

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年1月20日提出
【発行者名】	三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	イオン・バランス戦略ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2,500億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

イオン・バランス戦略ファンド

（愛称として「みらいパレット」という名称を用いることがあります。）

以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

2,500億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「みらいパレ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（５）【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

※累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

※申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2022年1月21日から2022年7月21日まで

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

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ お申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が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

ニ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用
ありません。

ホ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金500億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

《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)
単位型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型		その他資産 ()
	内外	資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《属性区分表》

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2016年10月12日 信託契約締結、設定、運用開始。
2017年 5月29日 信託期間の変更(無期限化)実施。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

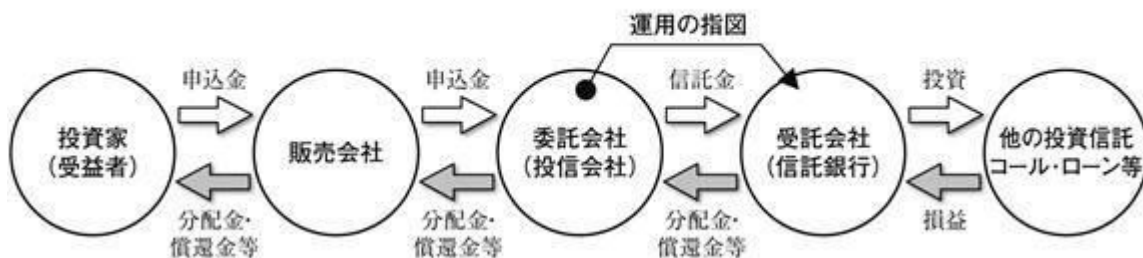
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2021年11月30日現在）

（ロ）会社の沿革

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

2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

(ハ) 大株主の状況

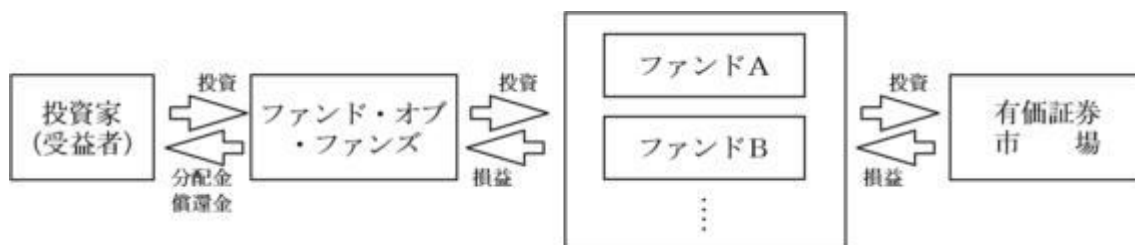
(2021年11月30日現在)

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（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

(ロ) 運用にあたっては、安定資産ポートフォリオへの投資を基本とし、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、リスク資産ポートフォリオの組入配分を機動的に調整します。リスク資産ポートフォリオへの投資割合の上限は40%程度とします。

(ハ) 安定資産ポートフォリオ内の資産配分は均等配分を基本としますが、市況の見通しに応じて一

定の範囲で調整を行う場合があります。

- (ニ) リスク資産ポートフォリオ内の資産配分はモメンタム・フォロー戦略[※]を活用します。

※モメンタム・フォロー戦略とは、「過去に良好な運用成績の資産は、一定期間良好な運用成績が継続する」という仮定を基に、過去の運用成績が良い資産の投資割合を上げる戦略です。

- (ホ) 実質組入外貨建資産については、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドを除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ヘ) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ト) 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。
- (チ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

■投資対象とする投資信託の投資方針等

安定資産を構成する投資信託証券

日本国債

ファンド名	日本国債ダイナミック・アロケーション・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	●主として日本の国債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。 ●長期金利の低下（あるいは横ばい）が予想される局面では積極的に金利リスクを取得し、長期金利の上昇が予想される局面では機動的に金利リスクの圧縮を図ります。 ●長期金利の局面判定には、運用会社独自のクオンツ手法を用います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.06%

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

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

リスク資産を構成する投資信託証券

●すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶ 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）の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	●新興国の株式、新興国の株式指数を対象とした先物取引および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ます。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

ファンド名	バンガード・FTSE・エマージング・マーケットETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	●FTSEエマージング・マーケット・オールキャップ（含む中国A株）インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の株式を主要投資対象とします。 ●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等*1	年0.1%程度
購入の可否*2	日本において一般投資者の購入が可能です。

*1 管理報酬等とは各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです（以下同じ。）。

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

▶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）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）している不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	● S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本を除く世界各国の不動産投資信託（REIT）などを主要投資対象とします。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

▶ 債券

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に連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、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%

新興国債券…為替ヘッジなし

ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	● ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ● ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等	年0.25%程度
購入の可否	日本において一般投資者の購入が可能です。

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	● J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ● ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
管理報酬等	年0.39%程度
購入の可否	日本において一般投資者の購入が可能です。

ファンドの特色

1

日本を含む世界のさまざまな資産に投資し、
値下がりするリスクを抑えつつ、安定的なリターンを目指します。

2

各資産の組入比率は柔軟に調整します。

■ 当ファンドでは、日本を含む世界のさまざまな資産を、安定資産とリスク資産に区別します。

安定資産・リスク資産とは？

安定資産 ……資産が目減りする可能性が低い資産のことをいいます。

リスク資産 ……安定資産と比べ値動きが大きく、より高い収益が期待できる反面、大きな損失を被る可能性のある資産のことをいいます。

■ リスク資産への投資は40%程度までとします。

■ 安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)」の組入比率がほぼ半分ずつになるようにします。

※市況の見通しに応じて一定の範囲で調整を行う場合があります。

3

先進国の債券は、部分的に対円での為替ヘッジを行います。

■ 為替ヘッジを行う場合でも、完全に為替変動リスクを回避することはできません。

■ 為替ヘッジを行う場合と行わない場合で、為替の変動が当ファンドに与える影響は以下のようになると考えられます。

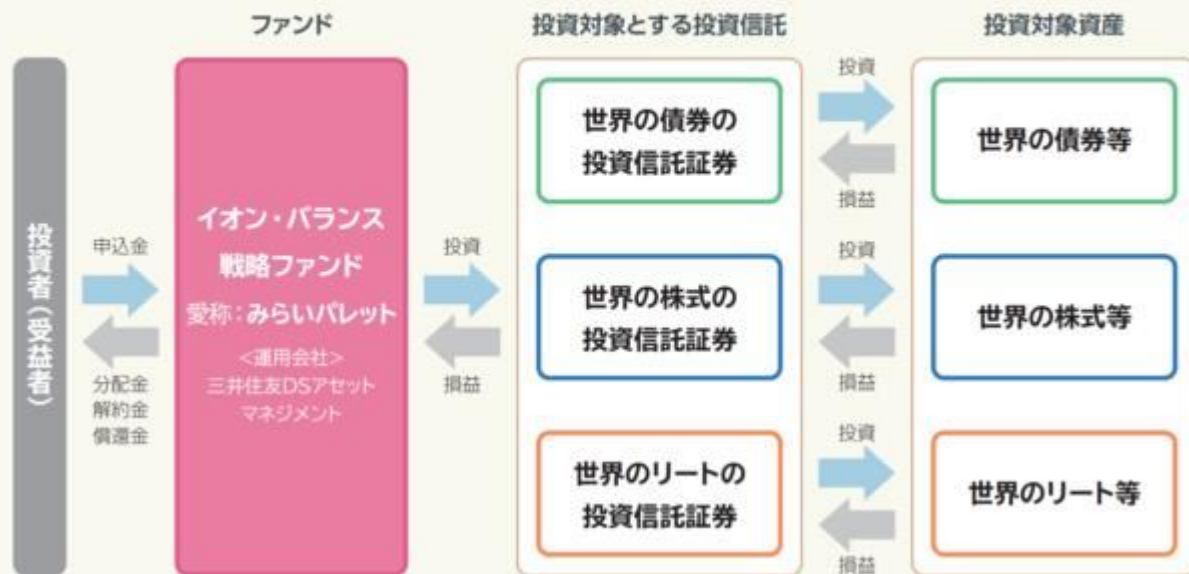
		円高となった場合	円安となった場合
日本の資産		基準価額に影響はありません。	基準価額に影響はありません。
外国の資産	為替ヘッジを行う資産	組入通貨に対し円高となった場合でも、為替差損は発生せず、基準価額へのマイナスは限定的となります。	組入通貨に対し円安となった場合でも、為替差益は発生せず、基準価額にプラスとなりません。
	為替ヘッジを行わない資産	組入通貨に対して円高となった場合、為替差損が発生し、基準価額にマイナスとなります。	組入通貨に対し円安となった場合、為替差益が発生し、基準価額にプラスとなります。

※上記は、為替ヘッジの一般的な説明であり、市況動向等によっては、上記の通りにならない場合があります。

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

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象資産と資産配分

- 安定資産と言われる債券への投資と現預金での保有を基本とします。このうち債券は、日本国債と米国国債などの為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）に投資します。
- 安定資産のほか、株式やリート（不動産投資信託）など7つのリスク資産を組み入れることがあります。

▶ 投資対象資産と各資産の指数

【安定資産】

日本国債	NOMURA-BPI(国債)
為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)
現預金	—

日本国債と現預金

日本の長期金利の方向性(低下・横ばい、上昇)を予想し、日本国債(長期・超長期国債)と現預金への資産配分比率を機動的に変更します。

為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)

日本国債よりも利回りが相対的に高い先進国債券に投資する一方、投資先通貨(米国国債が投資先であれば米ドル)の下落リスクの低減を図ります(為替ヘッジを行います)。為替ヘッジでは、具体的には、投資先通貨を売って日本円を買います。

【リスク資産】

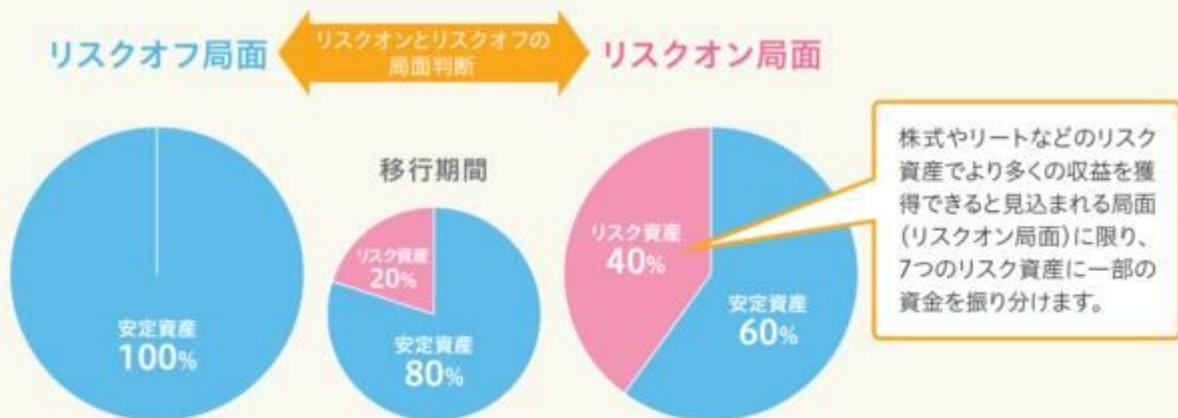
日本株式	TOPIX(配当込み)
先進国株式(除く日本)	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債券	J.P.モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス(円ベース)
日本リート	東証REIT指数(配当込み)
外国リート	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)

