722,629.32	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	179.82	235,923.84	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	184.13	1,509,129.48	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	50.21	516,560.48	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	48.07	367,639.36	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	48.17	199,471.97	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	86.38	648,886.56	
MATCH GROUP INC	12,773	157.71	2,014,429.83	
NETFLIX INC	23,263	597.54	13,900,573.02	
NEWS CORP-CLASS A	23,102	22.05	509,399.10	
OMNICOM GROUP	10,417	72.12	751,274.04	
PINTEREST INC- CLASS A	28,563	55.12	1,574,392.56	
ROKU INC	6,012	338.46	2,034,821.52	
SEA LTD-ADR	3,725	322.60	1,201,685.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.07	410,671.92	
SNAP INC-A	49,643	74.62	3,704,360.66	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	157.03	896,170.21	
THE WALT DISNEY CO.	94,639	185.91	17,594,336.49	
TWITTER INC	40,795	62.46	2,548,055.70	
VIACOMCBS INC	29,772	40.34	1,201,002.48	
ZILLOW GROUP INC-A	3,154	92.88	292,943.52	
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	93.15	736,443.90	
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	201.22	689,379.72	
AMAZON.COM INC	23,690	3,484.16	82,539,750.40	
AUTOZONE INC	1,137	1,551.89	1,764,498.93	
BATH & BODYWORKS INC	12,707	64.53	819,982.71	
BEST BUY COMPANY INC	12,132	112.39	1,363,515.48	
BURLINGTON STORES INC	3,391	294.18	997,564.38	
CARMAX INC	8,427	133.23	1,122,729.21	
CARVANA CO	3,803	328.81	1,250,464.43	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	76.60	304,025.40	

DOLLAR GENERAL CORP	12,746	220.14	2,805,904.44	
DOLLAR TREE INC	12,047	91.20	1,098,686.40	
DOORDASH INC-A	3,844	207.74	798,552.56	
EBAY INC	35,551	73.00	2,595,223.00	
ETSY INC	6,272	216.63	1,358,703.36	
GENUINE PARTS CO	7,406	119.19	882,721.14	
HOME DEPOT INC	55,494	331.77	18,411,244.38	
LKQ CORPORATION	15,922	50.79	808,678.38	
LOWE'S COMPANIES INC	36,894	203.01	7,489,850.94	
MERCADOLIBRE INC	2,337	1,883.41	4,401,529.17	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,641	592.16	2,156,054.56	
POOL CORP	2,107	491.64	1,035,885.48	
ROSS STORES INC	18,792	114.27	2,147,361.84	
TARGET CORP	26,108	245.44	6,407,947.52	
TJX COMPANIES INC	63,882	69.45	4,436,604.90	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	201.68	1,233,676.56	
ULTA BEAUTY INC	2,765	382.08	1,056,451.20	
WAYFAIR INC-CLASS A	3,756	265.89	998,682.84	
COSTCO WHOLESALE CORP	23,094	465.94	10,760,418.36	
KROGER CO	38,955	46.13	1,796,994.15	
SYSCO CORP	26,862	77.97	2,094,430.14	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,873	50.57	1,915,237.61	
WALMART INC	81,129	146.42	11,878,908.18	
ALTRIA GROUP INC	96,029	50.59	4,858,107.11	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,341	59.66	1,810,144.06	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	467	538.31	251,390.77	
BROWN-FORMAN CORPORATION	16,130	71.20	1,148,456.00	
BUNGE LIMITED	7,174	75.65	542,713.10	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	42.80	455,306.40	
COCA-COLA CO/THE	213,435	55.86	11,922,479.10	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	10,501	58.27	611,893.27	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	33.22	818,507.58	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	216.01	1,918,384.81	
GENERAL MILLS INC	31,489	58.45	1,840,532.05	
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	42.20	630,425.80	

JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	120.78	696,659.04	
KELLOGG CO	12,949	63.00	815,787.00	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	34.83	1,332,038.52	
KRAFT HEINZ COMPANY	32,774	36.56	1,198,217.44	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	61.25	454,291.25	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	86.76	1,135,167.84	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	46.05	443,415.45	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,270	60.61	4,440,894.70	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,898	96.35	1,917,172.30	
PEPSICO INC	71,927	155.73	11,201,191.71	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	81,198	102.58	8,329,290.84	
THE HERSHEY COMPANY	7,514	175.40	1,317,955.60	
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	75.58	1,129,845.42	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	83.46	1,041,998.10	
CLOROX COMPANY	6,542	168.93	1,105,140.06	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	43,041	77.30	3,327,069.30	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,059	337.49	4,069,791.91	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	137.80	2,452,840.00	
PROCTER & GAMBLE CO	128,383	143.99	18,485,868.17	
ABBOTT LABORATORIES	92,360	127.98	11,820,232.80	
ABIOMED INC	2,288	365.84	837,041.92	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	726.41	2,799,584.14	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	123.60	987,934.80	
ANTHEM INC	12,576	371.43	4,671,103.68	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	81.72	2,160,186.48	
BECTON DICKINSON & CO	15,140	260.15	3,938,671.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	45.41	3,385,587.96	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	53.29	805,425.06	
CENTENE CORP	30,528	61.96	1,891,514.88	
CERNER CORP	15,537	75.05	1,166,051.85	
CIGNA CORPORATION	18,324	213.95	3,920,419.80	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,771	448.14	1,241,795.94	
CVS HEALTH CORPORATION	69,353	85.41	5,923,439.73	
DANAHER CORP	33,766	328.38	11,088,079.08	
DAVITA INC	4,138	129.09	534,174.42	

DENTSPLY SIRONA INC	11,864	62.46	741,025.44	
DEXCOM INC	5,047	552.66	2,789,275.02	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,336	122.08	3,947,578.88	
HCA HEALTHCARE INC	14,312	258.26	3,696,217.12	
HENRY SCHEIN INC	7,559	77.77	587,863.43	
HOLOGIC INC	13,592	79.95	1,086,680.40	
HUMANA INC.	6,744	417.12	2,813,057.28	
IDEXX LABORATORIES INC	4,601	676.57	3,112,898.57	
INSULET CORP	3,400	302.27	1,027,718.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,237	1,070.01	6,673,652.37	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	303.16	1,514,284.20	
MASIMO CORPORATION	2,941	272.64	801,834.24	
MCKESSON CORP	8,411	204.64	1,721,227.04	
MEDTRONIC PLC	70,251	133.43	9,373,590.93	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,698	258.71	697,999.58	
NOVOCURE LTD	4,517	138.67	626,372.39	
OAK STREET HEALTH INC	6,212	52.26	324,639.12	
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	157.35	1,072,182.90	
RESMED INC	7,595	295.58	2,244,930.10	
STERIS PLC	5,282	213.12	1,125,699.84	
STRYKER CORP	17,983	276.92	4,979,852.36	
TELADOC HEALTH INC	7,496	142.42	1,067,580.32	
TELEFLEX INC	2,340	385.40	901,836.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,467	414.55	20,506,544.85	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	150.12	630,954.36	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,005	306.13	2,144,440.65	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	461.24	1,743,025.96	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	144.34	1,566,955.04	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	184.13	702,271.82	
ABBVIE INC	92,065	107.27	9,875,812.55	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,406	177.23	2,730,405.38	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	189.60	1,064,224.80	
AMGEN INC	30,112	215.58	6,491,544.96	
AVANTOR INC	25,606	41.87	1,072,123.22	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	810.79	989,163.80	

BIO-TECHNE CORP	1,991	508.17	1,011,766.47	
BIOGEN INC	7,987	300.15	2,397,298.05	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	80.11	727,398.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,054	63.58	7,378,713.32	
CATALENT INC	8,935	141.03	1,260,103.05	
CHARLES RIVER LABORATORIES INC	2,577	443.00	1,141,611.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	33.54	698,000.94	
ELI LILLY & CO	42,227	240.00	10,134,480.00	
EXACT SCIENCES CORP	8,428	105.85	892,103.80	
GILEAD SCIENCES INC	65,673	70.61	4,637,170.53	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	107.42	1,244,138.44	
ILLUMINA INC	7,655	459.25	3,515,558.75	
INCYTE CORP	9,243	72.69	671,873.67	
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	261.28	2,592,158.88	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	134.41	350,003.64	
JOHNSON & JOHNSON	137,048	168.07	23,033,657.36	
MERCK & CO. INC.	133,049	73.82	9,821,677.18	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	1,584.80	1,993,678.40	
MODERNA INC	17,813	455.92	8,121,302.96	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	94.45	395,367.70	
NOVAVAX INC	3,601	258.77	931,830.77	
PERKINELMER INC	5,624	186.85	1,050,844.40	
PFIZER INC	290,792	46.03	13,385,155.76	
PPD INC	6,413	46.62	298,974.06	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	646.11	3,550,374.45	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,431	38.29	284,532.99	
SEAGEN INC	6,654	149.59	995,371.86	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	53,937	9.25	498,917.25	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,664	568.78	11,753,269.92	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	188.09	2,544,857.70	
VIATRIS INC	63,072	14.29	901,298.88	
WATERS CORP	3,425	422.02	1,445,418.50	
ZOETIS INC	25,246	206.02	5,201,180.92	
BANK OF AMERICA CORP	402,525	40.93	16,475,348.25	
CITIGROUP INC	107,883	70.46	7,601,436.18	

CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	43.24	899,348.76	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	38.80	1,441,420.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	197.47	1,756,890.59	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	15.34	1,163,032.78	
JPMORGAN CHASE & CO	157,992	159.19	25,150,746.48	
KEYCORP	51,128	19.97	1,021,026.16	
M & T BANK CORP	7,237	137.95	998,344.15	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,991	192.28	4,228,429.48	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,041	19.66	924,826.06	
SVB FINANCIAL GROUP	2,761	589.63	1,627,968.43	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	70,316	55.73	3,918,710.68	
US BANCORP	74,623	55.82	4,165,455.86	
WELLS FARGO & COMPANY	217,356	44.36	9,641,912.16	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	50.74	1,021,852.86	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,523	159.39	5,662,010.97	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,738	269.55	1,546,677.90	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	61.14	473,529.30	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	52.88	2,231,906.16	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	69,189	278.61	19,276,747.29	
BLACKROCK INC	7,916	922.14	7,299,660.24	
BLACKSTONE INC	35,000	129.41	4,529,350.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	155.78	3,684,820.12	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	49.11	495,716.34	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	124.29	703,605.69	
CME GROUP INC.	18,712	192.46	3,601,311.52	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	120.30	1,975,927.50	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.51	696,238.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	383.57	743,742.23	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	31.36	448,385.28	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	109.52	345,973.68	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,827	404.58	7,212,447.66	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,608	119.45	3,417,225.60	
INVESCO LIMITED	18,328	24.78	454,167.84	
KKR & CO INC	28,569	62.91	1,797,275.79	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	443.63	848,220.56	

MOODY'S CORP	8,519	382.50	3,258,517.50	
MORGAN STANLEY	72,831	103.84	7,562,771.04	
MSCI INC-A	4,383	652.86	2,861,485.38	
NASDAQ INC	6,509	197.94	1,288,391.46	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	114.58	1,263,015.34	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	137.87	885,952.62	
S&P GLOBAL INC	12,767	451.39	5,762,896.13	
SCHWAB (CHARLES) CORP	75,184	72.33	5,438,058.72	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	60.15	329,682.15	
STATE STREET CORP	18,694	87.89	1,643,015.66	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	46.58	1,495,776.96	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	217.21	2,674,723.94	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	87.41	456,280.20	
VOYA FINANCIAL INC	7,308	64.22	469,319.76	
AFLAC INC	34,185	55.14	1,884,960.90	
ALLEGHANY CORPORATION	689	644.44	444,019.16	
ALLSTATE CORP	16,419	132.09	2,168,785.71	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	134.71	476,738.69	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	54.69	2,447,104.05	
AON PLC	12,005	292.38	3,510,021.90	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	39.52	809,211.52	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,149	145.39	1,475,563.11	
ASSURANT INC	3,114	169.84	528,881.76	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,195	68.67	562,750.65	
BROWN & BROWN INC	10,864	58.43	634,783.52	
CHUBB LTD	23,255	181.08	4,211,015.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	119.25	937,066.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	175.89	226,546.32	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	260.08	537,065.20	
FNF GROUP	13,937	46.90	653,645.30	
GLOBE LIFE INC	4,333	93.09	403,358.97	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	68.62	1,257,873.22	
JACKSON FINANCIAL INC-A	3,265	28.20	92,073.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	66.45	576,586.65	
LOEWS CORPORATION	12,727	54.58	694,639.66	

MARKEL CORP	702	1,248.92	876,741.84	
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	160.29	4,267,721.25	
METLIFE INC	39,703	61.03	2,423,074.09	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	65.26	921,732.24	
PROGRESSIVE CORP	30,543	93.22	2,847,218.46	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	104.54	2,166,905.12	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	150.45	459,173.40	
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	157.96	2,073,382.96	
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	73.05	542,615.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	236.00	1,610,228.00	
CBRE GROUP INC-A	18,244	98.14	1,790,466.16	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.85	253,655.00	
ACCENTURE PLC-CL A	33,363	341.10	11,380,119.30	
ADOBE INC	25,076	661.68	16,592,287.68	
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	113.38	943,434.98	
ANSYS INC	4,470	371.97	1,662,705.90	
AUTODESK INC	11,506	287.68	3,310,046.08	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,387	203.16	4,548,142.92	
AVALARA INC	4,319	183.86	794,091.34	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	69.17	609,249.36	
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	75.22	573,402.06	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	170.73	1,005,428.97	
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	165.91	2,364,217.50	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	112.35	784,090.65	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,400	122.34	782,976.00	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	108.30	702,867.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,673	127.99	1,622,017.27	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	26,533	76.48	2,029,243.84	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	255.06	890,159.40	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,874	265.16	2,618,189.84	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	165.52	340,143.60	
DATADOG INC - CLASS A	10,423	140.90	1,468,600.70	
DOCUSIGN INC	10,078	281.31	2,835,042.18	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	32.10	532,346.40	
DYNATRACE INC	9,587	70.64	677,225.68	

EPAM SYSTEMS INC	3,095	626.89	1,940,224.55	
FAIR ISAAC CORP	1,494	461.59	689,615.46	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,016	127.03	4,066,992.48	
FISERV INC	31,564	115.01	3,630,175.64	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	264.60	1,156,566.60	
FORTINET INC	7,360	310.74	2,287,046.40	
GARTNER INC	4,568	315.87	1,442,894.16	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,331	172.08	2,638,158.48	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	75.34	670,902.70	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	122.07	577,513.17	
HUBSPOT INC	2,275	681.89	1,551,299.75	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	47,143	137.74	6,493,476.82	
INTUIT INC	14,242	567.75	8,085,895.50	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	171.25	670,443.75	
MASTERCARD INC-CL A	46,455	351.41	16,324,751.55	
MICROSOFT CORP	373,728	297.25	111,090,648.00	
MONGODB INC	2,659	474.93	1,262,838.87	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	27.38	858,280.86	
OKTA INC	6,306	266.46	1,680,296.76	
ORACLE CORPORATION	98,813	89.54	8,847,716.02	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	82,071	26.13	2,144,515.23	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,942	466.50	2,305,443.00	
PAYCHEX INC	17,729	111.32	1,973,592.28	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	480.10	1,210,812.20	
PAYPAL HOLDINGS INC	58,324	286.88	16,731,989.12	
PTC INC	5,462	127.39	695,804.18	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	232.19	926,902.48	
SALESFORCE.COM,INC.	50,706	260.74	13,221,082.44	
SERVICENOW INC	10,305	650.19	6,700,207.95	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,046	319.97	3,214,418.62	
SPLUNK INC	8,252	156.16	1,288,632.32	
SQUARE INC-A	20,789	251.54	5,229,265.06	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	73.26	845,859.96	
SYNOPSYS INC	7,869	333.55	2,624,704.95	
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	21,400	72.82	1,558,348.00	

TWILIO INC-A	8,214	352.63	2,896,502.82	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	477.49	962,619.84	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	134.14	382,701.42	
VERISIGN INC	5,227	221.90	1,159,871.30	
VISA INC	88,428	227.49	20,116,485.72	
VMWARE INC	4,194	145.55	610,436.70	
WESTERN UNION COMPANY	21,840	21.32	465,628.80	
WIX.COM LTD	2,840	227.39	645,787.60	
WORKDAY INC-CLASS A	9,864	270.00	2,663,280.00	
ZENDESK INC	6,067	120.76	732,650.92	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,098	295.86	3,283,454.28	
ZSCALER INC	4,551	280.22	1,275,281.22	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	31,396	75.22	2,361,607.12	
APPLE INC	871,554	154.07	134,280,324.78	
ARISTA NETWORKS INC	2,699	358.13	966,592.87	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	115.33	476,312.90	
CDW CORP/DE	7,404	199.55	1,477,468.20	
CISCO SYSTEMS INC	221,654	58.60	12,988,924.40	
COGNEX CORP	8,698	87.18	758,291.64	
CORNING INC	39,709	38.61	1,533,164.49	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	14,550	96.38	1,402,329.00	
F5 NETWORKS INC	2,909	203.21	591,137.89	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	14.66	936,495.46	
HP INC	65,388	28.21	1,844,595.48	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	174.24	309,450.24	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	28.14	491,324.40	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	180.79	1,725,098.18	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	244.00	2,247,728.00	
NETAPP INC	10,919	92.09	1,005,530.71	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	11,800	87.34	1,030,612.00	
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	145.77	2,540,042.25	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,371	440.97	1,045,539.87	
TRIMBLE INC	12,759	93.65	1,194,880.35	
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	58.74	872,700.18	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	577.47	1,580,535.39	

AT&T INC	374,701	27.42	10,274,301.42	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	29.01	244,612.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	28.99	611,080.21	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	12.36	615,008.88	
T-MOBILE US INC	31,897	131.44	4,192,541.68	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	216,062	54.44	11,762,415.28	
AES CORPORATION	33,656	24.06	809,763.36	
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	60.70	734,530.70	
AMEREN CORPORATION	12,454	87.88	1,094,457.52	
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	90.40	2,325,720.80	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	187.54	1,716,741.16	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	96.19	669,963.35	
CENTERPOINT ENERGY INC	32,003	26.56	849,999.68	
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	64.44	904,737.60	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,399	76.38	1,405,315.62	
DOMINION ENERGY INC	41,951	78.46	3,291,475.46	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	120.57	1,270,325.52	
DUKE ENERGY CORP	39,456	104.62	4,127,886.72	
EDISON INTERNATIONAL	18,856	58.66	1,106,092.96	
ENTERGY CORP	10,866	112.94	1,227,206.04	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	50.12	697,119.08	
EVERGY INC	11,273	68.19	768,705.87	
EVERSOURCE ENERGY	17,557	89.81	1,576,794.17	
EXELON CORP	50,837	50.23	2,553,542.51	
FIRSTENERGY CORP	26,948	38.37	1,033,994.76	
NEXTERA ENERGY INC	103,333	85.84	8,870,104.72	
NISOURCE INC	18,919	25.04	473,731.76	
NRG ENERGY INC	13,547	44.73	605,957.31	
P G & E CORPORATION	76,538	9.36	716,395.68	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	75.54	452,937.84	
PPL CORPORATION	39,561	29.78	1,178,126.58	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	63.32	1,724,266.92	
SEMPRA ENERGY	16,353	133.81	2,188,194.93	
SOUTHERN CO	55,686	67.18	3,740,985.48	
UGI CORPORATION	10,588	45.54	482,177.52	

	VISTRA CORP	25,777	18.90	487,185.30	
	WEC ENERGY GROUP INC	16,438	95.99	1,577,883.62	
	XCEL ENERGY INC	29,237	69.27	2,025,246.99	
	ADVANCED MICRO DEVICES	63,414	106.15	6,731,396.10	
	ANALOG DEVICES INC	28,000	168.81	4,726,680.00	
	APPLIED MATERIALS INC	47,402	135.00	6,399,270.00	
	BROADCOM INC	21,463	493.49	10,591,775.87	
	ENPHASE ENERGY INC	6,292	161.36	1,015,277.12	
	INTEL CORP	212,391	53.40	11,341,679.40	
	KLA CORPORATION	8,157	347.83	2,837,249.31	
	LAM RESEARCH CORP	7,291	593.61	4,328,010.51	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	41,180	61.25	2,522,275.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,352	155.97	2,238,481.44	
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,425	72.87	4,257,429.75	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	488.33	1,095,324.19	
	NVIDIA CORP	130,062	221.77	28,843,849.74	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	210.46	3,042,620.22	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	45.24	946,058.88	
	QORVO INC	6,042	178.96	1,081,276.32	
	QUALCOMM INC	59,483	141.58	8,421,603.14	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	177.43	1,553,754.51	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	275.95	726,852.30	
	TERADYNE INC	8,542	119.17	1,017,950.14	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,426	188.47	9,126,848.22	
	XILINX INC	12,876	154.17	1,985,092.92	
米ドル 小計		16,349,592		2,083,421,960.76 (228,718,062,852)	
カナダドル	CAMECO CORP	18,890	29.02	548,187.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,374	42.56	2,739,757.44	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	10.58	794,134.80	
	ENBRIDGE INC	107,703	50.73	5,463,773.19	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	34.08	443,005.92	
	INTER PIPELINE LTD	5,601	20.06	112,356.06	
	KEYERA CORP	11,374	30.64	348,499.36	
	PARKLAND CORP	7,666	36.64	280,882.24	

PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	38.93	1,067,110.23	
SUNCOR ENERGY INC	78,642	23.45	1,844,154.90	
TC ENERGY CORP	50,579	61.02	3,086,330.58	
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	13,447	71.73	964,553.31	
B2GOLD CORP	42,963	4.74	203,644.62	
BARRICK GOLD CORP	93,098	24.88	2,316,278.24	
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	72.95	478,770.85	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	24.25	768,046.00	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	180.68	1,836,612.20	
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	9.31	304,418.38	
KINROSS GOLD CORP	63,501	7.43	471,812.43	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	13,385	52.14	697,893.90	
LUNDIN MINING CORP	28,209	9.68	273,063.12	
NUTRIEN LTD	29,898	79.27	2,370,014.46	
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	32.43	381,474.09	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	30.92	767,248.88	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	100.90	447,794.20	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	57.01	1,387,338.35	
YAMANA GOLD INC	53,588	5.34	286,159.92	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	19.86	337,778.88	
CAE INC	12,891	38.65	498,237.15	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	106.18	408,049.74	
WSP GLOBAL INC	6,141	163.58	1,004,544.78	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	46.57	461,648.41	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	81.22	460,273.74	
THOMSON REUTERS CORP	8,569	149.93	1,284,750.17	
AIR CANADA	12,083	24.06	290,716.98	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,544	151.93	5,552,129.92	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34,738	87.82	3,050,691.16	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	100.99	1,450,620.36	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	48.74	441,876.84	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	81.53	1,183,000.30	
QUEBECOR INC -CL B	9,953	31.43	312,822.79	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	36.50	993,968.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,001	192.66	578,172.66	

DOLLARAMA INC	17,025	55.69	948,122.25	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	44,270	50.45	2,233,421.50	
EMPIRE CO LTD A	9,148	38.85	355,399.80	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	91.29	792,671.07	
METRO INC	13,109	63.49	832,290.41	
WESTON (GEORGE) LTD	3,578	136.89	489,792.42	
SAPUTO INC	13,425	34.20	459,135.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	36.17	594,887.99	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	19.90	223,894.90	
BANK OF MONTREAL	33,057	128.27	4,240,221.39	
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	78.15	4,947,442.05	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	146.64	3,447,946.32	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	97.50	1,656,817.50	
ROYAL BANK OF CANADA	75,056	129.84	9,745,271.04	
TORONTO-DOMINION BANK	95,838	82.49	7,905,676.62	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,755	70.74	4,651,508.70	
IGM FINANCIAL INC	4,949	47.11	233,147.39	
ONEX CORPORATION	4,217	89.55	377,632.35	
TMX GROUP LTD	3,142	139.61	438,654.62	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	561.60	782,308.80	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	38.96	553,232.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	71.91	348,835.41	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	8,634	173.54	1,498,344.36	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	24.59	2,454,327.90	
POWER CORP OF CANADA	31,768	43.47	1,380,954.96	
SUN LIFE FINANCIAL INC	30,550	65.54	2,002,247.00	
FIRSTSERVICE CORP	1,820	237.52	432,286.40	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	13.58	352,984.94	
CGI INC-CL A	11,493	115.17	1,323,648.81	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	2,204.35	2,261,663.10	
LIGHTSPEED COMMERCE INC-SUB VOTE	6,363	157.01	999,054.63	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	3,084	160.98	496,462.32	
OPEN TEXT CORPORATION	13,665	68.01	929,356.65	
SHOPIFY INC-CLASS A	5,895	1,901.82	11,211,228.90	
BCE INC	5,509	66.71	367,505.39	

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,236	61.89	1,128,626.04	
	TELUS CORPORATION	15,222	29.45	448,287.90	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	19.67	616,831.53	
	ALTAGAS LTD	17,347	26.13	453,277.11	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	41.44	125,563.20	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	55.60	352,281.60	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	35.26	258,949.44	
	EMERA INC	14,279	59.50	849,600.50	
	FORTIS INC	24,171	58.18	1,406,268.78	
	HYDRO ONE LTD	18,821	31.40	590,979.40	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	41.90	455,453.00	
カナダドル 小計		2,126,191		127,647,090.74 (11,065,726,296)	
ユーロ	ENI SPA	136,972	10.58	1,449,985.59	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	29,687	8.23	244,561.50	
	NESTE OYJ	21,427	53.46	1,145,487.42	
	OMV AG	8,389	47.09	395,038.01	
	REPSOL SA	79,358	9.36	742,870.23	
	TENARIS S.A.	25,963	8.33	216,479.49	
	TOTALENERGIES SE	129,116	36.94	4,770,190.62	
	VOPAK	3,130	35.32	110,551.60	
	AIR LIQUIDE SA	25,183	150.22	3,782,990.26	
	AKZO NOBEL	9,886	100.45	993,048.70	
	ARCELORMITTAL	36,689	27.93	1,024,907.21	
	ARKEMA	3,250	115.00	373,750.00	
	BASF SE	47,459	64.63	3,067,275.17	
	COVESTRO AG	9,346	58.68	548,423.28	
	CRH PLC	40,255	43.63	1,756,325.65	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	27.96	306,217.92	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.04	145,044.80	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	69.44	602,530.88	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,422	180.30	1,698,786.60	
	LANXESS	4,409	64.26	283,322.34	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	48.73	629,640.33	
	SOLVAY SA	3,758	110.10	413,755.80	

STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	16.90	510,954.60	
SYMRISE AG	6,524	121.25	791,035.00	
UMICORE	10,288	53.60	551,436.80	
UPM-KYMMENE OYJ	28,055	34.53	968,739.15	
VOESTALPINE AG	6,056	36.74	222,497.44	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,931	22.91	296,249.21	
AIRBUS SE	30,165	115.20	3,475,008.00	
ALSTOM RGPT	17,665	32.64	576,585.60	
BOUYGUES SA	11,049	36.30	401,078.70	
BRENNTAG SE	7,392	85.46	631,720.32	
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	13.51	740,010.25	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	26,413	61.33	1,619,909.29	
DASSAULT AVIATION SA	172	928.00	159,616.00	
EIFFAGE SA	4,989	89.46	446,315.94	
FERROVIAL SA	24,413	25.01	610,569.13	
GEA GROUP AG	8,178	40.49	331,127.22	
KINGSPAN GROUP PLC	8,084	95.22	769,758.48	
KION GROUP AG	3,179	88.76	282,168.04	
KNORR-BREMSE AG	3,881	103.70	402,459.70	
KONE OYJ-B	17,618	67.20	1,183,929.60	
LEGRAND SA	13,323	96.92	1,291,265.16	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	189.75	561,090.75	
PRYSMIAN SPA	12,526	32.63	408,723.38	
RATIONAL AG	350	932.40	326,340.00	
SAFRAN SA	18,212	104.82	1,908,981.84	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,924	151.70	4,236,070.80	
SIEMENS AG-REG	39,550	143.34	5,669,097.00	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	22.92	455,076.60	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	23.18	266,152.76	
THALES SA	5,403	84.10	454,392.30	
VINCI S.A.	27,327	90.00	2,459,430.00	
WARTSILA OYJ-B SHARES	26,753	11.70	313,010.10	
BUREAU VERITAS SA	17,817	28.40	506,002.80	
RANDSTAD NV	6,241	60.66	378,579.06	
TELEPERFORMANCE	2,970	379.90	1,128,303.00	

WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	96.70	1,409,692.60	
AENA SME SA	4,377	133.05	582,359.85	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	98.22	132,204.12	
ATLANTIA SPA	26,501	15.79	418,583.29	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	8.13	134,829.49	
DEUTSCHE POST AG-REG	51,345	58.07	2,981,604.15	
GETLINK	22,311	13.93	310,903.78	
INPOST SA	10,902	15.14	165,056.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	78.64	1,405,532.72	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,564	65.20	167,172.80	
CONTINENTAL AG	5,578	107.00	596,846.00	
DAIMLER AG	44,402	68.50	3,041,537.00	
FAURECIA	6,090	38.22	232,759.80	
FERRARI NV	6,452	187.25	1,208,137.00	
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	136.85	1,196,890.10	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	86.12	668,721.80	
RENAULT SA	8,830	29.35	259,160.50	
STELLANTIS NV	105,516	16.68	1,760,851.00	
VALEO SA	14,444	22.19	320,512.36	
VOLKSWAGEN AG	1,960	278.80	546,448.00	
VOLKSWAGEN AG PFD	9,776	196.48	1,920,788.48	
ADIDAS AG	10,146	297.75	3,020,971.50	
ESSILORLUXOTTICA	14,521	170.38	2,474,087.98	
HERMES INTERNATIONAL	1,676	1,289.50	2,161,202.00	
KERING	3,906	696.00	2,718,576.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,578	658.40	9,598,155.20	
MONCLER SPA	10,437	55.18	575,913.66	
PUMA SE	5,052	105.00	530,460.00	
SEB SA	1,127	135.70	152,933.90	
ACCOR SA	10,451	28.79	300,884.29	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,869	169.70	1,505,069.30	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	44.66	258,358.10	
SODEXO	3,900	70.86	276,354.00	
BOLLORE	39,433	5.10	201,108.30	
PUBLICIS GROUPE	10,736	56.26	604,007.36	

SCOUT24 AG	4,671	70.66	330,052.86	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	4,745	55.44	263,062.80	
VIVENDI SE	38,496	32.75	1,260,744.00	
DELIVERY HERO SE	8,061	131.40	1,059,215.40	
HELLOFRESH AG	8,096	91.04	737,059.84	
INDITEX	55,025	29.46	1,621,036.50	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	80.29	747,259.03	
PROSUS NV	48,717	74.38	3,623,570.46	
ZALANDO SE	12,367	97.48	1,205,535.16	
CARREFOUR SA	35,990	15.52	558,744.75	
COLRUYT NV	2,164	47.61	103,028.04	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,458	17.86	204,639.88	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	33.33	446,688.66	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	55,657	28.27	1,573,423.39	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,567	48.92	1,935,815.47	
DANONE	34,300	60.11	2,061,773.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	11.85	332,188.95	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	75.90	468,151.20	
HEINEKEN NV	13,143	89.56	1,177,087.08	
JDE PEET'S BV	2,166	28.82	62,424.12	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	125.70	1,029,860.10	
PERNOD-RICARD SA	11,108	187.65	2,084,416.20	
REMY COINTREAU	1,273	169.30	215,518.90	
BEIERSDORF AG	5,138	105.00	539,490.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	73.30	437,894.20	
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	79.40	718,014.20	
L'OREAL	12,964	397.70	5,155,782.80	
AMPLIFON SPA	7,567	43.23	327,121.41	
BIOMERIEUX	1,570	110.45	173,406.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,924	196.45	377,969.80	
DIASORIN SPA	1,313	205.60	269,952.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	64.90	721,558.20	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	42.41	906,004.83	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,760	40.11	1,915,892.40	
ORPEA	2,695	106.65	287,421.75	

SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	587.80	768,842.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	57.30	812,628.60	
ARGENX SE	2,644	283.00	748,252.00	
BAYER AG	51,733	45.53	2,355,662.15	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	124.12	870,081.20	
GRIFOLS S.A.	15,169	20.55	311,722.95	
IPSEN	1,498	81.42	121,967.16	
MERCK KGAA	6,832	203.70	1,391,678.40	
ORION OYJ	4,159	34.41	143,111.19	
QIAGEN N.V.	12,543	47.05	590,148.15	
RECORDATI SPA	4,578	53.30	244,007.40	
SANOFI	59,771	83.31	4,979,522.01	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	543.80	845,609.00	
UCB SA	6,623	92.68	613,819.64	
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	11.81	223,397.96	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	5.51	1,945,124.16	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	893,341	3.06	2,735,410.14	
BNP PARIBAS	58,640	53.74	3,151,313.60	
CAIXABANK	218,103	2.62	571,429.86	
COMMERZBANK AG	46,644	5.49	256,075.56	
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	12.10	703,842.84	
ERSTE GROUP BANK AG	14,968	34.84	521,485.12	
FINECOBANK SPA	32,034	15.37	492,362.58	
ING GROEP NV-CVA	205,237	11.69	2,400,451.95	
INTESA SANPAOLO	852,114	2.37	2,020,788.35	
KBC GROUPE SA	13,092	71.90	941,314.80	
MEDIOBANCA SPA	31,303	9.83	307,833.70	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,066	21.38	151,071.08	
SOCIETE GENERALE	41,025	26.42	1,083,880.50	
UNICREDIT SPA	112,845	10.88	1,228,430.67	
AMUNDI SA	3,955	80.10	316,795.50	
DEUTSCHE BANK AG -REG	113,478	10.84	1,230,555.43	
DEUTSCHE BOERSE AG	9,700	144.45	1,401,165.00	
EURAZEO	1,792	85.75	153,664.00	

EXOR NV	6,204	68.54	425,222.16	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	96.10	568,335.40	
SOFINA	804	365.00	293,460.00	
WENDEL	1,082	120.40	130,272.80	
AEGON NV	91,609	4.14	379,444.47	
AGEAS	8,765	41.34	362,345.10	
ALLIANZ SE-REG	21,783	194.18	4,229,822.94	
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	17.74	1,016,841.73	
AXA SA	100,473	23.35	2,346,044.55	
CNP ASSURANCES	8,978	14.17	127,263.15	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	159.70	488,362.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,364	244.90	1,803,443.60	
NN GROUP NV	14,069	43.94	618,191.86	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	11.46	304,400.52	
SAMPO OYJ-A SHS	26,020	43.72	1,137,594.40	
SCOR SE	10,907	26.59	290,017.13	
AROUNDTOWN SA	52,560	6.25	328,500.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,590	52.70	926,993.00	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	128.35	472,328.00	
VONOVIA SE	29,304	53.30	1,561,903.20	
ADYEN NV	1,013	2,674.00	2,708,762.00	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	53.24	1,308,106.80	
ATOS SE	4,592	42.40	194,700.80	
BECHTLE AG	4,305	62.78	270,267.90	
CAPGEMINI SA	7,966	189.50	1,509,557.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	35,115	49.11	1,724,497.65	
EDENRED	12,139	47.05	571,139.95	
NEMETSCHEK SE	3,011	85.94	258,765.34	
NEXI SPA	20,612	17.91	369,160.92	
SAP SE	55,037	123.28	6,784,961.36	
TEAMVIEWER AG	9,059	29.62	268,327.58	
WORLDLINE SA	12,774	71.30	910,786.20	
NOKIA OYJ	280,161	5.07	1,420,416.27	
CELLNEX TELECOM SA	27,081	58.64	1,588,029.84	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	171,299	17.73	3,037,473.86	

	ELISA OYJ	8,681	54.50	473,114.50	
	ILIAD SA	1,016	182.00	184,912.00	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.00	158,040.00	
	KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.79	484,699.57	
	ORANGE S.A.	106,132	9.46	1,004,539.38	
	PROXIMUS SA	4,617	16.95	78,258.15	
	TELECOM ITALIA SPA	390,536	0.36	144,224.94	
	TELECOM ITALIA-RNC	378,308	0.39	150,604.41	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.43	113,954.85	
	TELEFONICA S.A.	274,278	4.17	1,144,973.51	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	36.54	192,529.26	
	E.ON SE	116,681	11.10	1,296,092.54	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,791	22.00	325,402.00	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.68	683,588.35	
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	20,779	10.82	224,932.67	
	ELIA GROUP SA/NV	2,063	106.10	218,884.30	
	ENAGAS	14,471	18.92	273,791.32	
	ENDESA S.A.	14,104	20.32	286,593.28	
	ENEL SPA	431,652	7.53	3,250,339.56	
	ENGIE	94,886	12.00	1,139,011.54	
	FORTUM OYJ	24,312	26.41	642,079.92	
	IBERDROLA SA	302,073	10.27	3,103,800.07	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	21.69	334,871.91	
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	17.09	403,870.88	
	RWE AG	34,673	33.04	1,145,595.92	
	SNAM SPA	106,707	4.96	529,906.96	
	SUEZ	18,986	19.63	372,695.18	
	TERNA SPA	70,562	6.63	467,967.18	
	UNIPER SE	4,697	35.62	167,307.14	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	29.00	828,269.00	
	VERBUND AG	3,190	93.90	299,541.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,455	352.00	864,160.00	
	ASML HOLDING NV	21,953	721.40	15,836,894.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	66,553	36.71	2,443,493.39	
	STMICROELECTRONICS NV	37,804	37.61	1,421,997.46	

ユーロ 小計		9,961,070		256,867,345.34 (33,343,950,098)	
英ポンド	BP PLC	1,079,142	2.94	3,180,231.47	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,867	14.17	3,018,028.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,653	14.18	2,676,608.76	
	ANGLO AMERICAN PLC	66,935	30.28	2,026,791.80	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	13.99	272,048.80	
	BHP GROUP PLC	110,160	20.49	2,257,729.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	91.86	719,998.68	
	EVRAZ PLC	28,275	5.85	165,578.40	
	GLENCORE PLC	539,565	3.32	1,792,165.14	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	28.36	285,698.64	
	MONDI PLC	25,128	20.05	503,816.40	
	RIO TINTO PLC	57,926	51.63	2,990,719.38	
	ASHTEAD GROUP PLC	23,686	57.46	1,360,997.56	
	BAE SYSTEMS PLC	165,753	5.56	921,586.68	
	BUNZL PLC	17,064	25.68	438,203.52	
	DCC PLC	5,954	61.40	365,575.60	
	FERGUSON PLC	12,017	105.75	1,270,797.75	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.78	395,537.77	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	389,579	1.11	432,510.60	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	14.36	349,938.84	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	163.85	603,787.25	
	EXPERIAN PLC	48,895	32.52	1,590,065.40	
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	53.40	437,025.60	
	RELX PLC	100,974	21.86	2,207,291.64	
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.87	532,264.65	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	6.90	322,468.76	
	BURBERRY GROUP PLC	19,012	19.14	363,984.74	
	PERSIMMON PLC	16,916	27.40	463,498.40	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.69	381,356.51	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,637	45.57	302,448.09	
	COMPASS GROUP PLC	93,018	14.38	1,337,598.84	
	ENTAIN PLC	28,865	19.21	554,640.97	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,587	45.97	440,714.39	

WHITBREAD PLC	11,282	32.92	371,403.44	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	6.36	279,811.16	
INFORMA PLC	78,152	5.30	414,830.81	
PEARSON PLC	39,623	7.60	301,293.29	
WPP PLC	63,987	9.77	625,536.91	
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	10.33	298,268.10	
KINGFISHER PLC	109,678	3.50	384,640.74	
NEXT PLC	6,860	78.78	540,430.80	
OCADO GROUP PLC	27,379	19.11	523,212.69	
SAINSBURY (J) PLC	67,872	2.96	201,511.96	
TESCO PLC	399,930	2.54	1,018,421.74	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	2.91	426,275.02	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	19.30	323,680.30	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	114,393	26.63	3,046,285.59	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.82	216,033.28	
DIAGEO PLC	120,446	34.87	4,199,952.02	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	15.27	763,795.82	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	57.07	2,133,561.95	
UNILEVER PLC	138,458	39.65	5,490,551.99	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	13.60	603,449.77	
ASTRAZENECA PLC	80,659	82.04	6,617,264.36	
GLAXOSMITHKLINE PLC	266,528	14.26	3,802,821.50	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	25.20	191,041.20	
BARCLAYS PLC	904,741	1.81	1,644,276.29	
HSBC HOLDINGS PLC	1,044,428	3.76	3,931,749.20	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,817,021	0.42	1,622,424.77	
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.08	660,723.54	
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.43	649,851.47	
3I GROUP PLC	49,338	13.08	645,341.04	
ABRDN PLC	123,263	2.57	317,402.22	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	14.46	283,011.12	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,716	80.92	1,433,578.72	
M&G PLC	133,064	2.01	268,656.21	
SCHRODERS PLC	6,213	37.91	235,534.83	

	ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	16.38	428,582.44	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	34.74	400,725.90	
	AVIVA PLC	198,601	4.04	804,135.44	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.04	192,715.00	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.74	861,560.83	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.31	232,750.91	
	PRUDENTIAL PLC	130,604	14.84	1,938,816.38	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	40.85	246,611.45	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.40	414,639.72	
	HALMA PLC	19,839	30.59	606,875.01	
	BT GROUP PLC	469,907	1.61	757,490.08	
	VODAFONE GROUP PLC	1,422,998	1.18	1,691,660.02	
	NATIONAL GRID PLC	191,851	9.43	1,809,154.93	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	28.10	348,945.80	
	SSE PLC	55,879	16.18	904,401.61	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	10.48	348,175.39	
英ポンド 小計		15,444,781		91,415,612.71 (13,890,602,351)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	19.08	192,777.58	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	983.50	350,126.00	
	GIVAUDAN-REG	484	4,537.00	2,195,908.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	47.83	1,302,841.37	
	SIKA AG	7,399	324.70	2,402,455.30	
	ABB LTD	90,836	33.59	3,051,181.24	
	GEBERIT AG-REG	1,986	762.60	1,514,523.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	275.60	259,339.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	287.80	613,589.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	50.44	459,911.92	
	SGS SA	308	2,861.00	881,188.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,618	345.20	903,733.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	26,754	104.80	2,803,819.20	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,716	266.30	456,970.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	51.55	129,699.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	183	2,292.00	419,436.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	10,630.00	627,170.00	

	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	109,000.00	545,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	150,863	114.82	17,322,089.66	
	ALCON INC	26,585	77.42	2,058,210.70	
	SONOVA HOLDING AG	2,660	359.60	956,536.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,796.50	953,941.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	771.60	3,074,054.40	
	NOVARTIS AG-REG SHS	116,665	79.78	9,307,533.70	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	1,436	394.20	566,071.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,777	348.00	12,798,396.00	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	130.70	344,786.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	75.50	118,535.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	126,713	9.78	1,240,013.41	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	63.28	794,164.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,581.50	1,902,544.50	
	UBS GROUP AG	191,189	15.23	2,912,764.41	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	144.70	358,132.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,834	476.40	873,717.60	
	SWISS RE AG	15,168	82.58	1,252,573.44	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,733	399.70	3,090,880.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	95.10	371,460.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,743	138.85	519,715.55	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,150	92.86	756,809.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	534.80	748,185.20	
スイスフラン 小計		904,523		81,430,786.68 (9,752,151,012)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	262.90	2,255,944.90	
	BOLIDEN AB	13,086	294.40	3,852,518.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	34,370	150.30	5,165,811.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	343.80	6,428,028.60	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	279.60	14,572,472.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	590.40	20,329,833.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	497.30	9,840,075.10	
	EPIROC AB-A	34,230	191.65	6,560,179.50	
	EPIROC AB-B	19,836	163.55	3,244,177.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	300.30	2,469,366.90	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	73,764	124.85	9,209,435.40	
	SANDVIK AB	61,070	219.30	13,392,651.00	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	242.20	4,161,722.60	
	SKF AB-B SHARES	20,607	212.40	4,376,926.80	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	191.90	2,549,007.70	
	VOLVO AB-B SHS	71,792	189.00	13,568,688.00	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	141.25	2,277,373.75	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,555	212.20	2,451,971.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	114.55	2,129,828.15	
	EVOLUTION AB	9,021	1,472.40	13,282,520.40	
	EMBRACER GROUP AB	15,006	194.65	2,920,917.90	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	173.10	6,949,618.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,614	420.40	2,360,125.60	
	SWEDISH MATCH AB	84,640	80.00	6,771,200.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,942	273.10	8,177,160.20	
	NORDEA BANK ABP	167,942	105.20	17,667,498.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	121.05	10,690,772.85	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	97.82	7,597,483.76	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	170.42	7,825,856.82	
	EQT AB	12,365	395.80	4,894,067.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,396	305.00	1,035,780.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	290.50	3,091,501.00	
	INVESTOR AB-B SHS	94,456	202.80	19,155,676.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	12,465	339.80	4,235,607.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	540.20	1,819,393.60	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	585.00	3,113,955.00	
	SINCH AB	27,690	190.95	5,287,405.50	
	ERICSSON LM-B SHS	146,984	102.68	15,092,317.12	
	HEXAGON AB-B SHS	103,110	149.30	15,394,323.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	129.95	3,318,533.15	
	TELIA CO AB	143,404	37.33	5,353,988.34	
スウェーデンクローナ 小計		1,700,292		294,871,714.84 (3,762,563,081)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	51,871	195.02	10,115,882.42	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	64.32	4,138,606.08	

	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	408.90	3,682,144.50	
	ADEVINTA ASA-B	15,540	170.45	2,648,793.00	
	SCHIBSTED ASA	3,338	456.80	1,524,798.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	405.40	2,221,592.00	
	MOWI ASA	23,318	232.60	5,423,766.80	
	ORKLA ASA	46,955	76.70	3,601,448.50	
	DNB BANK ASA	45,957	190.10	8,736,425.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	199.60	2,277,835.20	
	TELENOR ASA	34,937	150.80	5,268,499.60	
ノルウェークローネ 小計		312,157		49,639,792.20 (628,439,769)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	556.80	3,067,411.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	479.30	5,517,701.60	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S	513	3,244.00	1,664,172.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,440	252.40	13,235,856.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	18,450.00	3,099,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	311	19,520.00	6,070,720.00	
	DSV PANALPINA A S	10,310	1,635.00	16,856,850.00	
	PANDORA A/S	4,763	790.00	3,762,770.00	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,080.50	6,034,592.50	
	AMBU A/S-B	8,356	212.40	1,774,814.40	
	COLOPLAST-B	6,399	1,118.00	7,154,082.00	
	DEMANT A/S	4,455	358.80	1,598,454.00	
	GN STORE NORD A/S	6,484	491.40	3,186,237.60	
	GENMAB A/S	3,317	2,859.00	9,483,303.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	88,424	630.00	55,707,120.00	
	DANSKE BANK A/S	39,103	106.90	4,180,110.70	
	TRYG A/S	16,989	154.45	2,623,951.05	
	ORSTED A/S	9,555	943.40	9,014,187.00	
デンマーククローネ 小計		274,193		154,031,933.05 (2,689,397,551)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	10,927	27.03	295,356.81	
	OIL SEARCH LTD	105,618	3.65	385,505.70	
	SANTOS LTD	100,376	6.03	605,267.28	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	38.00	201,172.00	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	19.20	966,796.80	
BHP GROUP LTD	153,209	40.92	6,269,312.28	
BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	22.74	579,005.88	
EVOLUTION MINING LTD	84,420	3.78	319,107.60	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	88,448	17.81	1,575,258.88	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,266	52.12	1,160,503.92	
NEWCREST MINING LIMITED	42,131	23.89	1,006,509.59	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	9.10	599,180.40	
ORICA LIMITED	17,981	12.72	228,718.32	
RIO TINTO LIMITED	19,336	105.50	2,039,948.00	
SOUTH32 LTD	276,348	3.23	892,604.04	
REECE LTD	19,309	19.26	371,891.34	
BRAMBLES LIMITED	74,638	12.11	903,866.18	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.79	357,927.60	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	5.23	239,696.13	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	47.13	1,449,200.37	
CROWN RESORTS LTD	21,863	9.76	213,382.88	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,794	160.00	607,040.00	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	112,817	4.89	551,675.13	
REA GROUP LTD	2,833	155.29	439,936.57	
SEEK LIMITED	17,266	31.78	548,713.48	
WESFARMERS LIMITED	57,250	56.24	3,219,740.00	
COLES GROUP LIMITED	73,552	17.32	1,273,920.64	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	65,607	6.61	433,662.27	
WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	39.80	2,611,158.60	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	12.07	440,120.48	
COCHLEAR LIMITED	3,368	236.72	797,272.96	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	68.30	645,161.80	
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	41.63	1,009,860.54	
CSL LIMITED	23,602	305.50	7,210,411.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	148,002	27.51	4,071,535.02	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	93,409	100.55	9,392,274.95	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	173,185	28.40	4,918,454.00	
WESTPAC BANKING CORPORATION	189,179	25.60	4,842,982.40	
ASX LTD	11,180	82.86	926,374.80	