(注)ただし、すべてのリスク資産に投資するとは限りません。

※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。

▶ リスクオン・オフ局面での資産配分

■ 「リスクオン局面」、「リスクオフ局面」の判断は、「リスク態度指数」で行います。



リスクオン局面（リスク選好的な局面）

投資家がより高い収益の獲得を目指し、リスクの高い資産に積極的に資金を投入する市場環境のこと。景気や企業業績の改善、金融緩和（利下げ）、金融不安の解消（国家財政や銀行経営の改善）、地政学的リスク（戦争、テロ）の低下などが見込まれる場合、多くはリスクオン局面と判断されます。

リスクオフ局面（リスク回避的な局面）

投資家がリスクを回避するようになり、より安全な資産に資金が向かいやすい市場環境のこと。景気や企業業績の悪化、金融引締め（利上げ）、金融不安の高まり（国家財政や銀行経営の悪化）、地政学的リスク（戦争、テロ）の高まりなどが見込まれる場合、多くはリスクオフ局面と判断されます。

リスク態度指数

市場のリスク選好度合いを計るための指数です。リスクオン局面とリスクオフ局面を判断します。

（注1）リスク資産への投資は40%程度までとします。

（注2）局面判断の有効性を高めるため、資産配分の切替えを行う際に一定の移行期間を設けます。

（注3）安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）」の組入比率がほぼ半分ずつになるようにします。

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※日本銀行によるマイナス金利政策が導入されたため、日本国債の一部がマイナス利回りとなることや、現預金に口座管理手数料が課されることがあります。このため、上図のリスクオフ局面の場合でも、日本国債および現預金の保有による損失が発生する場合があります。

（2）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券（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。））ならびに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。））または次の有価証券

（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

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

ハ 投資対象とする金融商品

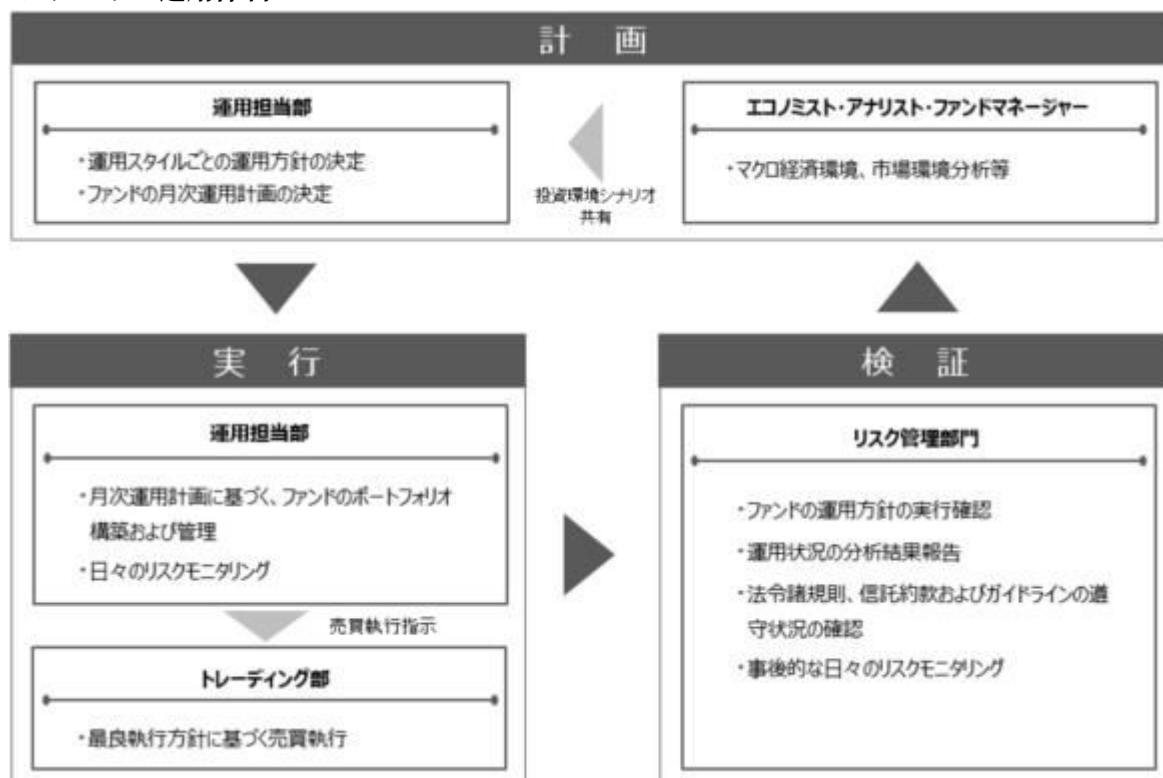
委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



※リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

※他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。ま

た、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

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４月２６日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

Ⅰ ファンドの信託約款に基づく投資制限

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

信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の対円で為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

チ 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、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、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%を超えないこととします。
- （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。

II 法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

（ニ）信用リスク

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

（ホ）為替変動リスク

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

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

（チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約

により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※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・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的財産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】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

※累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

※申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 ＜信託報酬の配分（税抜き）＞		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.45%	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0.40%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
投資対象とする投資信託	※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。		
	リスク資産配分の変動幅（0%～40%）を加味した場合の管理報酬等の概算値は以下の通りとなります。 年0.0%～年0.156%程度* ※管理報酬等のうち最大のもの（年0.39%程度）を用いて計算しています。なお、管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.968%（税抜き0.88%）～年1.124%（税抜き1.036%）程度* ※実質的な負担は、実際の組入状況等により変動します。		

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、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。

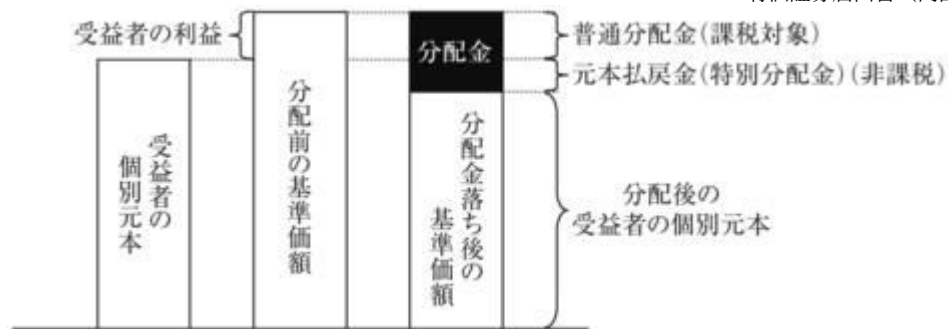
ハ 収益分配金の課税について

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。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対 象 と な る 投 資 信 託	公募株式投資信託（新たに購入が必要）	
非 課 税 対 象	公募株式投資信託から生じる 配当所得 および 譲渡所得	
利 用 対 象 と な る 方	20歳以上 の日本居住者 （専用口座が開設される年の1月1日現在）	0～19歳 の日本居住者 （専用口座が開設される年の1月1日現在）
非 課 税 の 期 間	最長 5 年間（投資期間は2023年まで）	
利 用 で き る 限 度 額	120万円 ／年 （最大 600万円 ）	80万円 ／年 （最大 400万円 ）

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

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

※上記「（５）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年11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】

イオン・バランス戦略ファンド

2021年11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	48,060,509	1.74
親投資信託受益証券	日本	2,687,137,960	97.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	32,832,230	1.18
合計（純資産総額）		2,768,030,699	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】

イオン・バランス戦略ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年11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	日本国債ダイナ ミック・アロ ケーション・マ ザーファンド	1,018,204,216	1.1872	1,208,784,327	1.1877	1,209,321,147	43.69
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	654,128,019	1.5045	984,135,913	1.5076	986,163,401	35.63
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	26,039,960	5.9524	155,000,000	5.8337	151,909,314	5.49
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	50,669,415	2.8420	144,000,000	2.8144	142,604,001	5.15
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	49,411,643	2.0036	99,000,000	1.9840	98,032,699	3.54
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	19,849,872	2.7204	54,000,000	2.6385	52,373,887	1.89
アメリカ	投資証 券	i シェアーズ J.P. モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 E T F	3,930	12,424.02	48,826,393	12,229.14	48,060,509	1.74
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)	14,508,106	3.3774	49,000,000	3.2212	46,733,511	1.69

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11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	1.74
親投資信託受益証券	97.08
合 計	98.81

②【投資不動産物件】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

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 (2017年 4月26日)	941,887,543	941,887,543	10,191	10,191
第2期 (2018年 4月26日)	2,135,712,788	2,135,712,788	9,962	9,962
第3期 (2019年 4月26日)	2,327,681,035	2,327,681,035	10,073	10,073
第4期 (2020年 4月27日)	2,390,208,284	2,390,208,284	9,866	9,866
第5期 (2021年 4月26日)	2,730,735,805	2,730,735,805	10,191	10,191
2020年11月末日	2,602,878,429	-	9,949	-
12月末日	2,602,878,651	-	9,950	-
2021年 1月末日	2,628,241,106	-	9,910	-
2月末日	2,624,624,803	-	9,912	-
3月末日	2,691,806,276	-	10,119	-
4月末日	2,728,910,771	-	10,205	-
5月末日	2,757,138,052	-	10,276	-
6月末日	2,795,897,446	-	10,380	-
7月末日	2,776,803,805	-	10,457	-
8月末日	2,740,961,227	-	10,428	-
9月末日	2,718,871,603	-	10,318	-
10月末日	2,743,641,625	-	10,299	-
11月末日	2,768,030,699	-	10,297	-

② 【分配の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金 (円)
第1期	2016年10月12日～2017年 4月26日	-
第2期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	-
第3期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	-
第4期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	-
第5期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	-

③ 【収益率の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	収益率（％）
第1期	1.9
第2期	△2.2
第3期	1.1
第4期	△2.1
第5期	3.3
第6期（中間期）	0.7

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

（４）【設定及び解約の実績】

イオン・バランス戦略ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	941,628,680	17,412,426
第2期	1,491,997,945	272,427,188
第3期	510,495,142	343,373,820
第4期	564,497,467	452,619,030
第5期	586,168,237	329,442,755
第6期（中間期）	353,379,442	366,095,007

（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

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

2021年11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	10,205,871,987	86.37
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,610,900,147	13.63
合計（純資産総額）		11,816,772,134	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年11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	11,321,516,817	45.63
	フランス	2,391,129,788	9.64
	イタリア	2,177,537,396	8.78
	ドイツ	1,752,379,912	7.06
	イギリス	1,480,635,532	5.97
	スペイン	1,417,817,634	5.71
	ベルギー	542,971,861	2.19
	カナダ	474,655,197	1.91

	オランダ	454,498,989	1.83
	オーストラリア	418,900,790	1.69
	オーストリア	346,351,471	1.40
	シンガポール	220,365,717	0.89
	アイルランド	187,701,892	0.76
	メキシコ	156,859,419	0.63
	フィンランド	148,036,916	0.60
	デンマーク	119,376,106	0.48
	イスラエル	115,943,153	0.47
	ポーランド	115,370,878	0.47
	スウェーデン	70,198,668	0.28
	ノルウェー	57,843,719	0.23
	中国	53,820,691	0.22
	小計	24,023,912,546	96.83
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	785,889,036	3.17
合計（純資産総額）		24,809,801,582	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	23,972,055,792	△96.62
為替予約取引	買建	日本	100,295,605	0.40