	MACQUARIE GROUP LTD	17,576	175.34	3,081,775.84	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	41.29	238,780.07	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	5.26	616,403.62	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.52	453,108.48	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	80,863	11.74	949,331.62	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	12.66	809,391.78	
	AFTERPAY LTD	11,491	126.50	1,453,611.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	16.59	463,972.53	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	47.68	377,101.12	
	XERO LTD	7,459	146.42	1,092,146.78	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.88	841,738.84	
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	6.16	200,150.72	
	AUSNET SERVICES	137,772	1.95	269,344.26	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	88,060	4.34	382,180.40	
オーストラリアドル 小計		3,409,822		75,829,544.20 (6,135,368,421)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.32	517,604.52	
	A2 MILK CO LTD	19,167	5.64	108,101.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	32.80	1,025,000.00	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	24,028	14.80	355,614.40	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	111,459	4.82	537,232.38	
	MERCURY NZ LTD	26,913	6.68	179,778.84	
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,872	5.18	351,576.96	
ニュージーランドドル 小計		351,400		3,074,908.98 (239,689,154)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	130,424	54.00	7,042,896.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	166.10	11,710,050.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	94,000	29.50	2,773,000.00	
	MTR CORPORATION	84,500	43.35	3,663,075.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS COMPANY LTD	70,000	34.25	2,397,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	53.25	6,283,500.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	26.65	3,091,400.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.37	589,600.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	9.56	676,848.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY COMPANY LTD	117,000	16.34	1,911,780.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	18.78	1,682,688.00	
	WH GROUP LIMITED	581,500	5.85	3,401,775.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	23.85	4,471,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	138.50	5,373,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,900	492.20	30,959,380.00	
	AIA GROUP LTD	635,000	93.35	59,277,250.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,924	47.95	4,935,205.80	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	23.70	2,417,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.10	1,773,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	34.15	2,847,563.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	35.95	3,049,746.35	
	SINO LAND CO	118,200	11.30	1,335,660.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	109.60	7,452,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	51.55	1,391,850.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	20.45	1,083,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	41.65	3,790,150.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	43.90	1,317,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	76.25	6,488,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	12.50	7,579,862.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	47.40	3,389,100.00	
香港ドル 小計		4,167,854		194,159,280.25 (2,741,529,037)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	54,700	5.15	281,705.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	108,600	3.77	409,422.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	4.91	382,813.06	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.78	255,450.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.13	426,216.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	90,300	30.24	2,730,672.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	181,200	11.60	2,101,920.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	25.45	1,646,615.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	10.17	435,276.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	4.00	546,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	6.61	170,538.00	
	UOL GROUP LIMITED	17,200	6.97	119,884.00	
	VENTURE CORP LTD	8,700	18.52	161,124.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	384,515	2.37	911,300.55	
シンガポールドル 小計		1,623,781		10,579,335.61 (864,860,686)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	22.48	645,423.28	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	473.80	658,108.20	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	28.49	1,891,821.47	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	27.30	1,915,095.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	17.47	955,154.78	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	107.50	994,267.50	
	AZRIELI GROUP	2,140	306.40	655,696.00	
	NICE LTD	3,251	956.00	3,107,956.00	
イスラエルシュケル 小計		235,967		10,823,522.23 (370,707,801)	
合　計		56,861,623		314,203,048,109 (314,203,048,109)	

（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	70.0%	72.8%
カナダドル	株式　89銘柄	3.4%	3.5%
ユーロ	株式　232銘柄	10.2%	10.6%
英ポンド	株式　84銘柄	4.2%	4.4%
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%
イスラエルシュケル	株式　8銘柄	0.1%	0.1%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	407,420.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	7,662	1,550,865.42	
		AMERICAN TOWER CORP	23,731	7,043,835.42	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,936	555,202.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	1,659,744.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	872,819.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	737,849.04	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	22,634	4,356,139.64	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,126	2,388,092.88	
		DUKE REALTY CORP	17,601	904,339.38	
		EQUINIX INC	4,655	3,977,976.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	737,999.52	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,773	1,548,209.31	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	1,093,895.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376	1,380,344.64	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	1,024,001.16	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	604,485.21	
		INVITATION HOMES INC	27,735	1,139,908.50	
		IRON MOUNTAIN INC	14,204	679,235.28	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	686,858.48	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	1,108,950.80	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,364	348,230.40	
		PROLOGIS INC	38,138	5,137,951.36	
		PUBLIC STORAGE	8,249	2,674,078.33	
		REALTY INCOME CORPORATION	20,646	1,438,406.82	
		REGENCY CENTERS CORP	8,289	566,967.60	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	2,127,689.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	17,345	2,265,950.80	
		SUN COMMUNITIES INC	6,088	1,242,317.28	
		UDR INC	16,633	890,863.48	
		VENTAS INC	19,379	1,089,099.80	
		VEREIT INC	10,854	530,652.06	
		VICI PROPERTIES INC	27,615	825,136.20	

	VORNADO REALTY TRUST	8,706	360,515.46	
	WELLTOWER INC	21,015	1,809,601.65	
	WEYERHAEUSER CO	38,940	1,357,837.80	
	WP CAREY INC	8,640	669,772.80	
米ドル 小計		652,722	57,793,244.76 (6,344,542,409)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	246,678.52	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	168,389.83	
カナダドル 小計		11,412	415,068.35 (35,982,275)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	180,867.12	
	GECINA SA	2,189	277,455.75	
	KLEPIERRE	13,600	269,620.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,024	484,796.48	
ユーロ 小計		25,201	1,212,739.35 (157,425,695)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	235,241.18	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	282,295.60	
	SEGRO PLC	59,874	764,291.61	
英ポンド 小計		144,697	1,281,828.39 (194,773,823)	
オーストラリアドル	APA GROUP	55,644	509,142.60	
	DEXUS	54,256	579,454.08	
	GOODMAN GROUP	86,301	1,947,813.57	
	GPT GROUP	121,221	601,256.16	
	LENDLEASE GROUP	36,263	405,057.71	
	MIRVAC GROUP	200,053	598,158.47	
	SCENTRE GROUP	275,200	776,064.00	
	STOCKLAND	127,393	577,090.29	
	SYDNEY AIRPORT	62,186	496,244.28	
	TRANSURBAN GROUP	145,337	2,046,344.96	
	VICINITY CENTRES	167,788	286,078.54	
オーストラリアドル 小計		1,331,642	8,822,704.66 (713,845,034)	

	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	193,500	1,489,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,096,080.00	
		LINK REIT	110,100	7,695,990.00	
	香港ドル 小計		500,600	11,282,020.00 (159,302,122)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	170,500	518,320.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	238,488	481,745.76	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400	228,172.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100	426,605.00	
	シンガポールドル 小計		729,488	1,654,842.76 (135,283,395)	
合計				7,741,154,753 (7,741,154,753)	

（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%	82.0%
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%	9.2%
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%	1.7%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 9月10日現在）	（2021年 9月10日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	370,718,639	470,155,265
金銭信託	-	687,797,401
コール・ローン	1,860,156,953	1,332,614,183
株式	6,087,382,618	10,258,945,460
投資信託受益証券	657,870,238	597,223,100
投資証券	205,834,910	1,156,670,380
派生商品評価勘定	214,083,566	9,218,227
未収入金	2,257,991	11,344,215
未収配当金	6,842,765	16,572,170
前払金	-	109,080,702
差入委託証拠金	922,777,044	783,816,283
流動資産合計	10,327,924,724	15,433,437,386
資産合計	10,327,924,724	15,433,437,386
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,153,550	118,872,862
前受金	208,499,237	-
未払金	25,322,599	11,288,030
未払解約金	210,115	2,000,000
未払利息	5,439	2,939
その他未払費用	35,221	52,052
流動負債合計	235,226,161	132,215,883
負債合計	235,226,161	132,215,883
純資産の部		
元本等		
元本	7,337,581,576	8,888,051,553
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,755,116,987	6,413,169,950
元本等合計	10,092,698,563	15,301,221,503
純資産合計	10,092,698,563	15,301,221,503
負債純資産合計	10,327,924,724	15,433,437,386

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日

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

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	7,337,581,576口	8,888,051,553口
２．1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3755円 (10,000口当たりの純資産額 13,755円)	1口当たり純資産額 1.7215円 (10,000口当たりの純資産額 17,215円)

（金融商品に関する注記）
Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、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。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,947,067,527	-	3,155,566,764	208,499,237
	MSCIE 2009	2,947,067,527	-	3,155,566,764	208,499,237
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,838,600,000	-	1,843,030,779	4,430,779
	米ドル	1,838,600,000	-	1,843,030,779	4,430,779
合計		4,785,667,527	-	4,998,597,543	212,930,016

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,384,270,395	-	3,275,189,693	△109,080,702
	MSCIE 2109	3,384,270,395	-	3,275,189,693	△109,080,702
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,018,400,000	-	2,017,826,067	△573,933
	米ドル	2,018,400,000	-	2,017,826,067	△573,933
合計		5,402,670,395	-	5,293,015,760	△109,654,635

（注）１．時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2)為替予約取引の時価の算定方法について

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

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

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

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,337,581,576円
同期中における追加設定元本額	4,294,504,179円
同期中における一部解約元本額	2,744,034,202円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	5,047,718,540円
三井住友・ＤＣ新興国株式インデックスファンド	2,439,575,264円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	113,631,478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	58,243,277円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,294,170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	611,846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＞	35,959,788円
合計	8,888,051,553円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	YPF S.A.-SPONSORED ADR	2,632	5.26	13,844.32	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	2,909	7.25	21,090.25	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	1,088	60.19	65,486.72	
	51JOB INC-ADR	358	73.73	26,395.34	
	DIDI GLOBAL INC	4,100	9.00	36,900.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,820	31.00	180,420.00	
	LI AUTO INC - ADR	7,234	30.62	221,505.08	
	NIO INC-ADR	18,231	38.45	700,981.95	
	XPENG INC - ADR	5,176	39.37	203,779.12	
	GAOTU TECHEDU INC- ADR	1,659	2.85	4,728.15	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,407	51.36	123,623.52	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	20,808	2.25	46,818.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	5,571	5.40	30,083.40	
	TRIP.COM GROUP-ADR	6,827	31.81	217,166.87	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,670	61.47	348,534.90	
	AUTOHOME INC-ADR	927	46.05	42,688.35	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,680	163.65	602,232.00	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,178	83.83	182,581.74	
	HELLO GROUP INC-SPON ADR	2,159	13.04	28,153.36	
	HUYA INC-ADR	1,153	9.93	11,449.29	
	IQIYI INC-ADR	3,643	9.78	35,628.54	
	JOYY INC	758	65.50	49,649.00	
	NETEASE.COM INC -ADR	5,421	88.91	481,981.11	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,009	8.71	78,468.39	
	WEIBO CORP-SPON ADR	841	53.67	45,136.47	

	BAOZUN INC-SPN-ADR	838	22.58	18,922.04	
	DADA NEXUS LTD-ADR	799	26.01	20,781.99	
	JD.COM INC-ADR	11,657	80.26	935,590.82	
	PINDUODUO INC-ADR	5,914	104.28	616,711.92	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	6,030	15.04	90,691.20	
	ADECOAGRO SA	1,698	9.14	15,519.72	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,287	6.90	57,180.30	
	BEIGENE LTD-ADR	617	337.34	208,138.78	
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	588	20.06	11,795.28	
	HUTCHMED CHINA LTD-ADR	1,066	39.49	42,096.34	
	I-MAB-SPONSORED ADR	471	77.27	36,394.17	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,053	136.99	144,250.47	
	CREDICORP LTD	911	104.19	94,917.09	
	360 DIGITECH INC	1,160	25.25	29,290.00	
	LUFAX HOLDING LTD	2,325	8.34	19,390.50	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	377	40.71	15,347.67	
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,071	13.38	14,329.98	
	KE HOLDINGS INC-ADR	4,909	20.32	99,750.88	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	14,880	0.92	13,734.24	
	21VIANET GROUP INC-ADR	1,166	21.52	25,092.32	
	AGORA INC-ADR	680	32.64	22,195.20	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,520	12.00	18,240.00	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	1,203	63.40	76,270.20	
	GLOBANT SA	530	325.32	172,419.60	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	608	33.79	20,544.32	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,578	4.54	7,164.12	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	787	63.13	49,683.31	
米ドル 小計		192,982		6,675,768.33 (732,865,847)	
メキシコペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV	43,200	85.89	3,710,448.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,695	265.20	449,514.00	
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	11,700	56.00	655,200.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,700	67.50	519,750.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	2,655	363.36	964,720.80	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,000	232.94	1,164,700.00	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	3,050	151.68	462,624.00	
	WAL-MART DE MIXICO SAB DE CV	71,100	72.07	5,124,177.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,000	123.44	864,080.00	
	BECLE SAB DE CV	6,000	49.78	298,680.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,465	228.70	563,745.50	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	19,600	50.08	981,568.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	17,600	33.71	593,296.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	34,700	126.11	4,376,017.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	28,200	18.01	507,882.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	459,500	18.70	8,592,650.00	
	TELESITES SAB DE CV	14,700	16.90	248,430.00	
メキシコペソ 小計		735,865		30,077,482.30 (165,660,757)	
ブラジルレアル	COSAN SA	12,688	22.19	281,546.72	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	49,800	26.09	1,299,282.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	63,800	25.50	1,626,900.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,600	14.56	154,336.00	
	BRADESPAR SA -PREF	2,900	60.19	174,551.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,600	67.08	174,408.00	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	8,500	34.20	290,700.00	
	GERDAU S.A.-PREF	16,400	27.41	449,524.00	
	SUZANO SA	10,615	62.25	660,783.75	
	VALE SA	53,100	94.70	5,028,570.00	
	WEG SA	22,460	38.84	872,346.40	
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	13,800	11.84	163,392.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	7,900	60.00	474,000.00	
	RUMO SA	15,600	18.56	289,536.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,100	56.53	118,713.00	
	AMERICANAS SA	5,275	40.85	215,483.75	
	LOJAS RENNER S.A.	12,780	35.81	457,651.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	41,000	18.85	772,850.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	15,680	25.14	394,195.20	
	VIA S/A	14,000	9.50	133,000.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	8,100	18.50	149,850.00	
	RAIA DROGASIL SA	14,300	25.84	369,512.00	