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2021年11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	192,569,963,990	97.72
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,484,355,762	2.28
合計（純資産総額）		197,054,319,752	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	4,815,840,000	2.44
合計	買建	-	4,815,840,000	2.44

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年11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	240,992,682,497	68.11
	イギリス	13,606,340,116	3.85
	カナダ	12,179,019,694	3.44
	スイス	11,311,330,095	3.20
	フランス	10,634,812,213	3.01

	ドイツ	8,881,824,981	2.51
	オランダ	6,875,515,504	1.94
	アイルランド	6,398,502,149	1.81
	オーストラリア	5,937,256,578	1.68
	スウェーデン	3,533,652,800	1.00
	デンマーク	2,729,313,359	0.77
	スペイン	2,319,148,033	0.66
	香港	2,172,666,053	0.61
	イタリア	1,816,938,337	0.51
	ジャージー	1,330,566,184	0.38
	フィンランド	1,252,791,358	0.35
	シンガポール	906,932,517	0.26
	バミューダ	833,860,206	0.24
	ベルギー	808,919,151	0.23
	イスラエル	651,304,563	0.18
	ノルウェー	649,762,216	0.18
	ケイマン諸島	627,989,297	0.18
	ニュージーランド	328,110,783	0.09
	ルクセンブルグ	298,278,896	0.08
	オランダ領キュラソー	247,747,213	0.07
	オーストリア	230,234,552	0.07
	ポルトガル	164,453,730	0.05
	パナマ	99,493,339	0.03
	リベリア	94,541,971	0.03
	マン島	76,383,648	0.02
	パプアニューギニア	33,570,037	0.01
	小計	338,023,942,070	95.54
投資証券	アメリカ	6,866,548,098	1.94
	オーストラリア	761,167,513	0.22
	イギリス	228,328,018	0.06
	香港	162,478,398	0.05
	フランス	143,437,672	0.04
	シンガポール	141,270,629	0.04
	カナダ	35,412,974	0.01
	小計	8,338,643,302	2.36
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	7,455,651,420	2.10
合計（純資産総額）		353,818,236,792	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	323,504,820	0.09
合計	買建	-	323,504,820	0.09

株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,138,863,153	0.32
合計	買建	-	1,138,863,153	0.32
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,899,958,610	1.67
合計	買建	-	5,899,958,610	1.67
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	249,231,075	0.07
合計	買建	-	249,231,075	0.07

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	1,264,474,782	0.36

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年11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	8,552,350,950	98.68
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	114,430,924	1.32
合計（純資産総額）		8,666,781,874	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	40,050,000	0.46
合計	買建	-	40,050,000	0.46

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年11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	13,445,604,364	75.39
	オーストラリア	1,187,213,137	6.66
	イギリス	976,904,600	5.48
	シンガポール	581,248,838	3.26
	カナダ	334,183,017	1.87
	フランス	303,246,173	1.70
	香港	248,703,182	1.39
	ベルギー	235,866,884	1.32
	スペイン	72,203,806	0.40
	ニュージーランド	63,082,786	0.35
	ドイツ	51,324,090	0.29
	韓国	30,350,182	0.17
	オランダ	28,164,993	0.16
	ガーンジー	27,673,561	0.16
	アイルランド	17,965,768	0.10
	イスラエル	12,970,856	0.07

	イタリア	4,009,104	0.02
	小計	17,620,715,341	98.81
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	213,027,923	1.19
合計（純資産総額）		17,833,743,264	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	買建	日本	85,109,970	0.48

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年11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	74,700,988,936	46.42
	フランス	15,742,034,456	9.78
	イタリア	14,282,328,029	8.88
	ドイツ	11,579,902,147	7.20
	イギリス	9,768,351,409	6.07
	スペイン	9,331,272,390	5.80
	ベルギー	3,627,062,246	2.25
	カナダ	3,146,976,400	1.96
	オランダ	3,010,384,072	1.87
	オーストラリア	2,746,045,255	1.71
	オーストリア	2,283,317,920	1.42
	アイルランド	1,314,957,693	0.82
	メキシコ	1,038,827,896	0.65
	フィンランド	932,112,652	0.58
	デンマーク	805,998,844	0.50
	ポーランド	791,062,892	0.49
	イスラエル	751,730,558	0.47
	マレーシア	749,247,227	0.47
	シンガポール	688,095,193	0.43
	スウェーデン	454,627,468	0.28
	ノルウェー	381,175,143	0.24
	中国	341,448,732	0.21
	小計	158,467,947,558	98.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,441,902,297	1.52
合計（純資産総額）		160,909,849,855	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2021年11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	3 6 1 1 0 年国債	630,000,000	100.79	635,004,000	100.86	635,411,700	0.100	2030/12/20	5.38
日本	国債 証券	3 5 4 1 0 年国債	590,000,000	101.08	596,394,000	101.32	597,793,900	0.100	2029/03/20	5.06
日本	国債 証券	3 6 4 1 0 年国債	590,000,000	100.18	591,067,400	100.44	592,584,200	0.100	2031/09/20	5.01
日本	国債 証券	3 6 0 1 0 年国債	540,000,000	100.73	543,967,200	101.01	545,470,200	0.100	2030/09/20	4.62
日本	国債 証券	3 6 3 1 0 年国債	510,000,000	100.49	512,498,600	100.57	512,907,000	0.100	2031/06/20	4.34
日本	国債 証券	1 5 1 2 0 年国債	430,000,000	112.88	485,402,400	112.94	485,620,500	1.200	2034/12/20	4.11
日本	国債 証券	3 6 2 1 0 年国債	410,000,000	100.62	412,544,800	100.74	413,042,200	0.100	2031/03/20	3.50
日本	国債 証券	1 5 9 2 0 年国債	380,000,000	104.45	396,918,200	104.85	398,426,200	0.600	2036/12/20	3.37
日本	国債 証券	1 4 7 2 0 年国債	315,000,000	117.73	370,833,850	117.23	369,287,100	1.600	2033/12/20	3.13
日本	国債 証券	1 4 2 2 0 年国債	292,000,000	118.48	345,958,680	118.52	346,072,560	1.800	2032/12/20	2.93
日本	国債 証券	3 5 7 1 0 年国債	315,000,000	100.65	317,040,000	101.25	318,946,950	0.100	2029/12/20	2.70
日本	国債 証券	3 5 8 1 0 年国債	310,000,000	100.56	311,736,000	101.21	313,741,700	0.100	2030/03/20	2.66
日本	国債 証券	1 6 3 2 0 年国債	300,000,000	103.78	311,341,500	104.51	313,542,000	0.600	2037/12/20	2.65
日本	国債 証券	3 5 3 1 0 年国債	270,000,000	101.16	273,131,000	101.31	273,542,400	0.100	2028/12/20	2.31
日本	国債 証券	1 6 8 2 0 年国債	270,000,000	101.56	274,221,000	100.65	271,757,700	0.400	2039/03/20	2.30
日本	国債 証券	3 5 5 1 0 年国債	250,000,000	100.82	252,044,500	101.33	253,320,000	0.100	2029/06/20	2.14
日本	国債 証券	5 2 3 0 年国債	250,000,000	99.12	247,800,700	98.59	246,462,500	0.500	2046/09/20	2.09
日本	国債 証券	1 7 8 2 0 年国債	230,000,000	100.57	231,314,600	100.91	232,090,700	0.500	2041/09/20	1.96
日本	国債 証券	1 5 7 2 0 年国債	230,000,000	99.83	229,602,600	99.23	228,224,400	0.200	2036/06/20	1.93
日本	国債 証券	4 2 3 0 年国債	150,000,000	124.13	186,195,000	125.20	187,806,000	1.700	2044/03/20	1.59
日本	国債 証券	4 6 3 0 年国債	150,000,000	121.25	181,870,500	121.37	182,061,000	1.500	2045/03/20	1.54
日本	国債 証券	3 5 9 1 0 年国債	180,000,000	100.99	181,786,800	101.11	182,005,200	0.100	2030/06/20	1.54
日本	国債 証券	6 4 3 0 年国債	170,000,000	93.28	158,576,200	93.67	159,242,400	0.400	2049/09/20	1.35
日本	国債 証券	1 7 3 2 0 年国債	150,000,000	99.21	148,817,400	99.83	149,740,500	0.400	2040/06/20	1.27
日本	国債 証券	3 5 6 1 0 年国債	140,000,000	100.78	141,092,000	101.29	141,811,600	0.100	2029/09/20	1.20

日本	国債 証券	1762 0年国債	140,000,000	101.18	141,657,500	101.16	141,619,800	0.500	2041/03/20	1.20
日本	国債 証券	3630 年国債	100,000,000	129.03	129,028,000	129.80	129,795,000	2.000	2042/03/20	1.10
日本	国債 証券	5730 年国債	120,000,000	103.78	124,531,200	104.98	125,974,800	0.800	2047/12/20	1.07
日本	国債 証券	1712 0年国債	120,000,000	98.55	118,260,700	98.40	118,078,800	0.300	2039/12/20	1.00
日本	国債 証券	5830 年国債	110,000,000	103.69	114,054,600	104.90	115,390,000	0.800	2048/03/20	0.98

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	86.37
合 計	86.37

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11月30日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,650,000	11,371.22	187,625,173	11,361.41	187,463,322	0.125	2023/01/31	0.76
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,220,000	11,745.42	143,294,112	11,508.97	140,409,473	1.625	2031/05/15	0.57
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,200,000	11,368.56	136,422,673	11,356.07	136,272,795	0.125	2023/02/28	0.55
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,220,000	11,215.03	136,823,357	11,025.45	134,510,498	1.125	2031/02/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,150,000	11,616.09	133,585,089	11,557.78	132,914,476	1.500	2023/03/31	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,150,000	11,651.20	133,988,838	11,529.34	132,587,387	1.250	2024/08/31	0.53
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,170,000	11,354.47	132,847,294	11,328.53	132,543,847	0.125	2023/07/15	0.53
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,080,000	11,514.32	124,354,696	11,276.54	121,786,643	1.250	2028/06/30	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,080,000	11,101.90	119,900,564	10,914.75	117,879,326	0.500	2027/06/30	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,685.87	116,858,678	11,615.58	116,155,756	2.000	2023/02/15	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,030,000	11,317.84	116,573,747	11,265.39	116,033,533	0.125	2024/02/15	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,425.00	114,249,967	11,240.02	112,400,209	0.875	2026/06/30	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	980,000	11,375.67	111,481,532	11,301.80	110,757,620	0.375	2024/04/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	990,000	11,152.96	110,414,344	11,103.61	109,925,745	1.250	2031/08/15	0.44

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	11,621.43	110,403,563	11,556.98	109,791,349	1.375	2023/06/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,014.78	110,147,765	10,798.71	107,987,070	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	12,034.29	108,308,595	11,912.52	107,212,638	2.875	2023/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,996.51	107,968,618	11,876.91	106,892,148	2.750	2023/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	940,000	11,365.45	106,835,184	11,343.67	106,630,454	0.125	2023/04/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,928.52	107,356,659	11,822.64	106,403,733	2.750	2023/07/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,840.08	106,560,714	11,628.43	104,655,885	1.625	2026/09/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	910,000	11,364.56	103,417,462	11,323.19	103,040,999	0.250	2023/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	880,000	11,651.20	102,530,590	11,585.43	101,951,754	1.625	2023/04/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	11,331.23	100,847,904	11,258.34	100,199,207	0.250	2024/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	860,000	11,832.97	101,763,532	11,623.20	99,959,505	1.625	2026/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	920,000	10,817.04	99,516,751	10,608.14	97,594,909	0.625	2030/05/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	810,000	12,199.57	98,816,545	11,946.65	96,767,835	2.250	2041/05/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	870,000	11,224.67	97,654,597	11,089.84	96,481,647	0.500	2026/02/28	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	760,000	12,601.36	95,770,337	12,659.53	96,212,421	2.375	2051/05/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,508.97	96,675,374	11,252.54	94,521,299	1.875	2041/02/15	0.38

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.83
合 計	96.83

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11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	3,691,100	1,426.77	5,266,336,091	2,001.00	7,385,891,100	3.75
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	456,500	9,832.15	4,488,375,098	13,825.00	6,311,112,500	3.20
日本	株式	キーエンス	電気機器	66,000	53,933.11	3,559,585,584	70,330.00	4,641,780,000	2.36

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	537,400	4,721.95	2,537,574,039	6,901.00	3,708,597,400	1.88
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,609,100	455.27	2,098,401,221	601.40	2,771,912,740	1.41
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	46,200	37,463.08	1,730,794,088	59,840.00	2,764,608,000	1.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	836,500	2,494.50	2,086,648,036	3,125.00	2,614,062,500	1.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	429,100	7,293.80	3,129,770,230	6,030.00	2,587,473,000	1.31
日本	株式	HOYA	精密機器	142,300	14,014.68	1,994,289,470	18,020.00	2,564,246,000	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	188,900	13,233.44	2,499,796,108	13,000.00	2,455,700,000	1.25
日本	株式	日立製作所	電気機器	350,500	4,092.78	1,434,521,003	6,688.00	2,344,144,000	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	122,600	17,343.66	2,126,332,456	19,000.00	2,329,400,000	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	92,900	23,645.25	2,196,643,538	23,150.00	2,150,635,000	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	41,200	59,264.62	2,441,702,452	50,100.00	2,064,120,000	1.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	497,600	3,075.25	1,530,245,665	3,703.00	1,842,612,800	0.94
日本	株式	三菱商事	卸売業	537,700	2,681.65	1,441,924,619	3,391.00	1,823,340,700	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	214,000	9,123.44	1,952,416,660	8,380.00	1,793,320,000	0.91
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	573,800	2,896.18	1,661,825,286	3,101.00	1,779,353,800	0.90
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	572,500	3,738.56	2,140,327,531	3,031.00	1,735,247,500	0.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	521,600	3,023.34	1,576,975,414	3,300.00	1,721,280,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,083,900	1,389.29	1,505,851,798	1,562.50	1,693,593,750	0.86
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	501,700	2,787.16	1,398,319,581	3,260.00	1,635,542,000	0.83
日本	株式	第一三共	医薬品	572,500	3,641.81	2,084,934,764	2,824.50	1,617,026,250	0.82
日本	株式	SMC	機械	21,300	66,395.84	1,414,231,344	72,650.00	1,547,445,000	0.79
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	82,300	17,770.83	1,462,539,166	17,840.00	1,468,232,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	557,000	1,817.71	1,012,465,970	2,557.00	1,424,249,000	0.72
日本	株式	ファナック	電気機器	64,000	25,328.45	1,621,020,788	22,245.00	1,423,680,000	0.72
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	236,700	5,211.43	1,233,545,717	5,708.00	1,351,083,600	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	160,500	5,080.71	815,454,019	8,331.00	1,337,125,500	0.68
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	919,400	1,339.33	1,231,380,732	1,402.00	1,288,998,800	0.65

ロ 種類別投資比率

2021年11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	0.22
	建設業	2.13

	食料品	3.18
	繊維製品	0.45
	パルプ・紙	0.20
	化学	6.64
	医薬品	4.71
	石油・石炭製品	0.40
	ゴム製品	0.64
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.70
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.62
	機械	5.24
	電気機器	19.35
	輸送用機器	7.89
	精密機器	2.95
	その他製品	2.13
	電気・ガス業	1.05
	陸運業	2.92
	海運業	0.42
	空運業	0.37
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	8.42
	卸売業	4.98
	小売業	4.10
	銀行業	4.55
	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	1.87
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.83
	サービス業	6.27
合 計		97.72

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11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	892,929	13,404.29	11,969,081,063	18,230.50	16,278,546,420	4.60
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	382,865	24,935.46	9,546,914,169	38,298.40	14,663,115,039	4.14
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	24,297	366,563.66	8,906,397,313	405,199.82	9,845,139,999	2.78

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	43,870	69,623.81	3,054,396,416	129,355.35	5,674,819,305	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	16,111	208,282.24	3,355,635,100	331,140.10	5,334,998,146	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	15,603	208,693.87	3,256,250,478	332,467.80	5,187,495,014	1.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	133,564	15,737.54	2,101,968,515	37,971.88	5,071,675,539	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	128,402	31,875.80	4,092,915,927	38,457.67	4,938,042,141	1.40
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	161,884	14,048.19	2,274,177,974	18,343.14	2,969,460,406	0.84
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	57,104	31,779.10	1,814,713,480	46,283.91	2,642,996,476	0.75
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	50,662	38,859.11	1,968,680,330	51,424.04	2,605,244,714	0.74
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	141,374	16,535.52	2,337,692,471	18,174.76	2,569,438,166	0.73
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバ コ	154,736	12,704.69	1,965,873,347	14,802.33	2,290,452,561	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	71,257	26,627.09	1,897,366,570	32,096.79	2,287,121,136	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用 品・パー ソナル用 品	131,539	15,776.34	2,075,204,074	16,954.01	2,230,112,916	0.63
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	414,347	3,387.32	1,403,524,747	5,186.77	2,149,124,370	0.61
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	22,544	48,812.61	1,100,431,539	90,503.37	2,040,307,928	0.58
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフト ウェア・ サービス	90,892	24,029.63	2,184,101,199	22,331.91	2,029,792,263	0.57
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフト ウェア・ サービス	25,702	54,913.14	1,411,377,500	78,215.74	2,010,300,880	0.57
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディ ア・娯楽	23,852	56,531.70	1,348,393,998	75,525.08	1,801,424,131	0.51

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	301,201	4,290.34	1,292,254,746	5,961.55	1,795,624,219	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	52,257	28,061.29	1,466,399,058	33,760.11	1,764,202,057	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	47,560	38,654.05	1,838,386,644	36,748.85	1,747,775,196	0.49
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	37,796	37,637.02	1,422,528,823	44,061.88	1,665,362,627	0.47
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	97,683	16,871.24	1,648,033,286	16,816.34	1,642,670,901	0.46
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	227,812	4,716.80	1,074,544,534	7,007.09	1,596,300,166	0.45
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	21,163	52,161.23	1,103,888,034	73,810.56	1,562,052,942	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	23,846	44,558.32	1,062,537,780	63,128.70	1,505,366,922	0.43
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	246,863	5,911.36	1,459,296,549	5,862.57	1,447,251,148	0.41
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	226,938	4,933.30	1,119,552,623	6,343.82	1,439,652,733	0.41

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式（外国）	エネルギー	3.22
	素材	3.96
	資本財	5.89
	商業・専門サービス	1.24
	運輸	1.86
	自動車・自動車部品	2.54
	耐久消費財・アパレル	1.90
	消費者サービス	1.69
	小売	5.73

	食品・生活必需品小売り	1.43
	食品・飲料・タバコ	3.56
	家庭用品・パーソナル用品	1.65
	ヘルスケア機器・サービス	4.46
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエ ンス	7.69
	銀行	5.76
	各種金融	4.61
	保険	2.81
	不動産	0.37
	ソフトウェア・サービス	12.36
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.12
	半導体・半導体製造装置	5.51
	電気通信サービス	1.42
	公益事業	2.73
	メディア・娯楽	7.00
投資証券	—	2.36
合 計		97.89

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11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	884	702,369.74	620,894,850	700,000.00	618,800,000	7.14
日本	投資証 券	ジャパンリアル エステイト投資 法人	780	661,442.39	515,925,068	655,000.00	510,900,000	5.89
日本	投資証 券	日本プロロジス リート投資法人	1,235	376,905.28	465,478,024	369,500.00	456,332,500	5.27
日本	投資証 券	G L P投資法人	2,525	190,929.08	482,095,931	180,300.00	455,257,500	5.25
日本	投資証 券	野村不動産マス ターファンド投 資法人	2,521	167,097.81	421,253,585	161,400.00	406,889,400	4.69
日本	投資証 券	日本都市ファン ド投資法人	3,935	106,555.95	419,297,679	97,800.00	384,843,000	4.44
日本	投資証 券	大和ハウスリー ト投資法人	1,171	316,594.15	370,731,747	323,500.00	378,818,500	4.37
日本	投資証 券	オリックス不動 産投資法人	1,554	195,225.71	303,380,756	180,500.00	280,497,000	3.24
日本	投資証 券	アドバンス・レ ジデンス投資法 人	780	360,885.61	281,490,778	348,500.00	271,830,000	3.14
日本	投資証 券	ユナイテッド・ アーバン投資法 人	1,757	151,644.64	266,439,631	144,600.00	254,062,200	2.93

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,107	210,820.62	233,378,428	202,800.00	224,499,600	2.59
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	512	401,013.37	205,318,844	404,500.00	207,104,000	2.39
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,370	91,447.37	216,730,278	82,500.00	195,525,000	2.26
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	416	451,082.48	187,650,311	432,000.00	179,712,000	2.07
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	956	190,624.00	182,236,545	187,200.00	178,963,200	2.06
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	290	608,757.88	176,539,786	583,000.00	169,070,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	269	657,081.54	176,754,935	620,000.00	166,780,000	1.92
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	241	763,432.85	183,987,317	689,000.00	166,049,000	1.92
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	509	337,470.69	171,772,579	314,000.00	159,826,000	1.84
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,393	63,276.04	151,419,572	58,600.00	140,229,800	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	919	149,886.57	137,745,761	152,000.00	139,688,000	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	919	156,084.91	143,442,031	150,400.00	138,217,600	1.59
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	273	477,646.82	130,397,583	497,000.00	135,681,000	1.57
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,439	40,934.29	140,773,009	38,050.00	130,853,950	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	728	182,515.00	132,870,923	166,700.00	121,357,600	1.40
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	164	760,911.22	124,789,440	714,000.00	117,096,000	1.35
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,044	117,651.63	122,828,305	109,400.00	114,213,600	1.32
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	748	153,228.11	114,614,628	150,200.00	112,349,600	1.30
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	352	341,668.07	120,267,162	319,000.00	112,288,000	1.30
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	534	225,458.39	120,394,779	206,100.00	110,057,400	1.27