	AMBEV SA	65,400	16.31	1,066,674.00	
	BRF-BRASIL FOODS SA	9,900	23.43	231,957.00	
	JBS SA	11,800	32.33	381,494.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	12,100	50.63	612,623.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,000	14.86	252,620.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,700	81.95	549,065.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,400	70.81	382,374.00	
	HYPERMARCAS SA	6,000	34.80	208,800.00	
	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	65,806	21.20	1,395,087.20	
	BANCO BRADESCO SA	17,938	18.29	328,086.02	
	BANCO DO BRASIL S.A.	10,600	28.90	306,340.00	
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	64,900	29.10	1,888,590.00	
	ITAUSA SA	62,380	11.14	694,913.20	
	BM&F BOVESPA SA	82,000	13.63	1,117,660.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	8,600	18.82	161,852.00	
	TOTVS SA	6,600	37.92	250,272.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	6,900	42.23	291,387.00	
	TIM SA	11,100	11.99	133,089.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	3,800	36.37	138,206.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	3,100	36.68	113,708.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	13,946	13.37	186,458.02	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	7.06	77,660.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	3,900	34.28	133,692.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,400	27.86	66,864.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	39.19	99,934.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,200	24.98	279,776.00	
ブラジルレアル 小計		927,018		25,900,313.56 (546,222,072)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,818	7,100.10	41,308,381.80	
	EMPRESAS CMPC SA	13,085	1,641.00	21,472,485.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	1,830	42,650.00	78,049,500.00	
	FALABELLA SA	10,123	2,863.60	28,988,222.80	
	CENCOSUD SA	18,317	1,439.00	26,358,163.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	7,773.90	12,329,405.40	
	BANCO DE CHILE	608,640	75.45	45,921,888.00	

	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	640	31,643.00	20,251,520.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,002,990	39.50	39,618,105.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,523	1,056.90	5,837,258.70	
	COLBUN SA	124,112	128.00	15,886,336.00	
	ENEL AMERICAS SA	263,707	102.69	27,080,071.83	
	ENEL CHILE SA	364,877	37.25	13,591,668.25	
チリペソ 小計		2,421,248		376,693,005.78 (52,054,829)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	61,693	2,570.00	158,551,010.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,656	31,390.00	114,761,840.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,554	31,470.00	174,784,380.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	20,000.00	59,720,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,933	22,850.00	135,569,050.00	
コロンビアペソ 小計		79,822		643,386,280.00 (18,430,443)	
ユーロ	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	
	OPAP SA	2,776	13.04	36,199.04	
	JUMBO S.A.	1,451	13.20	19,153.20	
	ALPHA BANK AE	30,000	1.15	34,650.00	
	EUROBANK ERGASIAS SEEVICES & HOLDINGS SA	35,017	0.82	29,050.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,986	16.02	47,835.72	
ユーロ 小計		72,353		167,478.46 (21,740,378)	
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,504	104.30	156,867.20	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	19,752	18.07	356,918.64	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	15.33	129,569.16	
	KOC HOLDING AS	9,107	22.42	204,178.94	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	22,434	8.65	194,054.10	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	947	169.60	160,611.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,702	69.60	396,859.20	
	AKBANK T.A.S.	39,334	5.74	225,777.16	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	35,453	9.56	338,930.68	
	TURKIYE IS BANKASI-C	22,389	5.54	124,035.06	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	15,566	16.28	253,414.48	
		180,640		2,541,215.82	

トルコリラ 小計				(33,043,175)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	934	815.50	761,677.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	88.00	421,520.00	
	CEZ AS	2,068	681.50	1,409,342.00	
チェココルナ 小計		7,792		2,592,539.00 (13,231,541)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	5,818	2,400.00	13,963,200.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,803	8,735.00	15,749,205.00	
	OTP BANK PLC	2,983	18,750.00	55,931,250.00	
ハンガリーフォリント 小計		10,604		85,643,655.00 (31,708,021)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,209	74.60	313,991.40	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	21,226	6.19	131,431.39	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,813	175.95	318,997.35	
	LPP SA	15	14,050.00	210,750.00	
	CD PROJEKT SA	1,044	180.68	188,629.92	
	CYFROWY POLSAT SA	3,380	34.92	118,029.60	
	ALLEGRO.EU SA	4,840	64.88	314,019.20	
	DINO POLSKA SA	651	340.60	221,730.60	
	BANK PEKAO SA	2,279	104.10	237,243.90	
	PKO BANK POLSKI SA	11,801	43.00	507,443.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	565	300.30	169,669.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,749	40.94	358,184.06	
	ORANGE POLSKA SA	6,710	7.88	52,874.80	
	PGE SA	10,070	9.85	99,189.50	
ポーランドズロチ 小計		77,352		3,242,184.22 (92,590,296)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	26,000	7.16	186,160.00	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	338,000	3.80	1,284,400.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	46,000	18.46	849,160.00	
	PETROCHINA CO LTD	298,000	3.35	998,300.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	20,000	16.60	332,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	52,000	6.73	349,960.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	47.70	834,750.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	31,000	13.16	407,960.00	

CHINA MOLYBDENUM CO LTD	36,000	5.69	204,840.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	48,000	12.52	600,960.00	
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	38,000	8.38	318,440.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	3,400	160.70	546,380.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	12,000	16.78	201,360.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	14,000	16.36	229,040.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	13,000	7.45	96,850.00	
MMG LIMITED	32,000	3.92	125,440.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	21,000	11.26	236,460.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	6,250	13.96	87,250.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	10,000	6.61	66,100.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	76,000	11.22	852,720.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	26,000	6.00	156,000.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	59.50	208,250.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	4.11	82,200.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	21,000	33.30	699,300.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	15,000	15.00	225,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	45,000	4.50	202,500.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	34,000	7.29	247,860.00	
CITIC LIMITED	77,000	9.89	761,530.00	
FOSUN INTERNATIONAL	31,500	10.08	317,520.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	7,000	29.40	205,800.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	10.52	199,880.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	14.86	148,600.00	
WEICHAI POWER CO	24,000	19.60	470,400.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	10,418	16.34	170,230.12	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	6,600	40.50	267,300.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	8.34	108,420.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	53,000	5.88	311,640.00	
AIR CHINA/HONG KONG	32,000	5.52	176,640.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	20,000	4.89	97,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	16,140	13.30	214,662.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.70	112,800.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS COMPANY LIMITED	42,900	14.56	624,624.00	
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	24,000	6.11	146,640.00	

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	8.21	180,620.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	13,000	10.68	138,840.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	6.91	82,920.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	6.08	182,400.00	
BYD CO LTD-H	10,500	262.40	2,755,200.00	
DONGFENG MOTOR CORPORATION	32,000	8.58	274,560.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,200	45.95	422,740.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	79,000	27.10	2,140,900.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	41,500	32.50	1,348,750.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	39,200	8.46	331,632.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	29.45	294,500.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	14,000	13.42	187,880.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	14,000	161.60	2,262,400.00	
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	44,000	6.62	291,280.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	30,200	29.85	901,470.00	
LI NING COMPANY LIMITED	30,000	104.20	3,126,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,200	172.50	1,932,000.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	10,000	8.78	87,800.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	12,000	13.82	165,840.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	26,000	3.97	103,220.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	14,000	31.00	434,000.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9,000	25.95	233,550.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	15,200	18.56	282,112.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	0.84	92,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	5,400	68.40	369,360.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	3,700	92.40	341,880.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	77,100	480.00	37,008,000.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	203,300	161.00	32,731,300.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	40.80	326,400.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	198,000	0.81	160,380.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	36,000	3.32	119,520.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,700	74.50	350,150.00	
MEITUAN-B	54,000	248.60	13,424,400.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	21,000	10.02	210,420.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,500	66.70	566,950.00	

SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	4.05	99,225.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,500	104.68	157,020.00	
CHINA FEIHE LTD	50,000	13.60	680,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	43,000	47.70	2,051,100.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	20,000	62.75	1,255,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.32	84,240.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	4,400	39.30	172,920.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	24,000	44.00	1,056,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	13.70	356,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	65.35	522,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	13,000	7.37	95,810.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	67,000	5.40	361,800.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	6,000	45.50	273,000.00	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	8,000	43.45	347,600.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	22.75	91,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	52,000	12.66	658,320.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	13.22	264,400.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	47.45	427,050.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,100	56.50	344,650.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	36,000	12.88	463,680.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	16.32	125,664.00	
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	18,800	20.80	391,040.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,000	37.35	112,050.00	
3SBIO INC	17,000	8.59	146,030.00	
AKESO INC	4,000	42.75	171,000.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	297.20	297,200.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	17,000	15.26	259,420.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	120,800	9.70	1,171,760.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	4.06	48,720.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	42,000	3.76	157,920.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	16,000	35.85	573,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,400	153.40	214,760.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	21.15	380,700.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	16,000	61.00	976,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,000	176.60	353,200.00	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	7,500	48.00	360,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	145,000	6.62	959,900.00	
SSY GROUP LIMITED	10,000	4.58	45,800.00	
WUXI APPTEC CO LTD	4,411	163.20	719,875.20	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,000	119.80	5,750,400.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	340,000	2.72	924,800.00	
BANK OF CHINA LTD	1,071,000	2.77	2,966,670.00	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	108,000	4.60	496,800.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	27,500	3.21	88,275.00	
CHINA CITIC BANK	120,000	3.64	436,800.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,288,000	5.68	7,315,840.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	34,000	2.85	96,900.00	
CHINA MERCHANTS BANK- H	52,500	66.55	3,493,875.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	80,100	3.31	265,131.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	24,000	2.99	71,760.00	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	755,000	4.41	3,329,550.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	115,000	5.80	667,000.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	90,000	1.44	129,600.00	
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	10.36	82,880.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO	36,000	4.65	167,400.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	92,000	0.85	78,200.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	18,400	22.30	410,320.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	33,000	20.70	683,100.00	
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	8.83	247,240.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	15.32	260,440.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	42,800	7.16	306,448.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	24,600	12.44	306,024.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO.	100,000	13.22	1,322,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,000	23.85	810,900.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	22,200	12.14	269,508.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	11,400	23.75	270,750.00	
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	127,000	2.52	320,040.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	92,000	7.42	682,640.00	
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	85,500	59.60	5,095,800.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6,700	35.65	238,855.00	

A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	7,000	30.15	211,050.00	
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	12,000	7.43	89,160.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	18,000	4.20	75,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	27,000	3.55	95,850.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	62,000	2.47	153,140.00	
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	49,000	17.64	864,360.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	6.44	96,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	29.15	1,282,600.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	8,600	37.40	321,640.00	
CHINA VANKE CO LTD -H	22,100	20.60	455,260.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	10,000	14.56	145,600.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	4.94	207,480.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	99,000	8.28	819,720.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	21,000	59.70	1,253,700.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	12,500	11.42	142,750.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP	18,000	8.14	146,520.00	
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	26,800	5.73	153,564.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LIMITED	10,000	30.50	305,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	50,000	2.32	116,000.00	
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	12,500	7.22	90,250.00	
LOGAN GROUP COMPANY LIMITED	16,000	8.24	131,840.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,500	34.75	886,125.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	1,200	44.50	53,400.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	25,000	5.80	145,000.00	
SEAZEN GROUP LTD	32,000	6.73	215,360.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	42,000	2.25	94,500.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	15.70	290,450.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	16.84	168,400.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	33,000	18.16	599,280.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	17.40	174,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	17,000	26.45	449,650.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	17,600	7.31	128,656.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	4.28	59,920.00	
CHINA YOUZAN LTD	172,000	1.13	194,360.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	34,000	13.38	454,920.00	

	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	35,000	26.45	925,750.00	
	KINGSOFT CORPORATION LTD.	13,000	30.80	400,400.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	5,000	29.75	148,750.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	12,000	15.06	180,720.00	
	WEIMOB INC	21,000	12.38	259,980.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	9,000	41.00	369,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	8,500	34.50	293,250.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	10,000	38.40	384,000.00	
	KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	12,000	15.14	181,680.00	
	LENOVO GROUP LTD	102,000	8.15	831,300.00	
	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,600	233.00	2,236,800.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	192,200	23.60	4,535,920.00	
	ZTE CORPORATION	10,200	27.40	279,480.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	578,000	1.06	612,680.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	6,000	30.55	183,300.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	60,000	3.32	199,200.00	
	CGN POWER CO LTD-H	167,000	2.13	355,710.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	43,200	22.00	950,400.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	45,000	16.96	763,200.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	3.43	126,910.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	12,000	47.80	573,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	26,000	21.40	556,400.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,600	153.00	1,621,800.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	40,000	11.08	443,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	44,000	4.30	189,200.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	58,000	8.72	505,760.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	5,000	38.55	192,750.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	6,000	44.10	264,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	66,000	17.62	1,162,920.00	
香港ドル 小計		11,485,819		204,438,665.32 (2,886,673,954)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	48,600	2.69	130,734.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,000	19.70	59,100.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	34,800	8.08	281,184.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	39,200	5.82	228,144.00	

	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	8.83	71,523.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.34	110,214.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.53	95,991.00	
	MISC BHD	19,600	6.97	136,612.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	4.50	45,000.00	
	GENTING BHD	25,800	5.10	131,580.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	43,800	3.10	135,780.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	27.52	33,024.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	31,800	3.98	126,564.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	5,000	21.20	106,000.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	900	135.00	121,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	9,040	18.30	165,432.00	
	QL RESOURCES BHD	13,050	5.54	72,297.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,900	3.91	93,449.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,100	6.42	148,302.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	27,500	6.61	181,775.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	15,000	2.88	43,200.00	
	SUPERMAX CORP BHD	16,968	2.82	47,849.76	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	76,500	3.40	260,100.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	17,000	3.28	55,760.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	92,600	4.83	447,258.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.86	190,486.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	18.50	35,150.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	53,500	8.26	441,910.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	196,300	4.10	804,830.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.48	158,372.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,600	4.12	134,312.00	
	DIGI.COM BHD	38,800	4.48	173,824.00	
	MAXIS BERHAD	26,800	4.72	126,496.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	6.07	97,120.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,600	16.74	177,444.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	33,100	10.26	339,606.00	
マレーシアリンギット 小計		1,096,858		6,007,922.76 (159,021,304)	
タイバーツ	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	18,400	106.00	1,950,400.00	

PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	139,400	37.25	5,192,650.00	
THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	15,000	49.50	742,500.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	24,700	42.50	1,049,750.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	33,300	60.25	2,006,325.00	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	17,200	66.75	1,148,100.00	
SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	10,800	414.00	4,471,200.00	
AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	55,000	61.75	3,396,250.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	126,600	8.30	1,050,780.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	90,600	9.20	833,520.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	69,600	4.14	288,144.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	36,600	31.75	1,162,050.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,891	32.75	684,180.25	
HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	74,400	13.80	1,026,720.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	36,300	28.75	1,043,625.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	19,000	33.75	641,250.00	
CP ALL PCL-NVDR	81,100	62.00	5,028,200.00	
CARABAO GROUP PCL	5,400	127.50	688,500.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	53,100	26.25	1,393,875.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	16,200	35.00	567,000.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	31,900	21.60	689,040.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	127,700	22.50	2,873,250.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	5,400	130.00	702,000.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,000	36.00	468,000.00	
KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	11.00	321,200.00	
SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	12,700	104.50	1,327,150.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,000	18.50	333,000.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,300	63.25	904,475.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	60.50	459,800.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	68.25	805,350.00	
CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	25,200	51.50	1,297,800.00	
LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	108,900	7.95	865,755.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	4,500	744.00	3,348,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,000	191.00	3,056,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,400	84.75	1,220,400.00	
TRUE CORPORATION PCL-NVDR	150,000	3.40	510,000.00	