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.68
合 計	98.68

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11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	71,376	15,010.34	1,071,377,998	17,438.67	1,244,702,195	6.98
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	8,642	93,236.80	805,752,456	93,291.40	806,224,278	4.52
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,898	15,293.16	487,821,133	18,196.37	580,427,931	3.25
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	14,681	36,235.52	531,973,707	37,759.13	554,341,718	3.11
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	27,474	18,327.84	503,539,199	19,203.24	527,589,769	2.96
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	53,234	7,796.68	415,048,339	7,941.15	422,738,966	2.37
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	40,869	9,613.87	392,909,428	9,333.69	381,458,609	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,382	25,351.59	339,254,911	27,393.54	366,580,360	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	162,179	1,869.12	303,131,608	1,995.67	323,655,683	1.81
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	32,661	9,340.99	305,086,168	9,809.25	320,379,894	1.80
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,440	23,247.83	312,450,894	23,352.43	313,856,661	1.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,843	20,356.12	261,433,672	23,101.00	296,686,123	1.66
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,272	21,339.42	240,537,997	23,891.70	269,307,242	1.51
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	55,256	4,562.82	252,123,396	4,695.29	259,442,828	1.45
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	11,109	22,397.76	248,816,739	22,384.25	248,666,605	1.39
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	114,661	1,937.01	222,099,120	2,148.36	246,333,449	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,234	36,058.58	224,789,201	39,421.31	245,752,415	1.38
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	36,138	5,693.90	205,766,011	6,763.63	244,423,934	1.37
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	38,290	6,215.84	238,004,382	5,588.38	213,979,162	1.20
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,620	3,994.75	206,209,206	3,875.01	200,027,820	1.12
香港	投資証券	LINK REIT	198,400	1,058.91	210,088,267	1,002.33	198,862,867	1.12

アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	60,235	3,353.48	201,996,741	3,200.35	192,773,088	1.08
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	9,640	16,409.54	158,187,966	19,210.06	185,185,021	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	26,971	5,967.55	160,950,798	6,538.36	176,346,158	0.99
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	13,850	13,014.64	180,252,752	12,553.38	173,864,337	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,873	9,388.46	158,411,441	9,649.97	162,823,967	0.91
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	60,030	2,484.61	149,151,408	2,648.57	158,993,392	0.89
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	17,737	8,731.95	154,878,630	8,959.39	158,912,656	0.89
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	28,370	5,226.29	148,269,712	5,331.26	151,247,908	0.85
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	56,657	2,300.19	130,321,790	2,444.92	138,521,679	0.78

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.81
合 計	98.81

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11月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,950,000	11,922.18	1,782,366,328	11,623.20	1,737,668,142	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,213.39	1,624,380,952	11,927.08	1,586,301,367	2.250	2026/03/31	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,944.72	1,165,024,923	12,429.37	1,118,643,525	2.875	2028/05/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,314.93	1,046,768,930	12,035.61	1,023,027,235	2.500	2026/02/28	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	10,829.87	920,538,668	11,025.45	937,163,309	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	11,081.20	975,145,424	10,581.86	931,203,809	0.625	2030/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,367.22	909,377,835	11,320.46	905,636,504	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,402.78	878,013,757	11,356.07	874,417,106	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,314.09	871,184,559	11,265.39	867,435,155	0.125	2024/02/15	0.54

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,800,000	11,185.87	872,497,579	10,793.02	841,855,450	0.375	2027/09/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	11,725.39	832,502,802	11,493.84	816,062,767	1.375	2026/08/31	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	11,113.02	833,476,357	10,608.14	795,610,675	0.625	2030/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	10,982.85	790,765,472	10,906.79	785,288,778	0.625	2027/12/31	0.49
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	13,210.70	766,220,792	13,322.54	772,707,175	0.000	2030/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	12,096.06	786,244,030	11,769.39	765,010,527	2.125	2024/03/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	14,909.20	805,096,960	14,024.77	757,337,537	3.000	2048/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,941.66	765,916,415	10,798.71	755,909,496	0.875	2030/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	10,904.85	730,625,251	10,978.81	735,579,935	0.750	2028/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	11,989.08	743,323,121	11,681.33	724,242,754	1.750	2024/06/30	0.45
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000	16,410.80	722,075,112	15,738.83	692,508,452	3.500	2030/03/01	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,265.83	699,152,203	11,885.78	677,489,428	2.500	2024/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,265.83	686,886,375	11,873.38	664,909,196	2.375	2024/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,686.42	619,812,133	11,337.86	657,596,060	1.875	2051/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,204.13	661,043,519	11,085.41	654,039,041	1.000	2028/07/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,361.89	647,627,728	11,304.98	644,384,064	0.125	2023/10/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,124.59	629,980,487	13,052.62	626,525,744	0.000	2024/03/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,298.71	627,234,455	11,919.57	607,898,025	2.750	2024/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,260.42	625,281,626	11,854.72	604,590,731	2.250	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,042.66	626,047,867	12,326.18	591,656,789	2.750	2028/02/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,369.82	618,491,053	11,824.00	591,200,116	2.000	2026/11/15	0.37

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.48
合 計	98.48

②投資不動産物件

日本国債ダイナミック・アロケーション・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。

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。

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。

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。

③その他投資資産の主要なもの

日本国債ダイナミック・アロケーション・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11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	99,790,948.43	11,381,793,150	11,351,090,670	△45.75
	ユーロ	売建	72,860,033.49	9,609,560,767	9,357,319,382	△37.72
	イギリス・ポンド	売建	9,600,200.85	1,497,888,053	1,455,006,440	△5.86
	カナダ・ドル	売建	5,320,000.00	490,115,045	474,806,276	△1.91
	オーストラリア・ドル	売建	5,110,048.40	437,702,917	415,368,751	△1.67
	シンガポール・ドル	売建	2,640,000.00	223,060,953	219,625,032	△0.89
	メキシコ・ペソ	売建	30,970,000.00	170,738,946	162,323,061	△0.65
	ポーランド・ズロチ	売建	4,380,000.00	125,163,801	120,209,976	△0.48
	デンマーク・クローネ	売建	6,910,000.00	122,498,441	119,354,357	△0.48
	イスラエル・シェケル	売建	3,190,000.00	115,378,992	114,903,162	△0.46
	スウェーデン・クローナ	売建	5,600,000.00	74,274,732	70,183,120	△0.28

ノルウェー・クローネ	売建	4,620,000.00	62,392,133	58,245,726	△0.23
オフショア・人民元	売建	3,010,000.00	53,464,023	53,619,839	△0.22
アメリカ・ドル	買建	422,327.00	47,974,070	48,045,904	0.19
ユーロ	買建	320,315.00	41,021,114	41,133,154	0.17
イギリス・ポンド	買建	29,251.00	4,429,141	4,433,281	0.02
シンガポール・ドル	買建	41,433.54	3,433,638	3,447,489	0.01
オーストラリア・ドル	買建	39,806.00	3,227,985	3,235,777	0.01

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2021年11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	254	日本・円	5,076,959,400	4,815,840,000	2.44

（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11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 INDEX DEC 21 2021年12 月	買建	30	イギリス・ポ ンド	2,171,290.00	329,080,712	2,134,500.00	323,504,820	0.09
	ドイツ	EU REX	EUROST OX 50 DEC 21 2021年12 月	買建	216	ユーロ	9,227,192.00	1,184,863,724	8,868,960.00	1,138,863,153	0.32

アメリカ	シカゴ商品取引所	S & P 500 EMINI FUT DEC 21 2021年12月	買建	223	アメリカ・ドル	51,636,869.00	5,874,726,586	51,858,650.00	5,899,958,610	1.67
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES DEC 21 2021年12月	買建	17	オーストラリア・ドル	3,131,101.50	254,527,240	3,065,950.00	249,231,075	0.07

（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11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	8,370,000.00	952,169,526	952,205,922	0.27
	ユーロ	買建	1,060,000.00	136,120,067	136,120,617	0.04
	イギリス・ポンド	買建	290,000.00	43,988,230	43,952,400	0.01
	カナダ・ドル	買建	470,000.00	41,953,946	41,950,840	0.01
	スイス・フラン	買建	250,000.00	30,751,765	30,813,540	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	350,000.00	28,422,056	28,450,989	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	870,000.00	10,871,469	10,901,754	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	410,000.00	7,079,634	7,080,999	0.00
	香港・ドル	買建	480,000.00	7,003,200	7,002,864	0.00
	シンガポール・ドル	買建	40,000.00	3,321,476	3,328,212	0.00
	ノルウェー・クローネ	買建	150,000.00	1,893,189	1,891,392	0.00
	ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	775,611	775,253	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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年11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	TREI 先 物 0312 月 2021年 12月	買建	20	日本・円	42,968,400	40,050,000	0.46
--------------	----	-----------	---------------------------------------	----	----	------	------------	------------	------

（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11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	606,541.15	69,000,000	69,002,662	0.39
	オーストラ リア・ドル	買建	59,127.86	4,800,000	4,806,426	0.03
	イギリス・ ポンド	買建	28,347.68	4,300,000	4,296,374	0.02
	ユーロ	買建	24,919.17	3,200,000	3,199,987	0.02
	シンガポー ル・ドル	買建	27,698.53	2,300,000	2,304,664	0.01
	カナダ・ド ル	買建	16,803.75	1,500,000	1,499,857	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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

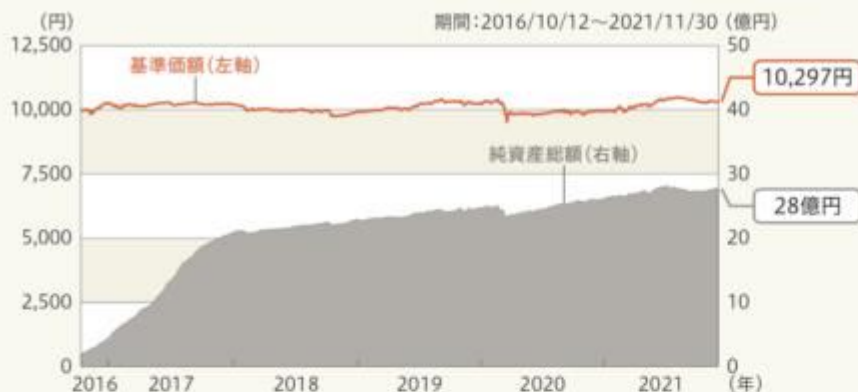
該当事項はありません。

《参考情報》

基準日:2021年11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4月	0円
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4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

■イオン・バランス戦略ファンド

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	97.08
投資証券	アメリカ	1.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.18
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	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	43.69
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	35.63
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	5.49
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	5.15
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	3.54
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	1.89
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1.74
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)	1.69

※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。

▶投資対象とする投資信託の現況

■日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	5.38
日本	国債証券	354 10年国債	0.100	2029/03/20	5.06
日本	国債証券	364 10年国債	0.100	2031/09/20	5.01
日本	国債証券	360 10年国債	0.100	2030/09/20	4.62
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	4.34
日本	国債証券	151 20年国債	1.200	2034/12/20	4.11
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	3.50
日本	国債証券	159 20年国債	0.600	2036/12/20	3.37
日本	国債証券	147 20年国債	1.600	2033/12/20	3.13
日本	国債証券	142 20年国債	1.800	2032/12/20	2.93

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/01/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/02/28	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2023/03/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2024/08/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/07/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2028/06/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2027/06/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	0.47