	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	43.00	292,400.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	3,800	177.50	674,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	20,800	66.00	1,372,800.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	9,600	80.25	770,400.00	
	GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	40,800	41.00	1,672,800.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	7,900	45.00	355,500.00	
タイバーツ 小計		1,623,891		58,684,639.25 (197,180,387)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	26,650	44.80	1,193,920.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	818.00	3,100,220.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	566.00	741,460.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,282	64.20	2,586,104.40	
	SM INVESTMENTS CORP	3,205	1,008.00	3,230,640.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,770	186.00	2,189,220.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	7,480	201.80	1,509,464.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,180	144.30	1,468,974.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	22,527	82.90	1,867,488.30	
	BDO UNIBANK INC	28,670	114.80	3,291,316.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	24,240	45.45	1,101,708.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.89	431,401.00	
	AYALA LAND INC	117,600	34.10	4,010,160.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	131,400	33.70	4,428,180.00	
	GLOBE TELECOM INC	335	2,790.00	934,650.00	
	PLDT INC	1,255	1,439.00	1,805,945.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,340	291.00	680,940.00	
フィリピンペソ 小計		543,934		34,571,790.70 (75,995,710)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	263,900	1,365.00	360,223,500.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	19,300	21,800.00	420,740,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	128,000	2,440.00	312,320,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	364,200	1,010.00	367,842,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	29,700	7,900.00	234,630,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	10,700.00	141,240,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	179,700	2,770.00	497,769,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	43,500	8,750.00	380,625,000.00	

	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	255,600	5,450.00	1,393,020,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	112,900	6,600.00	745,140,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	21,200	8,525.00	180,730,000.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	33,550.00	134,200,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	51,300	6,275.00	321,907,500.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	104,500	4,100.00	428,450,000.00	
	KALBE FARMA PT	246,100	1,490.00	366,689,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	103,700	5,400.00	559,980,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA-RIGHTS	167,073	414.00	69,168,222.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	149,600	32,850.00	4,914,360,000.00	
	PT BANK MANDIRI	265,600	6,350.00	1,686,560,000.00	
	PT BANK RAKYAT	726,000	3,730.00	2,707,980,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	283,900	1,390.00	394,621,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	692,700	3,390.00	2,348,253,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	3,000.00	356,700,000.00	
インドネシアルピア 小計		4,344,573		19,323,148,222.00 (148,788,241)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	628	41,500.00	26,062,000.00	
	S-OIL CORPORATION	553	96,700.00	53,475,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	682	247,000.00	168,454,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,476	41,800.00	61,696,800.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	1,044	52,400.00	54,705,600.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	97	506,000.00	49,082,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	227	200,500.00	45,513,500.00	
	LG CHEM LTD	614	748,000.00	459,272,000.00	
	LG CHEM LTD	89	355,500.00	31,639,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	207	248,500.00	51,439,500.00	
	POSCO	1,000	359,500.00	359,500,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	461	154,000.00	70,994,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	96	303,500.00	29,136,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	191	210,000.00	40,110,000.00	
	SKC CO LTD	281	165,000.00	46,365,000.00	
	CJ CORP	168	103,500.00	17,388,000.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	415	27,250.00	11,308,750.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	664	41,350.00	27,456,400.00	

DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION	3,599	20,900.00	75,219,100.00	
ECOPRO BM CO LTD	147	357,600.00	52,567,200.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	891	44,200.00	39,382,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	921	52,600.00	48,444,600.00	
HYUNDAI ENGINEERING&CON(1905451D)-RIGHTS	13	0.00	0.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	570	65,300.00	37,221,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	1,063	31,100.00	33,059,300.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	478	108,500.00	51,863,000.00	
LG CORP	1,117	93,500.00	104,439,500.00	
SAMSUNG C&T CORPORATION	1,079	127,500.00	137,572,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,075	22,500.00	46,687,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	6,668	6,100.00	40,674,800.00	
SK INC	453	260,500.00	118,006,500.00	
S1 CORPORATION	219	83,100.00	18,198,900.00	
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	169,500.00	12,543,000.00	
GLOVIS CO LTD	234	182,500.00	42,705,000.00	
HMM CO LTD	3,618	38,000.00	137,484,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,328	30,200.00	70,305,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	4,527	7,210.00	32,639,670.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	963	44,100.00	42,468,300.00	
HANON SYSTEMS	2,380	15,850.00	37,723,000.00	
HYUNDAI MOBIS	897	277,000.00	248,469,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,861	208,500.00	388,018,500.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	419	98,900.00	41,439,100.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	313	99,800.00	31,237,400.00	
KIA CORP	3,528	86,000.00	303,408,000.00	
COWAY CO LTD	746	77,300.00	57,665,800.00	
FILA HOLDINGS CORP	620	45,350.00	28,117,000.00	
HLB INC	1,314	65,800.00	86,461,200.00	
LG ELECTRONICS INC	1,477	141,500.00	208,995,500.00	
KANGWON LAND INC	1,392	27,650.00	38,488,800.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	1,193	23,100.00	27,558,300.00	
HYBE CO LTD	182	278,000.00	50,596,000.00	
KAKAO CORP	4,160	128,500.00	534,560,000.00	
NAVER CORPORATION	1,649	399,000.00	657,951,000.00	

NCSOFT CORP	228	611,000.00	139,308,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	337	122,500.00	41,282,500.00	
PEARLABYSS CORP	399	84,300.00	33,635,700.00	
CJ ENM CO LTD	144	149,900.00	21,585,600.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	87,600.00	35,653,200.00	
LOTTE SHOPPING CO LTD	172	106,000.00	18,232,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	120	272,000.00	32,640,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	61	180,000.00	10,980,000.00	
E-MART INC	237	170,000.00	40,290,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	125	437,500.00	54,687,500.00	
KT&G CORPORATION	1,574	81,300.00	127,966,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	373	124,000.00	46,252,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	419	194,000.00	81,286,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	52,900.00	25,021,700.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	130	1,374,000.00	178,620,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	670,000.00	11,390,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,127	113,500.00	127,914,500.00	
ALTEOGEN INC	312	81,300.00	25,365,600.00	
CELLTRION INC	1,293	269,000.00	347,817,000.00	
CELLTRION PHARM INC	173	153,500.00	26,555,500.00	
GREEN CROSS CORP	79	379,500.00	29,980,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	301,000.00	26,187,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	221	913,000.00	201,773,000.00	
SEEGENE INC	408	63,700.00	25,989,600.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	334	66,600.00	22,244,400.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	383	114,500.00	43,853,500.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	256	298,000.00	76,288,000.00	
YUHAN CORPORATION	760	63,600.00	48,336,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP INC.	4,190	43,950.00	184,150,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,084	10,100.00	41,248,400.00	
KAKAOBANK CORP	700	72,000.00	50,400,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,328	51,800.00	275,990,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	5,922	38,750.00	229,477,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,654	10,800.00	71,863,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	576	87,800.00	50,572,800.00	

	MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	5,520.00	30,514,560.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	4,496	8,570.00	38,530,720.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	982	48,550.00	47,676,100.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	2,376	13,100.00	31,125,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	507	60,100.00	30,470,700.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	378	223,000.00	84,294,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	1,020	73,200.00	74,664,000.00	
	DUZONBIZON CO LTD	190	98,200.00	18,658,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	428	167,000.00	71,476,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,101	20,150.00	62,485,150.00	
	LG INNOTEK CO LTD	158	221,500.00	34,997,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	794	181,000.00	143,714,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	63,941	75,300.00	4,814,757,300.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11,017	71,700.00	789,918,900.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	737	749,000.00	552,013,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,103	14,700.00	45,614,100.00	
	SK TELECOM CO LTD	116	301,500.00	34,974,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	3,402	23,150.00	78,756,300.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	7,310	103,000.00	752,930,000.00	
韓国ウォン 小計		209,748		16,028,175,650.00 (1,505,045,693)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	96.00	1,344,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	29,000	44.35	1,286,150.00	
	CHINA STEEL CORP	158,000	38.35	6,059,300.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	49,000	81.50	3,993,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	52,000	99.10	5,153,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	71,000	87.00	6,177,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	67,077	48.20	3,233,111.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	924.00	1,848,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	35,000	29.05	1,016,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,121	335.50	1,047,095.50	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	33,740	126.50	4,268,110.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	29,000	29.40	852,600.00	
	WAN HAI LINES LTD	7,700	207.50	1,597,750.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	21,000	121.50	2,551,500.00	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	21,000	36.25	761,250.00	
ECLAT TEXTILE CO LTD	3,000	578.00	1,734,000.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	5,640	215.50	1,215,420.00	
GIANT MANUFACTURING CO LTD	4,000	331.00	1,324,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	411.00	822,000.00	
POU CHEN	26,000	32.50	845,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	567.00	2,268,000.00	
MOMO.COM INC	1,000	1,750.00	1,750,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	271.50	2,172,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	67.20	4,368,000.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	191.00	573,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	65,754	16.50	1,084,941.00	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	252,000	22.85	5,758,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	162,201	26.25	4,257,776.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	139,792	22.35	3,124,351.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	103,133	20.80	2,145,166.40	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	147,000	32.30	4,748,100.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	124,760	14.00	1,746,640.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	125,958	17.95	2,260,946.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	128,105	21.90	2,805,499.50	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	48,299	45.75	2,209,679.25	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,463	264.50	4,618,963.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	131,160	24.60	3,226,536.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	107,000	58.70	6,280,900.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	182,000	13.80	2,511,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,832	28.75	656,420.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	99,000	77.40	7,662,600.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	148,432	9.28	1,377,448.96	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,700	78.50	682,950.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	276.00	1,932,000.00	
ACER INC	34,000	24.95	848,300.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	392.00	2,077,208.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	10,000	316.00	3,160,000.00	
AU OPTRONICS CORP	107,000	17.70	1,893,900.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	156.00	1,404,000.00	

COMPAL ELECTRONICS	53,000	22.65	1,200,450.00	
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	269.50	7,007,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	11,000	63.50	698,500.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	167,800	107.00	17,954,600.00	
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	118,000	16.80	1,982,400.00	
INVENTEC CORPORATION	42,000	24.50	1,029,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,080	2,595.00	2,802,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	31,000	59.60	1,847,600.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	8,000	138.50	1,108,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	3,000	420.50	1,261,500.00	
PEGATRON CORP	27,000	64.20	1,733,400.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	76.00	2,812,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	16,000	52.30	836,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	16,000	144.00	2,304,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	4,000	174.00	696,000.00	
WISTRON CORPORATION	35,293	27.10	956,440.30	
WIWYNN CORP	1,000	908.00	908,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	24,520	47.80	1,172,056.00	
YAGEO CORPORATION	5,198	475.00	2,469,050.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	7,000	97.00	679,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	110.50	5,635,500.00	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	22,000	60.40	1,328,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	22,000	98.50	2,167,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	45,000	122.00	5,490,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	2,280.00	1,140,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	891.00	2,673,000.00	
MEDIATEK INCORPORATION	20,000	901.00	18,020,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	14,000	65.60	918,400.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	8,000	433.50	3,468,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	415.50	831,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	111.00	1,110,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	525.00	3,150,000.00	
SILERGY CORP	1,000	4,035.00	4,035,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	330,000	619.00	204,270,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	159,000	67.50	10,732,500.00	

	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	12,000	164.00	1,968,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	327.50	1,310,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	45,000	29.40	1,323,000.00	
新台湾ドル 小計		4,288,557		447,763,459.36 (1,775,650,774)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	10,659	491.15	5,235,167.85	
	COAL INDIA LTD	20,779	148.65	3,088,798.35	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,413	268.65	1,991,502.45	
	INDIAN OIL CORP LTD	29,088	112.80	3,281,126.40	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	34,064	122.15	4,160,917.60	
	PETRONET LNG LTD	8,894	231.60	2,059,850.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	38,050	2,425.60	92,294,080.00	
	ACC LIMITED	1,019	2,458.75	2,505,466.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	9,373	438.35	4,108,654.55	
	ASIAN PAINTS LTD	5,175	3,346.35	17,317,361.25	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,709	836.55	2,266,213.95	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,391	1,597.90	5,418,478.90	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,210	463.55	9,831,895.50	
	JSW STEEL LTD	11,353	688.95	7,821,649.35	
	PI INDUSTRIES LTD	1,067	3,407.05	3,635,322.35	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,056	2,348.25	4,828,002.00	
	SHREE CEMENT LTD	146	30,671.35	4,478,017.10	
	TATA STEEL LTD	9,384	1,447.00	13,578,648.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,418	7,939.65	11,258,423.70	
	UPL LTD	7,208	757.90	5,462,943.20	
	VEDANTA LTD	14,989	301.85	4,524,429.65	
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,024	1,545.00	6,217,080.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	19,131	197.05	3,769,763.55	
	HAVELLS INDIA LTD	3,011	1,453.95	4,377,843.45	
	LARSEN & TOUBRO LTD	9,215	1,670.05	15,389,510.75	
	SIEMENS LTD	1,167	2,230.55	2,603,051.85	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	7,391	749.70	5,541,032.70	
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	3,801	742.95	2,823,952.95	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	1,271	1,911.60	2,429,643.60	
	BAJAJ AUTO LTD	949	3,700.60	3,511,869.40	

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	971	2,456.20	2,384,970.20	
BHARAT FORGE LTD	3,465	773.85	2,681,390.25	
EICHER MOTORS LTD	1,826	2,818.20	5,146,033.20	
HERO MOTOCORP LTD	1,617	2,796.70	4,522,263.90	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11,737	750.75	8,811,552.75	
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	1,833	6,802.25	12,468,524.25	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	17,036	212.65	3,622,705.40	
MRF LTD	21	79,867.90	1,677,225.90	
TATA MOTORS LTD	21,998	298.95	6,576,302.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	82	32,096.00	2,631,872.00	
TITAN CO LTD	4,625	2,034.30	9,408,637.50	
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,066	4,097.70	4,368,148.20	
INFO EDGE INDIA LTD	1,041	6,684.85	6,958,928.85	
TRENT LTD	2,023	1,022.55	2,068,618.65	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,184	3,950.50	8,627,892.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	1,462	4,070.80	5,951,509.60	
ITC LIMITED	41,784	212.65	8,885,367.60	
NESTLE INDIA LTD	452	20,457.20	9,246,654.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,079	875.60	7,073,972.40	
UNITED SPIRITS LTD	3,920	755.40	2,961,168.00	
COLGATE PALMOLIVE INDIA	1,365	1,735.50	2,368,957.50	
DABUR INDIA LIMITED	8,343	638.30	5,325,336.90	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,827	1,109.25	5,354,349.75	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	10,978	2,810.65	30,855,315.70	
MARICO LTD	6,577	575.00	3,781,775.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,357	4,719.55	6,404,429.35	
AUROBINDO PHARMA LIMITED	3,611	741.75	2,678,459.25	
BIOCON LTD	4,686	352.75	1,652,986.50	
CIPLA LTD	6,526	949.30	6,195,131.80	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,790	5,054.90	9,048,271.00	
DR.REDDY'S LABORATORIES	1,514	4,912.05	7,436,843.70	
IPCA LABORATORIES LTD	918	2,523.15	2,316,251.70	
LUPIN LTD	3,151	981.80	3,093,651.80	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	10,932	776.30	8,486,511.60	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	556	3,108.35	1,728,242.60	

AXIS BANK LIMITED	30,568	790.15	24,153,305.20	
BANDHAN BANK LTD	10,002	283.60	2,836,567.20	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	23,102	2,830.10	65,380,970.20	
ICICI BANK LIMITED	68,018	720.25	48,989,964.50	
KOTAK MAHINDRA BANK LIMITED	7,481	1,817.85	13,599,335.85	
STATE BANK OF INDIA	22,850	432.30	9,878,055.00	
YES BANK LTD	111,806	10.95	1,224,275.70	
BAJAJ FINANCE LIMITED	3,647	7,430.65	27,099,580.55	
BAJAJ FINSERV LTD	487	16,750.50	8,157,493.50	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,281	568.25	3,569,178.25	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	718	3,248.40	2,332,351.20	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,343	1,538.90	2,066,742.70	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,440	2,575.65	3,708,936.00	
REC LTD	9,915	157.30	1,559,629.50	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,787	1,105.20	3,080,192.40	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,560	1,348.35	3,451,776.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	10,903	737.35	8,039,327.05	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	2,989	1,621.65	4,847,111.85	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	4,842	696.70	3,373,421.40	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,070	1,173.20	7,121,324.00	
DLF LIMITED	8,519	332.95	2,836,401.05	
HCL TECHNOLOGIES LTD	14,640	1,198.55	17,546,772.00	
INFOSYS LIMITED	45,640	1,691.60	77,204,624.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	627	5,434.55	3,407,462.85	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	12,472	3,791.40	47,286,340.80	
TECH MAHINDRA LTD	8,114	1,433.25	11,629,390.50	
WIPRO LTD	18,340	662.35	12,147,499.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	33,090	686.15	22,704,703.50	
INDUS TOWERS LIMITED	9,651	242.30	2,338,437.30	
ADANI GREEN ENERGY LTD	5,136	1,215.95	6,245,119.20	
ADANI TOTAL GAS LTD	4,019	1,391.75	5,593,443.25	
ADANI TRANSMISSION LTD	4,001	1,806.75	7,228,806.75	
GAIL INDIA LIMITED	20,678	145.15	3,001,411.70	
INDRAPRASTHA GAS LTD	4,121	564.30	2,325,480.30	
NTPC LTD	69,036	114.55	7,908,073.80	

	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	44,752	173.50	7,764,472.00	
インドルピー 小計		1,114,403		950,248,924.40 (1,425,373,386)	
エジプトポンド	EASTERN TOBACCO	13,558	12.60	170,830.80	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	22,149	45.98	1,018,411.02	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	5,390	16.64	89,689.60	
エジプトポンド 小計		41,097		1,278,931.42 (8,916,070)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	3,530	181.74	641,542.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,503	234.39	352,288.17	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	762	1,401.52	1,067,958.24	
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	5,848	218.84	1,279,776.32	
	GOLD FIELDS LIMITED	11,457	122.17	1,399,701.69	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	8,544	43.87	374,825.28	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	10,682	182.30	1,947,328.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	836	617.15	515,937.40	
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,813	174.11	837,991.43	
	SASOL LTD.	7,312	218.65	1,598,768.80	
	SIBANYE STILLWATER LTD	39,150	51.25	2,006,437.50	
	BIDVEST GROUP LTD	3,606	192.57	694,407.42	
	MULTICHOICE GROUP LTD	5,073	105.37	534,542.01	
	MR PRICE GROUP LTD	3,242	205.47	666,133.74	
	NASPERS LIMITED-N SHS	2,934	2,429.36	7,127,742.24	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	12,822	61.53	788,937.66	
	BID CORP LTD	4,394	300.53	1,320,528.82	
	CLICKS GROUP LTD	3,408	302.22	1,029,965.76	
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	6,730	180.75	1,216,447.50	
	SPAR GROUP LIMITED	2,598	202.00	524,796.00	
	TIGER BRANDS LTD	2,304	179.08	412,600.32	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	5,233	213.50	1,117,245.50	
	ABSA GROUP LTD	9,719	149.58	1,453,768.02	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,084	1,899.03	2,058,548.52	
	NEDBANK GROUP LTD	4,692	176.69	829,029.48	
	STANDARD BANK GROUP LIMITED	17,479	142.39	2,488,834.81	
	FIRSTRAND LIMITED	67,593	59.57	4,026,515.01	

	REINET INVESTMENTS SCA	1,681	265.20	445,801.20	
	REMGRO LTD	6,563	115.90	760,651.70	
	DISCOVERY LTD	5,836	121.67	710,066.12	
	OLD MUTUAL LTD	63,504	15.34	974,151.36	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	9,457	30.58	289,195.06	
	SANLAM LTD	25,896	61.82	1,600,890.72	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,844	99.12	579,257.28	
	MTN GROUP LIMITED	22,704	122.64	2,784,418.56	
	VODACOM GROUP LIMITED	8,666	136.79	1,185,422.14	
南アフリカランド 小計		397,499		47,642,452.58 (368,752,582)	
合　計		29,852,055		10,258,945,460 (10,258,945,460)	

（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	4.8%	7.1%
メキシコペソ	株式　17銘柄	1.1%	1.6%
ブラジルレアル	株式　48銘柄	3.6%	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	18.9%	28.1%
マレーシアリンギット	株式　36銘柄	1.0%	1.6%
タイバーツ	株式　42銘柄	1.3%	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	1.0%	1.5%
韓国ウォン	株式　107銘柄	9.8%	14.7%
新台湾ドル	株式　87銘柄	11.6%	17.3%
インドルピー	株式　101銘柄	9.3%	13.9%
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	35,109,292.00	
	中国元（オフショア） 小計		691,400	35,109,292.00 (597,223,100)	
投資信託受益証券合計				597,223,100 (597,223,100)	
投資証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	729	19,318.50	
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	18,439	627,593.49	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	38,065	750,641.80	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	86,125	3,961,750.00	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	83,225	3,467,153.50	
		ISHARES MSCI UAE ETF	56,694	858,914.10	
	米ドル 小計		283,277	9,685,371.39 (1,063,260,071)	
	メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	211,300	3,228,664.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,770	764,062.20	
		DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	36,300	781,176.00	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,600	4,508,700.00	
		GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	34,100	1,716,253.00	
		MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184	289,072.56	
	メキシコペソ 小計		319,254	11,287,927.76 (62,171,648)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,000	445,920.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	4,200	263,046.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,300	235,809.00	
		ENERGISA SA-UNITS	1,800	79,668.00	
		KLABIN SA-UNIT	8,800	228,360.00	
	ブラジルレアル 小計		37,100	1,252,803.00 (26,420,863)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,751	622,454.56	

	南アフリカランド 小計	42,751	622,454.56 (4,817,798)	
投資証券合計			1,156,670,380 (1,156,670,380)	
合計			1,753,893,480 (1,753,893,480)	

（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%	60.6%
メキシコペソ	投資証券　6銘柄	－	0.4%	3.5%
ブラジルレアル	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	3.9%	－	34.1%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	13,069,994
コール・ローン	40,244,868	25,323,242
投資証券	6,661,603,340	7,331,509,060
未収入金	326,430	-
未収配当金	79,907,082	84,752,506
前払金	231,000	684,000
差入委託証拠金	11,430,000	1,840,000
流動資産合計	6,793,742,720	7,457,178,802
資産合計	6,793,742,720	7,457,178,802
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	237,600	688,400
未払金	-	4,641,868
未払解約金	8,000,000	11,006,893
未払利息	117	55

その他未払費用	2,029	1,762
流動負債合計	8,239,746	16,338,978
負債合計	8,239,746	16,338,978
純資産の部		
元本等		
元本	3,156,320,526	2,675,035,456
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,629,182,448	4,765,804,368
元本等合計	6,785,502,974	7,440,839,824
純資産合計	6,785,502,974	7,440,839,824
負債純資産合計	6,793,742,720	7,457,178,802

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	3,156,320,526口	2,675,035,456口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.1498円 (10,000口当たりの純資産額　21,498円)	1口当たり純資産額　2.7816円 (10,000口当たりの純資産額　27,816円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	51,117,600	-	50,880,000	△237,600
	東証ＲＥＩＴ指数先物	51,117,600	-	50,880,000	△237,600
合計		51,117,600	-	50,880,000	△237,600

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	42,968,400	-	42,280,000	△688,400
	東証ＲＥＩＴ指数先物	42,968,400	-	42,280,000	△688,400
合計		42,968,400	-	42,280,000	△688,400

（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11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2020年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,086,904,697円
同期中における追加設定元本額	2,997,144,752円
同期中における一部解約元本額	2,927,728,923円
2020年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	485,471,848円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	548,906,892円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	404,430,010円
イオン・バランス戦略ファンド	60,993,325円
三井住友・ＤＣ日本リートインデックスファンド	1,317,204,019円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	7,660,769円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	28,579,513円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	19,044,936円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	60,511,672円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	32,111,060円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	25,064,827円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	12,315,173円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,300,787円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	328,136円
ＳＭＡＭ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションⅡ・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＞	51,810,880円
合計	3,156,320,526円

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,156,320,526円
同期中における追加設定元本額	1,804,469,684円
同期中における一部解約元本額	2,285,754,754円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	78,052,871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	1,711,377,137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）	50,373,063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	17,827,319円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,565,187円
三井住友ＤＳ・国内リートインデックス年金ファンド	43,998,485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	575,069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Ⅱ・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	2,675,035,456円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	125	17,062,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	197	25,156,900	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	263	47,313,700	
	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	217	141,050,000	
	森ヒルズリート投資法人	740	117,512,000	
	産業ファンド投資法人	894	194,981,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	629	234,931,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	430	98,212,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	336	153,552,000	

ＧＬＰ投資法人	2,037	391,511,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	283	99,616,000	
日本プロロジスリート投資法人	997	393,316,500	
星野リゾート・リート投資法人	97	68,482,000	
Ｏｎｅリート投資法人	97	29,439,500	
イオンリート投資法人	738	108,928,800	
ヒューリックリート投資法人	554	99,553,800	
日本リート投資法人	194	85,942,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,404	31,856,760	
積水ハウス・リート投資法人	1,852	171,680,400	
トーセイ・リート投資法人	130	18,070,000	
ケネディクス商業リート投資法人	251	74,547,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	134	20,448,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	143	17,160,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	2,034	337,440,600	
いちごホテルリート投資法人	105	9,555,000	
ラサールロジポート投資法人	770	151,921,000	
スターアジア不動産投資法人	645	36,765,000	
マリモ地方創生リート投資法人	59	7,752,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	234	149,526,000	
大江戸温泉リート投資法人	102	8,221,200	
投資法人みらい	719	39,329,300	
森トラスト・ホテルリート投資法人	145	19,502,500	
三菱地所物流リート投資法人	160	82,080,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	238	50,908,200	
ザイマックス・リート投資法人	92	10,451,200	
タカラレーベン不動産投資法人	245	26,631,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	245	39,420,500	
日本ビルファンド投資法人	713	516,212,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	629	434,010,000	
日本都市ファンド投資法人	3,173	342,684,000	
オリックス不動産投資法人	1,254	242,899,800	
日本プライムリアルティ投資法人	413	168,091,000	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	569	87,853,600	
東急リアル・エステート投資法人	422	79,884,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	438	53,217,000	

	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,416	218,630,400	
	森トラスト総合リート投資法人	450	68,985,000	
	インヴィンシブル投資法人	2,773	119,516,300	
	フロンティア不動産投資法人	220	105,380,000	
	平和不動産リート投資法人	407	66,422,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	411	141,795,000	
	福岡リート投資法人	326	56,528,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	195	151,320,000	
	いちごオフィスリート投資法人	516	48,194,400	
	大和証券オフィス投資法人	136	104,992,000	
	阪急阪神リート投資法人	283	47,176,100	
	スターツプロシード投資法人	97	25,520,700	
	大和ハウスリート投資法人	945	326,025,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,931	126,287,400	
	大和証券リビング投資法人	842	102,555,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	585	82,368,000	
合計		37,727	7,331,509,060	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	73,049,415	107,044,462
金銭信託	-	4,135,433
コール・ローン	9,622,071	8,012,441
投資証券	7,670,568,831	15,206,331,216
派生商品評価勘定	14,514	1,159
未収入金	82,327	232,149
未収配当金	10,368,904	19,823,199
流動資産合計	7,763,706,062	15,345,580,059
資産合計	7,763,706,062	15,345,580,059
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	450	13,113
未払金	35,033,622	56,100,512

未払解約金	-	734,905
未払利息	28	17
その他未払費用	163	452
流動負債合計	35,034,263	56,848,999
負債合計	35,034,263	56,848,999
純資産の部		
元本等		
元本	4,109,013,318	5,775,124,200
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,619,658,481	9,513,606,860
元本等合計	7,728,671,799	15,288,731,060
純資産合計	7,728,671,799	15,288,731,060
負債純資産合計	7,763,706,062	15,345,580,059

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（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10日現在）	（2021年 9月10日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	4,109,013,318口	5,775,124,200口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.8809円 (10,000口当たりの純資産額　18,809円)	1口当たり純資産額　2.6473円 (10,000口当たりの純資産額　26,473円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 9月10日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	16,469,472	-	16,483,206	13,734
	米ドル	11,279,900	-	11,293,556	13,656
	ユーロ	3,260,322	-	3,260,400	78
	オーストラリアドル	1,929,250	-	1,929,250	-
	売建	3,509,300	-	3,508,970	330
	英ポンド	1,379,700	-	1,379,600	100
	香港ドル	342,500	-	342,500	-
	シンガポールドル	1,787,100	-	1,786,870	230
合計		19,978,772	-	19,992,176	14,064

（2021年 9月10日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	24,600,000	-	24,588,046	△11,954
	米ドル	15,000,000	-	15,000,861	861
	ユーロ	1,000,000	-	1,000,084	84
	英ポンド	1,250,000	-	1,250,098	98
	オーストラリアドル	5,150,000	-	5,145,370	△4,630
	香港ドル	2,200,000	-	2,191,633	△8,367
合計		24,600,000	-	24,588,046	△11,954

（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。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 9月11日 至 2021年 9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

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

（2021年 9月10日現在）	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	4,109,013,318円
同期中における追加設定元本額	2,539,203,377円
同期中における一部解約元本額	873,092,495円
2021年 9月10日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	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	5,035,048,237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	56,813,655円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	578,654円
三井住友ＤＳ・外国リートインデックス年金ファンド	82,353,208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ＤＳ・先進国リートインデックス・ファンド	419,897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＞	47,609,004円
ＳＭＡＭ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションⅡ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	13,755,435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＞	34,135,132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＞	168,560,701円
合計	5,775,124,200円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

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	169,475.85	
		AGREE REALTY CORP	6,157	442,380.45	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758	151,311.62	
		ALEXANDER'S INC	136	35,175.04	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	12,101	2,449,363.41	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	4,195	164,821.55	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	11,944	606,158.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,155	86,317.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,269	997,455.90	
		AMERICOLD REALTY TRUST	22,508	812,988.96	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	13,986	710,069.22	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	15,893	111,568.86	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	18,468	272,033.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,848	64,090.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,408	2,804,208.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,485	48,572.55	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,524	1,395,173.60	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	15,153	208,353.75	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	26,434	609,832.38	
		BROADSTONE NET LEASE INC	14,236	381,667.16	
		BRT APARTMENTS CORP	500	10,240.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,628	1,298,686.56	
		CARETRUST REIT INC	8,327	183,527.08	
		CENTERSPACE	1,026	106,293.60	
		CHATHAM LODGING TRUST	4,019	47,223.25	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,279	36,636.26	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603	79,447.78	
		CLIPPER REALTY INC	800	6,680.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	10,778	204,889.78	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,458	117,787.36	
		COREPOINT LODGING INC	2,769	37,907.61	
		CORESITE REALTY CORPORATION	3,791	569,521.93	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9,768	274,090.08	
		COUSINS PROPERTIES INC	13,019	492,638.96	

		CTO REALTY GROWTH INC	310	16,882.60	
		CUBESMART	17,895	953,445.60	
		CYRUSONE INC	10,806	835,087.68	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	18,176	155,768.32	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,125	3,966,735.00	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC-CLASS A	43,678	284,343.78	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884	85,504.72	
		DOUGLAS EMMETT INC	14,250	469,965.00	
		DUKE REALTY CORP	33,067	1,698,982.46	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	2,740.00	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	7,057	148,126.43	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	3,701	652,930.42	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,815	128,918.90	
		EPR PROPERTIES	6,966	342,866.52	
		EQUINIX INC	7,947	6,791,188.32	
		EQUITY COMMONWEALTH REIT	10,451	274,965.81	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	14,952	1,273,611.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	30,826	2,542,220.22	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	10,453	331,673.69	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,736	1,883,128.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,870	2,221,351.80	
		FARMLAND PARTNERS INC	4,666	58,604.96	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	6,291	756,870.21	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	11,641	633,037.58	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,728	183,270.72	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	6,015	27,187.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	19,719	957,949.02	
		GEO GROUP INC	9,546	71,690.46	
		GETTY REALTY CORPORATION	3,220	99,626.80	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,102	69,298.68	
		GLADSTONE LAND CORP	1,730	40,257.10	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,403	68,950.98	