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.75
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3.20
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.88
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.41
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.31
日本	株式	HOYA	精密機器	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	1.25

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、指数先物取引の買建て(2.44%)を行っています。

外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア および機器	4.60
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.14
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.78
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.40
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.84
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	0.75

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の買建て(2.15%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■ Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.14
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.89
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5.27
日本	投資証券	GLP投資法人	5.25
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.69
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.37
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.24
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.14
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.93

※上記のほか、Jリート・インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の買建て(0.46%)を行っています。

■ 外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.98
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.52
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.25
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.11
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.96
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2.37
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.81
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	1.80

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・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。

※2016年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2016年10月12日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2021年のファンドの収益率は、年初から2021年11月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。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、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

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

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる

口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が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

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.76%（税抜き1.6%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

※累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

※申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、委託会社の指定する口座を経由して、追加設定が行われる日に、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け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「みらいパレ」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】

2016年10月12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4月27日から翌年4月26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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- （ニ）書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（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、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- （ヘ）上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決

議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ニ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、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5期（2020年 4月28日から2021年 4月26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】

【イオン・バランス戦略ファンド】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2020年 4月27日現在)	第5期 (2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	678,280	1,363,526
金銭信託	18,262,109	14,421,157
コール・ローン	18,721,946	33,093,022
投資証券	-	108,019,311
親投資信託受益証券	2,365,759,042	2,583,282,312
未収入金	2,000,000	165,500,000
流動資産合計	2,405,421,377	2,905,679,328
資産合計	2,405,421,377	2,905,679,328
負債の部		
流動負債		
未払金	-	160,000,000
未払解約金	3,283,434	2,199,845
未払受託者報酬	403,837	431,454
未払委託者報酬	11,442,040	12,224,580
未払利息	54	95
その他未払費用	83,728	87,549
流動負債合計	15,213,093	174,943,523
負債合計	15,213,093	174,943,523
純資産の部		
元本等		
元本	2,422,786,770	2,679,512,252
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△32,578,486	51,223,553
元本等合計	2,390,208,284	2,730,735,805
純資産合計	2,390,208,284	2,730,735,805
負債純資産合計	2,405,421,377	2,905,679,328

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	第5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
営業収益		
受取配当金	3,497,558	2,271,368
受取利息	2,520	-
有価証券売買等損益	△20,629,150	108,243,389
為替差損益	△8,516,161	189,724
営業収益合計	△25,645,233	110,704,481
営業費用		
支払利息	25,798	31,518
受託者報酬	792,002	842,096
委託者報酬	22,440,050	23,859,401
その他費用	248,409	224,459
営業費用合計	23,506,259	24,957,474
営業利益又は営業損失（△）	△49,151,492	85,747,007
経常利益又は経常損失（△）	△49,151,492	85,747,007
当期純利益又は当期純損失（△）	△49,151,492	85,747,007
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（△）	6,583,357	3,639,276
期首剰余金又は期首欠損金（△）	16,772,702	△32,578,486
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,399,260	4,257,471
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,257,471
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,399,260	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,015,599	2,563,163
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,015,599	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,563,163
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△32,578,486	51,223,553

(3) 【注記表】
(重要な会計方針の注記)

項 目	第5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (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	(1) 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。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2020年 4月28日から2021年 4月26日までとなっております。

(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4期 (2020年 4月27日現在)	第5期 (2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,422,786,770口	2,679,512,252口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 32,578,486円	元本の欠損 —
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9866円 (10,000口当たりの純資産額 9,866円)	1口当たり純資産額 1.0191円 (10,000口当たりの純資産額 10,191円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第4期 自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	第5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（18,068,114円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（31,108,414円）、および分配準備積立金（29,724,319円）より、分配対象収益は78,900,847円（1万口当たり325.63円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,713,508円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（45,761,696円）、および分配準備積立金（42,110,764円）より、分配対象収益は116,585,968円（1万口当たり435.08円）ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク

項 目	第5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
	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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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5期 (2021年 4月26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。

項 目	第5期 (2021年 4月26日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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4期（自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	42,821,427円
合計	42,821,427円

第5期（自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△797,888円
親投資信託受益証券	40,305,815円
合計	39,507,927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5期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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4期 (2020年 4月27日現在)	第5期 (2021年 4月26日現在)
期首元本額	2,310,908,333円	2,422,786,770円
期中追加設定元本額	564,497,467円	586,168,237円
期中一部解約元本額	452,619,030円	329,442,755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

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	i シェアーズ J . P . モルガン ・ 米 ドル建てエマージング ・ マーケッ ト債券 E T F	8,985	1,001,198.55	
	米ドル 小計		8,985	1,001,198.55 (108,019,311)	
投資証券合計				108,019,311 (108,019,311)	
親投資信託 受益証券	日本円	国内株式インデックス ・ マザー ファンド（B号）	48,431,067	153,565,227	
		外国株式インデックス ・ マザー ファンド	53,042,866	269,643,409	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ ・ マ ザーファンド	536,817,606	802,005,503	
		外国債券パッシブ ・ マザーファン ド	82,884,377	159,908,828	
		J リート ・ インデックス ・ マザー ファンド	84,560,850	223,604,255	

	外国リート・インデックス・マザーファンド	44,687,417	105,712,553	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	36,830,971	64,398,952	
	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	679,027,252	804,443,585	
親投資信託受益証券合計		1,566,282,406	2,583,282,312	
合計			2,691,301,623 (108,019,311)	

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 1銘柄	4.0%	100.0%

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）

イオン・バランス戦略ファンドは、「日本国債ダイナミック・アロケーション・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」、「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」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。ただし、前計算期間末時点において、「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」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券への投資は行っておりません。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2020年 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		

流動資産		
金銭信託	2,204,151,395	832,397,711
コール・ローン	2,259,651,644	1,910,148,847
国債証券	7,674,767,370	8,709,913,925
未収入金	253,982,000	95,000,000
未収利息	4,837,451	8,369,486
前払費用	6,412,621	2,159,898
流動資産合計	12,403,802,481	11,557,989,867
資産合計	12,403,802,481	11,557,989,867
負債の部		
流動負債		
未払金	-	141,754,200
未払解約金	1,000,000	-
未払利息	6,518	5,528
その他未払費用	294,830	68,640
流動負債合計	1,301,348	141,828,368
負債合計	1,301,348	141,828,368
純資産の部		
元本等		
元本	10,376,629,913	9,636,327,340
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,025,871,220	1,779,834,159
元本等合計	12,402,501,133	11,416,161,499
純資産合計	12,402,501,133	11,416,161,499
負債純資産合計	12,403,802,481	11,557,989,867

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
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。

（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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,376,629,913口	9,636,327,340口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1952円 (10,000口当たりの純資産額 11,952円)	1口当たり純資産額 1.1847円 (10,000口当たりの純資産額 11,847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 4月28日 至 2021年 4月26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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27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	11,545,167,174円
同期中における追加設定元本額	2,630,542,334円
同期中における一部解約元本額	3,799,079,595円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	1,086,067,049円
SMAM・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,518,930,800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＞	771,632,064円
合計	10,376,629,913円

(2021年 4月26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	10,376,629,913円
同期中における追加設定元本額	1,606,344,773円
同期中における一部解約元本額	2,346,647,346円
2021年 4月26日現在における元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	679,027,252円
SMAM・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,456,022,763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＞	501,277,325円
合計	9,636,327,340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５回利付国債（４０年）	48,100,000	66,082,185	
	第６回利付国債（４０年）	50,000,000	67,764,500	
	第１０回利付国債（４０年）	70,000,000	75,312,300	
	第１２回利付国債（４０年）	30,000,000	28,330,200	
	第１３回利付国債（４０年）	50,000,000	47,159,000	
	第３５１回利付国債（１０年）	160,000,000	161,721,600	
	第３５２回利付国債（１０年）	310,000,000	313,220,900	
	第３５３回利付国債（１０年）	300,000,000	302,988,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	270,000,000	272,562,300	
	第３５５回利付国債（１０年）	400,000,000	403,420,000	
	第３５６回利付国債（１０年）	370,000,000	372,948,900	
	第３５７回利付国債（１０年）	315,000,000	317,312,100	
	第３５８回利付国債（１０年）	260,000,000	261,729,000	
	第３５９回利付国債（１０年）	560,000,000	563,315,200	
	第３６０回利付国債（１０年）	390,000,000	392,004,600	
	第３６１回利付国債（１０年）	560,000,000	562,144,800	
	第３６２回利付国債（１０年）	150,000,000	150,441,000	
	第３４回利付国債（３０年）	5,000,000	6,677,050	
	第３６回利付国債（３０年）	100,000,000	130,602,000	
	第４２回利付国債（３０年）	200,000,000	251,892,000	
	第４６回利付国債（３０年）	50,000,000	60,998,000	
	第５２回利付国債（３０年）	10,000,000	9,888,500	
	第５７回利付国債（３０年）	120,000,000	126,678,000	
	第５８回利付国債（３０年）	110,000,000	116,034,600	
	第６２回利付国債（３０年）	100,000,000	97,377,000	

第６４回利付国債（３０年）	100,000,000	94,345,000	
第６５回利付国債（３０年）	110,000,000	103,607,900	
第６７回利付国債（３０年）	110,000,000	109,052,900	
第６９回利付国債（３０年）	150,000,000	152,242,500	
第１４２回利付国債（２０年）	292,000,000	348,157,440	
第１４７回利付国債（２０年）	215,000,000	253,383,950	
第１５１回利付国債（２０年）	300,000,000	339,858,000	
第１５５回利付国債（２０年）	340,000,000	376,567,000	
第１５７回利付国債（２０年）	100,000,000	98,909,000	
第１５９回利付国債（２０年）	180,000,000	188,494,200	
第１６３回利付国債（２０年）	250,000,000	260,857,500	
第１６７回利付国債（２０年）	40,000,000	40,895,200	
第１６８回利付国債（２０年）	110,000,000	110,368,500	
第１７１回利付国債（２０年）	290,000,000	284,226,100	
第１７２回利付国債（２０年）	80,000,000	79,789,600	
第１７３回利付国債（２０年）	240,000,000	238,936,800	
第１７４回利付国債（２０年）	230,000,000	228,762,600	
第１７６回利付国債（２０年）	240,000,000	242,856,000	
合計	8,365,100,000	8,709,913,925	

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	32,532,938	68,082,064
金銭信託	159,106,806	80,177,155
コール・ローン	163,113,095	183,986,932
国債証券	25,938,280,709	18,913,583,233
派生商品評価勘定	229,869,827	232,914,277
未収入金	96,724,472	214,000,000
未収利息	161,207,253	119,105,342
前払費用	51,268,250	15,533,861
流動資産合計	26,832,103,350	19,827,382,864

資産合計	26,832,103,350	19,827,382,864
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,944,210	52,791,964
未払金	11,869,938	316,453,295
未払解約金	1,000,000	23,100,000
未払利息	470	532
その他未払費用	37,917	6,007
流動負債合計	34,852,535	392,351,798
負債合計	34,852,535	392,351,798
純資産の部		
元本等		
元本	17,571,381,562	13,008,296,854
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	9,225,869,253	6,426,734,212
元本等合計	26,797,250,815	19,435,031,066
純資産合計	26,797,250,815	19,435,031,066
負債純資産合計	26,832,103,350	19,827,382,864

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,571,381,562口	13,008,296,854口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5251円 (10,000口当たりの純資産額 15,251円)	1口当たり純資産額 1.4940円 (10,000口当たりの純資産額 14,940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 4月28日 至 2021年 4月26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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	26,365,178,617	-	26,157,253,000	207,925,617
	米ドル	13,266,376,055	-	13,253,699,700	12,676,355
	カナダドル	489,764,751	-	488,762,500	1,002,251
	メキシコペソ	182,319,145	-	173,401,800	8,917,345
	ユーロ	9,565,089,604	-	9,377,810,000	187,279,604
	英ポンド	1,657,387,598	-	1,652,853,600	4,533,998
	スウェーデンク ローナ	74,345,751	-	73,363,500	982,251
	ノルウェークロー ネ	57,075,892	-	56,018,900	1,056,992
	デンマーククロー ネ	127,934,163	-	125,580,000	2,354,163
	ポーランドズロチ	150,308,989	-	148,397,700	1,911,289
	オーストラリアドル	469,908,634	-	489,474,000	△19,565,366
	シンガポールドル	221,622,520	-	221,449,400	173,120
	南アフリカランド	103,045,515	-	96,441,900	6,603,615
合計		26,365,178,617	-	26,157,253,000	207,925,617

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	316,948,857	-	317,423,857	475,000
	米ドル	139,702,883	-	139,576,890	△125,993
	カナダドル	6,426,246	-	6,440,953	14,707
	メキシコペソ	2,393,749	-	2,400,916	7,167
	ユーロ	133,044,305	-	133,680,122	635,817
	英ポンド	20,781,467	-	20,693,234	△88,233
	スウェーデンク ローナ	1,310,073	-	1,313,093	3,020

デンマーククローネ	2,221,625	-	2,232,963	11,338
オーストラリアドル	7,091,000	-	7,098,552	7,552
シンガポールドル	1,735,015	-	1,735,732	717
イスラエルシケル	2,242,494	-	2,251,402	8,908
売建	19,166,963,099	-	18,987,315,786	179,647,313
米ドル	8,523,839,369	-	8,320,321,620	203,517,749
カナダドル	383,679,312	-	378,220,441	5,458,871
メキシコペソ	152,850,854	-	154,069,344	△1,218,490
ユーロ	7,849,844,966	-	7,895,973,049	△46,128,083
英ポンド	1,241,773,238	-	1,220,745,305	21,027,933
スウェーデンクローナ	68,046,060	-	69,111,900	△1,065,840
ノルウェークローネ	47,194,021	-	47,523,000	△328,979
デンマーククローネ	98,247,095	-	98,862,800	△615,705
ポーランドズロチ	124,661,162	-	127,601,080	△2,939,918
オーストラリアドル	415,566,659	-	415,102,400	464,259
シンガポールドル	174,180,624	-	172,470,480	1,710,144
イスラエルシケル	87,079,739	-	87,314,367	△234,628
合計	19,483,911,956	-	19,304,739,643	180,122,313

(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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27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	20,968,888,985円
同期中における追加設定元本額	12,117,777,948円
同期中における一部解約元本額	15,515,285,371円
2020年 4月27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）	3,835,598,494円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,261,229,504円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	1,053,241,195円
イオン・バランス戦略ファンド	700,079,802円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	75,282,771円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	6,884,036円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	14,628,114円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	6,002,931円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	6,248,863円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,750,221円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,092,313,139円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,809,280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＞	3,304,141,102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＞	138,639,058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＞	482,245,788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＞	580,287,264円
合計	17,571,381,562円

(2021年 4月26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	17,571,381,562円
同期中における追加設定元本額	8,582,179,054円
同期中における一部解約元本額	13,145,263,762円
2021年 4月26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）	2,096,603,813円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	634,468,070円

アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,763,790円
イオン・バランス戦略ファンド	536,817,606円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,158,343,666円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	418,497,151円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	681,787,045円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	146,325,380円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	29,424,709円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	26,193,219円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,362,970,381円
SMAM・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	810,193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＞	5,187,705,209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＞	129,547,354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＞	319,879,049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＞	267,160,219円
合計	13,008,296,854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	920,000.00	920,287.50	
		US TREASURY N/B 0.125	450,000.00	450,123.04	
		US TREASURY N/B 0.125	770,000.00	770,180.47	
		US TREASURY N/B 0.125	930,000.00	930,036.32	
		US TREASURY N/B 0.125	200,000.00	199,773.43	
		US TREASURY N/B 0.125	750,000.00	748,447.26	
		US TREASURY N/B 0.125	500,000.00	498,808.59	
		US TREASURY N/B 0.125	460,000.00	458,688.28	
		US TREASURY N/B 0.25	500,000.00	500,781.25	
		US TREASURY N/B 0.25	1,460,000.00	1,457,262.50	
		US TREASURY N/B 0.25	100,000.00	98,480.46	

US TREASURY N/B 0.25	650,000.00	639,462.88	
US TREASURY N/B 0.25	630,000.00	617,473.82	
US TREASURY N/B 0.25	130,000.00	127,237.50	
US TREASURY N/B 0.375	620,000.00	608,786.71	
US TREASURY N/B 0.375	380,000.00	372,652.34	
US TREASURY N/B 0.5	80,000.00	79,759.37	
US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	492,832.03	
US TREASURY N/B 0.5	560,000.00	541,121.87	
US TREASURY N/B 0.5	330,000.00	318,321.09	
US TREASURY N/B 0.5	1,340,000.00	1,290,692.18	
US TREASURY N/B 0.5	500,000.00	479,960.94	
US TREASURY N/B 0.5	470,000.00	449,657.81	
US TREASURY N/B 0.625	440,000.00	429,137.50	
US TREASURY N/B 0.625	580,000.00	558,725.77	
US TREASURY N/B 0.625	570,000.00	548,424.61	
US TREASURY N/B 0.625	420,000.00	388,188.28	
US TREASURY N/B 0.625	1,190,000.00	1,095,683.20	
US TREASURY N/B 0.75	1,020,000.00	1,016,613.28	
US TREASURY N/B 0.75	330,000.00	319,713.28	
US TREASURY N/B 0.875	860,000.00	808,232.02	
US TREASURY N/B 1.125	300,000.00	297,785.15	
US TREASURY N/B 1.125	900,000.00	863,929.69	
US TREASURY N/B 1.125	80,000.00	67,371.87	
US TREASURY N/B 1.25	350,000.00	359,570.31	
US TREASURY N/B 1.25	660,000.00	659,845.31	
US TREASURY N/B 1.25	260,000.00	203,724.21	
US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	974,195.31	
US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	308,109.37	
US TREASURY N/B 1.375	240,000.00	245,690.62	
US TREASURY N/B 1.375	580,000.00	508,723.43	
US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	769,166.01	
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	610,992.18	
US TREASURY N/B 1.5	1,150,000.00	1,179,648.43	
US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	466,136.72	
US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	566,585.93	

US TREASURY N/B 1.5	450,000.00	462,287.11	
US TREASURY N/B 1.5	480,000.00	480,731.25	
US TREASURY N/B 1.625	250,000.00	255,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	200,000.00	204,656.25	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	819,593.75	
US TREASURY N/B 1.625	880,000.00	905,540.62	
US TREASURY N/B 1.625	520,000.00	535,559.37	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	827,656.24	
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	623,507.81	
US TREASURY N/B 1.625	10,000.00	10,387.89	
US TREASURY N/B 1.625	100,000.00	103,632.81	
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	517,636.72	
US TREASURY N/B 1.625	380,000.00	386,189.84	
US TREASURY N/B 1.625	610,000.00	526,816.00	
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	610,500.00	
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	305,414.06	
US TREASURY N/B 1.75	350,000.00	358,203.12	
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	722,367.19	
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	307,617.18	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,018,007.81	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,023,867.19	
US TREASURY N/B 1.875	900,000.00	922,675.77	
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	314,472.65	
US TREASURY N/B 1.875	250,000.00	262,656.25	
US TREASURY N/B 1.875	530,000.00	507,454.29	
US TREASURY N/B 1.875	390,000.00	358,129.68	
US TREASURY N/B 2	700,000.00	716,816.40	
US TREASURY N/B 2	100,000.00	102,839.84	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,033,320.31	
US TREASURY N/B 2	200,000.00	209,921.87	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	525,117.19	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	630,656.25	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	634,195.31	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	568,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	819,187.50	

US TREASURY N/B 2.125	430,000.00	444,378.12	
US TREASURY N/B 2.125	280,000.00	294,689.06	
US TREASURY N/B 2.125	410,000.00	432,950.38	
US TREASURY N/B 2.125	320,000.00	340,225.00	
US TREASURY N/B 2.25	550,000.00	578,982.42	
US TREASURY N/B 2.25	460,000.00	484,904.68	
US TREASURY N/B 2.25	770,000.00	813,853.91	
US TREASURY N/B 2.25	580,000.00	615,978.12	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	531,347.65	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	531,914.06	
US TREASURY N/B 2.25	420,000.00	449,104.68	
US TREASURY N/B 2.25	450,000.00	481,130.86	
US TREASURY N/B 2.25	570,000.00	608,853.51	
US TREASURY N/B 2.25	700,000.00	747,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	300,855.46	
US TREASURY N/B 2.25	250,000.00	250,166.01	
US TREASURY N/B 2.375	600,000.00	638,953.12	
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	430,312.50	
US TREASURY N/B 2.375	290,000.00	311,602.72	
US TREASURY N/B 2.375	120,000.00	123,370.31	
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	315,714.84	
US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	751,789.06	
US TREASURY N/B 2.5	190,000.00	200,249.60	
US TREASURY N/B 2.5	100,000.00	105,234.37	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	540,097.65	
US TREASURY N/B 2.625	430,000.00	467,255.47	
US TREASURY N/B 2.625	140,000.00	153,059.37	
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	951,398.44	
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	957,234.37	
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	542,050.78	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	652,335.93	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	652,875.00	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	330,023.43	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	331,042.96	
US TREASURY N/B 2.75	250,000.00	275,976.56	

US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	960,890.62	
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	218,156.25	
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	655,335.93	
US TREASURY N/B 2.875	720,000.00	789,187.50	
US TREASURY N/B 2.875	500,000.00	554,628.90	
US TREASURY N/B 2.875	660,000.00	732,677.34	
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	225,062.50	
US TREASURY N/B 2.875	110,000.00	123,814.45	
US TREASURY N/B 2.875	370,000.00	417,088.28	
US TREASURY N/B 2.875	630,000.00	714,213.28	
US TREASURY N/B 3	620,000.00	682,096.87	
US TREASURY N/B 3	290,000.00	333,046.87	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	459,468.75	
US TREASURY N/B 3	290,000.00	333,341.40	
US TREASURY N/B 3	300,000.00	345,363.28	
US TREASURY N/B 3	250,000.00	288,359.37	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	462,656.25	
US TREASURY N/B 3	480,000.00	555,900.00	
US TREASURY N/B 3	550,000.00	638,236.32	
US TREASURY N/B 3.125	380,000.00	429,117.96	
US TREASURY N/B 3.125	210,000.00	245,700.00	
US TREASURY N/B 3.125	150,000.00	175,710.93	
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	467,968.75	
US TREASURY N/B 3.125	110,000.00	128,975.00	
US TREASURY N/B 3.125	240,000.00	284,081.25	
US TREASURY N/B 3.375	450,000.00	548,296.87	
US TREASURY N/B 3.375	230,000.00	284,912.50	
US TREASURY N/B 3.5	100,000.00	122,640.62	
US TREASURY N/B 3.625	230,000.00	290,177.34	
US TREASURY N/B 3.625	400,000.00	505,734.37	
US TREASURY N/B 3.875	120,000.00	155,137.50	
US TREASURY N/B 4.25	170,000.00	228,410.93	
US TREASURY N/B 4.25	140,000.00	189,732.81	
US TREASURY N/B 4.375	40,000.00	54,040.62	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	410,015.62	