GLOBAL NET LEASE INC		8,273	138,903.67	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		11,994	362,218.80	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC		19,297	586,049.89	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		48,364	1,722,242.04	
HERSHA HOSPITALITY TRUST		2,876	25,740.20	
HIGHWOODS PROPERTIES INC		9,521	427,207.27	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		62,702	1,008,875.18	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		13,192	355,788.24	
INDEPENDENCE REALTY TRUST		8,401	168,776.09	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES		6,274	167,892.24	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		2,085	508,323.00	
INVITATION HOMES INC		51,098	2,100,127.80	
IRON MOUNTAIN INC		25,461	1,217,545.02	
JBG SMITH PROPERTIES		9,249	276,822.57	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		54,000	42,390.00	
KILROY REALTY CORP		9,193	600,854.48	
KIMCO REALTY CORPORATION		52,918	1,134,032.74	
KITE REALTY GROUP TRUST		7,036	143,675.12	
LEXINGTON REALTY TRUST		23,367	321,296.25	
LIFE STORAGE INC		6,748	849,843.12	
LTC PROPERTIES INC		3,325	113,316.00	
MACERICH COMPANY/THE		14,261	246,144.86	
MACK-CALI REALTY CORPORATION		7,798	132,566.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV		121,700	86,407.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		51,869	1,118,295.64	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES		10,096	1,937,018.56	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP		9,490	176,039.50	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC		4,003	237,417.93	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		15,676	726,896.12	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES		7,371	426,486.06	
NETSTREIT CORP		2,801	71,453.51	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP		5,922	51,639.84	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST		2,355	153,192.75	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		3,872	101,988.48	

OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC		20,948	703,852.80	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		1,014	31,890.30	
PARAMOUNT GROUP INC		14,599	131,099.02	
PARK HOTELS AND RESORTS INC		20,703	389,423.43	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		11,678	249,792.42	
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		5,400	10,746.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST		19,886	367,493.28	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		11,314	197,655.58	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		2,586	60,253.80	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC		6,243	75,665.16	
PRIME US REIT		54,200	46,341.00	
PROLOGIS INC		65,846	8,870,773.12	
PS BUSINESS PARKS INC/CA		1,747	276,462.75	
PUBLIC STORAGE		13,572	4,399,635.24	
REALTY INCOME CORPORATION		33,599	2,340,842.33	
REGENCY CENTERS CORP		14,082	963,208.80	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP		9,864	174,395.52	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA		19,526	255,204.82	
RETAIL VALUE INC		2,032	52,832.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		11,978	735,688.76	
RLJ LODGING TRUST		14,708	206,353.24	
RPT REALTY		6,346	79,959.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		4,944	384,593.76	
SABRA HEALTH CARE REIT		20,302	335,998.10	
SAFEHOLD INC		1,242	102,328.38	
SAUL CENTERS INC		894	39,407.52	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT		3,468	52,262.76	
SERVICE PROPERTIES TRUST		15,023	163,600.47	
SIMON PROPERTY GROUP INC		29,325	3,831,018.00	
SITE CENTERS CORP		14,831	232,253.46	
SL GREEN REALTY CORP		6,241	433,811.91	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		10,678	537,210.18	

		STAG INDUSTRIAL INC	13,969	588,513.97	
		STORE CAPITAL CORP	21,664	756,506.88	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,721	87,100.16	
		SUN COMMUNITIES INC	9,861	2,012,235.66	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	18,868	225,095.24	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS,INC	9,118	154,550.10	
		TERRENO REALTY CORP	6,101	411,024.37	
		UDR INC	26,160	1,401,129.60	
		UMH PROPERTIES INC	3,698	92,376.04	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	1,344	75,882.24	
		URBAN EDGE PROPERTIES	8,922	162,558.84	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	54,910.52	
		VENTAS INC	33,081	1,859,152.20	
		VEREIT INC	20,205	987,822.45	
		VICI PROPERTIES INC	47,303	1,413,413.64	
		VORNADO REALTY TRUST	14,176	587,028.16	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,803	171,435.60	
		WELLTOWER INC	37,317	3,213,366.87	
		WHITESTONE REIT	4,511	44,207.80	
		WP CAREY INC	16,130	1,250,397.60	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	9,586	161,140.66	
	米ドル 小計		2,210,568	104,193,138.07 (11,438,322,697)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	5,481	231,024.15	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	60,948.54	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715	21,986.30	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,000	96,840.00	
		CAN APARTMENT PROP	7,389	459,004.68	
		CHOICE PROPERTIES REIT	14,769	222,716.52	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR	7,925	82,895.50	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,710	67,262.30	

		CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,551	80,689.23	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	8,986	153,121.44	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,169	50,038.83	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	9,313	168,937.82	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,770	258,967.30	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,949	213,917.48	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178	110,215.52	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,671	103,042.26	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447	33,526.99	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	27,948.15	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,690	102,738.40	
		PLAZA RETAIL REIT	8,509	38,630.86	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,468	304,780.84	
		SLATE GROCERY REIT	3,196	43,433.64	
		SLATE OFFICE REIT	3,663	19,487.16	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,374	194,598.22	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,963	150,957.84	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	4,770	35,393.40	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	3,417	93,864.99	
	カナダドル 小計		160,967	3,426,968.36 (297,083,887)	
ユーロ		AEDIFICA	3,213	380,097.90	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	16,309	264,695.07	
		ALTAREA	329	67,445.00	
		BEFIMMO SCA	2,240	78,288.00	
		CARE PROPERTY INVEST	2,707	75,525.30	
		CARMILA	4,754	59,044.68	
		COFINIMMO	2,631	355,185.00	
		COVIVIO	4,314	326,742.36	
		CROMWELL REIT EUR	27,720	72,626.40	
		EUROCOMMERCIAL	3,371	69,442.60	
		GECINA SA	4,842	613,723.50	

		HAMBORNER REIT AG	6,236	58,686.99	
		HIBERNIA REIT PLC	56,011	67,773.31	
		ICADE	2,844	203,061.60	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798	18,064.47	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	22,528	191,825.92	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,884	46,346.40	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432	58,800.96	
		KLEPIERRE	17,170	340,395.25	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	4,421	24,094.45	
		MERCIALYS	2,743	26,195.65	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	30,219	284,602.54	
		MONTEA NV	896	108,953.60	
		NSI NV	1,995	68,229.00	
		RETAIL ESTATES	963	64,617.30	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	12,226	843,838.52	
		VASTNED RETAIL	1,505	34,690.25	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,949	454,062.00	
		WERELDHAVE NV	3,304	42,324.24	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	1,599	81,868.80	
	ユーロ 小計		294,153	5,381,247.06 (698,539,680)	
	英ポンド	AEW UK REIT PLC	9,000	9,468.00	
		ASSURA PLC	234,553	182,364.95	
		BIG YELLOW GROUP PLC	14,536	216,004.96	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210	60,808.02	
		BRITISH LAND CO PLC	83,293	435,788.97	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	69,586	118,296.20	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238	52,551.42	
		CUSTODIAN REIT PLC	39,999	38,479.03	
		DERWENT LONDON PLC	9,845	366,037.10	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037	56,915.07	
		GCP STUDENT LIVING PLC	43,019	91,200.28	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	20,908	158,796.26	
		HAMMERSON PLC	380,846	127,811.91	

		HOME REIT PLC	17,550	19,743.75	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	23,000	26,910.00	
		INTU PROPERTIES PLC	28,500	285.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	65,987	467,319.93	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	81,335	206,102.89	
		LXI REIT PLC	49,506	72,278.76	
		NEWRIVER REIT PLC	17,642	13,407.92	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	53,598.25	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	117,823	194,407.95	
		REGIONAL REIT LTD	45,664	40,092.99	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	18,480	206,791.20	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	70,698	35,349.00	
		SEGRO PLC	107,345	1,370,258.92	
		SHAFTESBURY PLC	27,317	170,184.91	
		STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280	36,923.04	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	73,348	86,183.90	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	36,091.26	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	149,824	351,187.45	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	58,562	44,741.36	
		UNITE GROUP PLC	36,476	430,416.80	
		WORKSPACE GROUP PLC	13,356	120,337.56	
	英ポンド 小計		2,228,674	5,897,135.01 (896,069,664)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	32,980	117,408.80	
		APN INDUSTRIA REIT	13,221	48,785.49	
		ARENA REIT	28,622	121,929.72	
		AVENTUS GROUP	35,000	118,650.00	
		BWP TRUST	45,015	182,760.90	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	46,643	158,586.20	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,528	160,085.60	
		CENTURIA OFFICE REIT	43,559	108,026.32	
		CHARTER HALL GROUP	40,904	724,409.84	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	47,301	249,276.27	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	42,995	166,820.60	
		CHARTER HALL SOCIAL	33,955	128,349.90	

	INFRASTRUCTURE REIT			
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	134,910.30	
	DEXUS	98,875	1,055,985.00	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204	50,764.70	
	GOODMAN GROUP	149,660	3,377,826.20	
	GPT GROUP	167,683	831,707.68	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	30,439	129,670.14	
	HOME CONSORTIUM	16,399	119,220.73	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	40,492	67,014.26	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	15,921	56,837.97	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	27,812	178,274.92	
	IRONGATE GROUP	42,404	64,454.08	
	MIRVAC GROUP	352,526	1,054,052.74	
	NATIONAL STORAGE REIT	91,680	216,364.80	
	RURAL FUNDS GROUP	25,701	68,878.68	
	SCENTRE GROUP	466,384	1,315,202.88	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	92,804	249,642.76	
	STOCKLAND	213,660	967,879.80	
	VICINITY CENTRES	336,355	573,485.27	
	WAYPOINT REIT LTD	81,055	226,143.45	
オーストラリアドル 小計		2,902,495	13,023,406.00 (1,053,723,779)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	83,275	139,485.62	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	91,963	231,286.94	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	131,684	152,095.02	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	110,983	187,561.27	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	36,063	112,696.87	
ニュージーランドドル 小計		453,968	823,125.72 (64,162,649)	
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	170,000	739,500.00	
	FORTUNE REIT	130,000	1,056,900.00	
	LINK REIT	182,300	12,742,770.00	
	PROSPERITY REIT	98,000	303,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	110,000	544,500.00	

	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	176,000	705,760.00	
香港ドル 小計		866,300	16,093,230.00 (227,236,407)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	38,300	55,535.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300	106,743.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	291,800	887,072.00	
	ASCOTT TRUST	139,155	144,721.20	
	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	43,032.00	
	ESR REIT	217,952	104,616.96	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600	61,254.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	176,400	46,746.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	116,900	270,039.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	102,700	51,350.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	248,238	367,392.24	
	IREIT GLOBAL	57,600	36,864.00	
	KEPPEL DC REIT	109,500	277,035.00	
	KEPPEL REIT	202,900	217,103.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	57,600	50,112.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	321,700	18,658.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	193,200	392,196.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	167,600	474,308.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	252,150	516,907.50	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	167,200	168,872.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	105,792.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	29,800	144,232.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	104,800	45,588.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700	60,363.50	

		SPH REIT	74,600	70,497.00	
		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		4,533,353	6,080,486.66 (497,079,784)	
	韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	8,325	56,277,000.00	
		JR REIT XXVII	8,500	45,135,000.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	2,600	16,042,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	12,522	69,997,980.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	5,000	23,350,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302	43,582,440.00	
	韓国ウォン 小計		42,249	254,384,420.00 (23,886,697)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	15,233	298,566.80	
	イスラエルシュケル 小計		15,233	298,566.80 (10,225,972)	
合計				15,206,331,216 (15,206,331,216)	

（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	74.8%	75.2%
カナダドル	投資証券　27銘柄	1.9%	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%
イスラエルシュケル	投資証券　1銘柄	0.1%	0.1%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド

	2021年9月30日現在
Ⅰ　資産総額	1,031,556,169 円
Ⅱ　負債総額	442,133 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,031,114,036 円
Ⅳ　発行済口数	811,667,793 口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2704 円
（１万口当たり純資産額	12,704 円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ　名義書換
該当事項はありません。

ロ　受益者名簿
作成しません。

ハ　受益者に対する特典
ありません。

ニ　受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

ｂ．上記ａの申請のある場合には、上記ａの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記ａの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

ｃ．上記ａの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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

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

ヘ　償還金

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

ト　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

イ　資本金の額および株式数

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

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

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

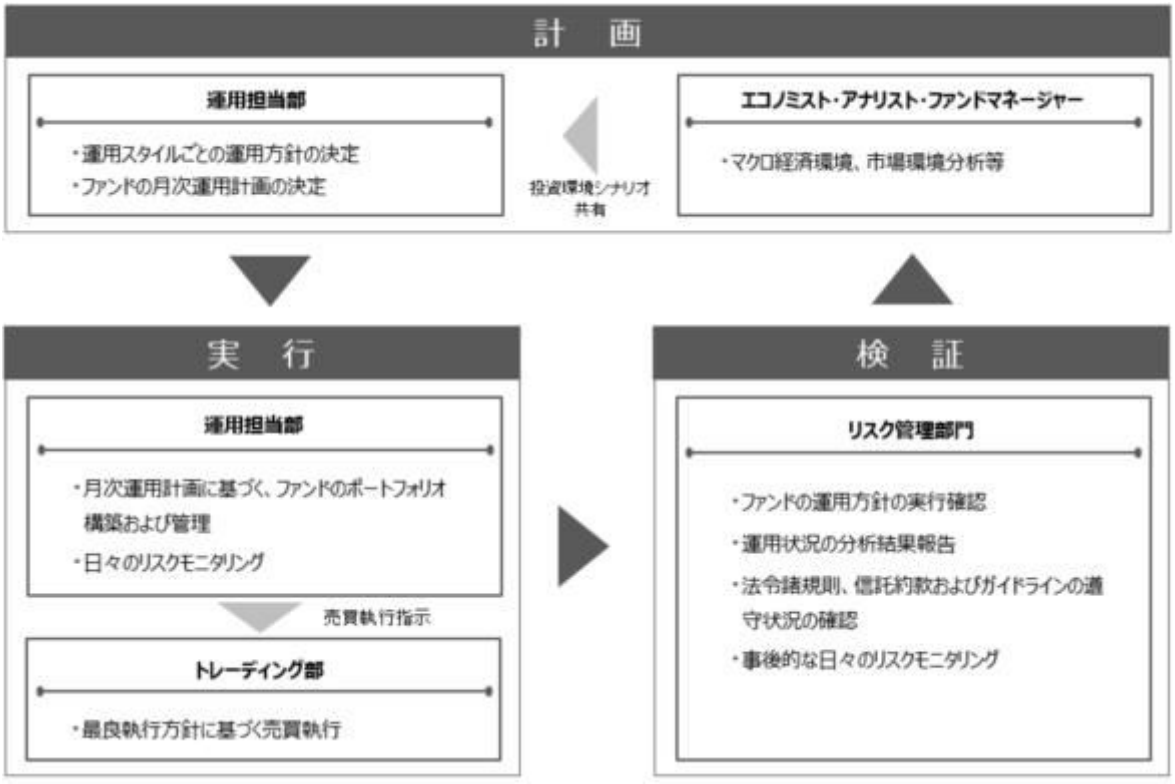
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ　投資信託の運用の流れ



２【事業の内容及び営業の概況】

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

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 （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		
サービス支援手数料	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）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		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			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		
						配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	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。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定

式基準によっております。
②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。
数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

４.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
消費税等の会計処理
消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(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

①信用リスクの管理

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

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

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

②市場リスクの管理

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

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

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			
①その他有価証券	19,391,111	19,391,111	－
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	－
資産計	66,383,807	66,383,807	－
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	－
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	－
負債計	3,791,158	3,791,158	－

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			
①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)①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)①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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年４月１日　至 2020年３月31日)

１．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

（単位：千円）

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

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

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

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	㈱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㈱	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。

ロ　販売会社

（イ）名称	（ロ）資本金の額	（ハ）事業の内容
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
ａｕカブコム証券株式会社	7,196百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
岡三にいがた証券株式会社	852百万円	
静岡東海証券株式会社	600百万円	
フィリップ証券株式会社	950百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
PayPay銀行株式会社	37,250百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

※資本金の額は、2021年3月末現在。
※住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

（持株比率５％以上を記載しています。）
販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年12月 7日	有価証券届出書
2020年12月 7日	有価証券報告書
2021年 6月 7日	有価証券届出書
2021年 6月 7日	半期報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年10月19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・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンドの2020年9月11日から2021年9月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンドの2021年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

―――

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