	US TREASURY N/B 4.375	430,000.00	590,040.62	
	US TREASURY N/B 4.375	120,000.00	165,684.37	
	US TREASURY N/B 4.5	100,000.00	134,781.25	
	US TREASURY N/B 4.625	100,000.00	141,054.68	
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	256,890.62	
	US TREASURY N/B 5.25	260,000.00	335,521.87	
	US TREASURY N/B 5.375	80,000.00	108,312.50	
	US TREASURY N/B 5.5	120,000.00	155,446.87	
	米ドル 小計	74,420,000.00	77,442,831.05 (8,355,307,041)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	90,000.00	89,976.60	
	CANADA-GOV'T 0.25	340,000.00	337,501.00	
	CANADA-GOV'T 0.25	170,000.00	164,458.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	210,000.00	207,068.40	
	CANADA-GOV'T 0.5	320,000.00	290,880.00	
	CANADA-GOV'T 1	90,000.00	89,518.50	
	CANADA-GOV'T 1.25	180,000.00	176,778.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	130,000.00	133,237.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	170,000.00	174,607.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	490,000.00	503,058.50	
	CANADA-GOV'T 2	200,000.00	207,622.00	
	CANADA-GOV'T 2	140,000.00	147,480.20	
	CANADA-GOV'T 2	170,000.00	167,705.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	130,000.00	138,058.70	
	CANADA-GOV'T 2.25	220,000.00	235,714.60	
	CANADA-GOV'T 2.5	250,000.00	265,370.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	350,000.00	359,800.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	180,000.00	207,207.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	50,000.00	59,416.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	100,000.00	128,922.00	
	CANADA-GOV'T 4	50,000.00	67,254.50	
	CANADA-GOV'T 5	70,000.00	101,074.40	
	CANADA-GOV'T 5.75	60,000.00	86,402.40	
	カナダドル 小計	4,160,000.00	4,339,109.80 (375,593,344)	

メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	1,300,000.00	1,487,837.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	2,700,000.00	2,688,255.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	1,020,000.00	1,039,948.14	
	MEXICAN BONOS 6.75	2,700,000.00	2,787,821.82	
	MEXICAN BONOS 7.5	2,500,000.00	2,674,249.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	1,700,000.00	1,825,744.24	
	MEXICAN BONOS 7.75	1,700,000.00	1,805,745.10	
	MEXICAN BONOS 7.75	1,220,000.00	1,239,183.89	
	MEXICAN BONOS 8	2,200,000.00	2,352,372.00	
	MEXICAN BONOS 8	3,000,000.00	3,227,136.30	
	MEXICAN BONOS 8	600,000.00	620,460.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	3,240,000.00	3,651,888.56	
	MEXICAN BONOS 8.5	2,300,000.00	2,533,862.39	
	メキシコペソ 小計	26,180,000.00	27,934,503.44 (151,974,872)	
ユーロ	BELGIAN 0.1	130,000.00	132,197.00	
	BELGIAN 0.2	80,000.00	81,723.20	
	BELGIAN 0.4	50,000.00	48,688.00	
	BELGIAN 0.8	240,000.00	253,742.40	
	BELGIAN 0.8	50,000.00	53,670.50	
	BELGIAN 0.8	130,000.00	140,241.40	
	BELGIAN 0291 5.5	250,000.00	352,620.00	
	BELGIAN 0304 5	160,000.00	264,131.20	
	BELGIAN 0320 4.25	130,000.00	220,985.70	
	BELGIAN 0324 4.5	80,000.00	100,006.40	
	BELGIAN 0325 4.25	70,000.00	74,946.20	
	BELGIAN 0328 2.25	100,000.00	106,351.00	
	BELGIAN 0332 2.6	70,000.00	77,205.80	
	BELGIAN 0333 3	120,000.00	163,549.20	
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	103,897.00	
	BELGIAN 0347 0.9	130,000.00	141,603.80	
	BELGIAN 0348 1.7	100,000.00	123,259.00	
	BELGIAN 1	200,000.00	215,398.00	
	BELGIAN 1	220,000.00	242,323.40	
	BELGIAN 1.25	80,000.00	90,802.40	

BELGIAN 1.6	120,000.00	144,139.20	
BELGIAN 2.15	130,000.00	186,382.30	
BELGIAN 3.75	90,000.00	151,666.20	
BTPS 0	250,000.00	251,205.00	
BTPS 0.3	100,000.00	101,325.00	
BTPS 0.65	300,000.00	306,864.00	
BTPS 0.85	280,000.00	289,646.00	
BTPS 0.9	500,000.00	508,025.00	
BTPS 0.9	240,000.00	242,774.40	
BTPS 0.95	400,000.00	409,612.00	
BTPS 0.95	120,000.00	122,626.80	
BTPS 0.95	100,000.00	95,236.00	
BTPS 1.25	200,000.00	211,520.00	
BTPS 1.35	170,000.00	172,915.50	
BTPS 1.35	440,000.00	466,021.60	
BTPS 1.45	200,000.00	205,042.00	
BTPS 1.45	250,000.00	263,795.00	
BTPS 1.45	240,000.00	254,205.60	
BTPS 1.45	100,000.00	103,238.00	
BTPS 1.5	200,000.00	212,426.00	
BTPS 1.5	80,000.00	78,045.60	
BTPS 1.6	90,000.00	96,671.70	
BTPS 1.65	130,000.00	140,882.30	
BTPS 1.65	130,000.00	140,416.90	
BTPS 1.7	140,000.00	136,413.20	
BTPS 1.8	150,000.00	157,132.50	
BTPS 1.85	300,000.00	318,597.00	
BTPS 2	220,000.00	239,630.60	
BTPS 2	250,000.00	276,632.50	
BTPS 2.05	80,000.00	88,562.40	
BTPS 2.1	280,000.00	308,204.40	
BTPS 2.2	290,000.00	323,495.00	
BTPS 2.45	130,000.00	151,343.40	
BTPS 2.45	180,000.00	206,938.80	
BTPS 2.5	260,000.00	284,208.60	

BTPS 2.5	140,000.00	155,576.40	
BTPS 2.7	60,000.00	72,303.00	
BTPS 2.8	240,000.00	281,025.60	
BTPS 2.8	60,000.00	71,799.60	
BTPS 2.95	150,000.00	186,598.50	
BTPS 3	120,000.00	143,290.80	
BTPS 3.1	100,000.00	126,978.00	
BTPS 3.25	160,000.00	211,064.00	
BTPS 3.35	210,000.00	268,974.30	
BTPS 3.45	80,000.00	109,436.00	
BTPS 3.75	100,000.00	112,994.00	
BTPS 3.85	180,000.00	263,561.40	
BTPS 4	290,000.00	401,928.40	
BTPS 4.5	70,000.00	79,373.00	
BTPS 4.5	300,000.00	363,963.00	
BTPS 4.75	300,000.00	334,578.00	
BTPS 4.75	270,000.00	352,919.70	
BTPS 4.75	100,000.00	160,592.00	
BTPS 5	300,000.00	358,389.00	
BTPS 5	150,000.00	222,099.00	
BTPS 5	250,000.00	395,127.50	
BTPS 5	180,000.00	286,794.00	
BTPS 5.25	160,000.00	221,808.00	
BTPS 5.5	350,000.00	380,912.00	
BTPS 5.75	200,000.00	306,476.00	
BTPS 6	250,000.00	375,825.00	
BTPS 6.5	190,000.00	264,936.00	
BTPS 9	170,000.00	209,630.40	
BUNDESOBL-120 0	200,000.00	206,108.00	
BUNDESOBL-176 0	250,000.00	252,525.00	
BUNDESOBL-178 0	100,000.00	101,789.00	
BUNDESOBL-179 0	490,000.00	500,299.80	
BUNDESOBL-180 0	100,000.00	102,432.00	
BUNDESSCHATZANW 0	320,000.00	324,208.00	
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	309,744.00	

DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	154,629.00	
DEUTSCHLAND REP 0	380,000.00	390,837.60	
DEUTSCHLAND REP 0	190,000.00	194,898.20	
DEUTSCHLAND REP 0	310,000.00	311,292.70	
DEUTSCHLAND REP 0	200,000.00	183,902.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	330,000.00	345,985.20	
DEUTSCHLAND REP 0.25	170,000.00	179,064.40	
DEUTSCHLAND REP 0.25	100,000.00	105,373.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	330,000.00	345,147.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	410,000.00	432,689.40	
DEUTSCHLAND REP 0.5	380,000.00	405,327.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	130,000.00	139,027.20	
DEUTSCHLAND REP 1	100,000.00	105,730.00	
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	214,528.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	200,000.00	252,898.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	450,000.00	463,567.50	
DEUTSCHLAND REP 1.5	250,000.00	261,502.50	
DEUTSCHLAND REP 1.5	240,000.00	256,411.20	
DEUTSCHLAND REP 1.75	340,000.00	349,985.80	
DEUTSCHLAND REP 1.75	200,000.00	214,052.00	
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	212,678.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	200,000.00	308,010.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	280,000.00	439,874.40	
DEUTSCHLAND REP 3.25	210,000.00	349,660.50	
DEUTSCHLAND REP 4	200,000.00	327,490.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	70,000.00	123,975.60	
DEUTSCHLAND REP 4.75	170,000.00	235,560.50	
DEUTSCHLAND REP 4.75	180,000.00	298,098.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	250,000.00	475,985.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	80,000.00	126,100.80	
DEUTSCHLAND REP 5.625	160,000.00	227,315.20	
DEUTSCHLAND REP 6.25	290,000.00	461,297.20	
DEUTSCHLAND REP 6.5	160,000.00	231,505.60	
FINNISH GOV'T 0	120,000.00	121,971.60	
FINNISH GOV'T 0	70,000.00	70,676.90	

FINNISH GOV'T 0.125	20,000.00	17,768.00	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	105,184.00	
FINNISH GOV'T 0.5	40,000.00	42,346.40	
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	105,941.00	
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	106,434.00	
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	112,953.00	
FINNISH GOV'T 1.375	50,000.00	61,690.00	
FINNISH GOV'T 1.5	100,000.00	104,347.00	
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	103,232.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	122,589.00	
FRANCE O.A.T. 0	100,000.00	100,708.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	303,663.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	202,546.00	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	345,895.60	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	203,668.00	
FRANCE O.A.T. 0	340,000.00	347,480.00	
FRANCE O.A.T. 0	380,000.00	388,656.40	
FRANCE O.A.T. 0	480,000.00	484,281.60	
FRANCE O.A.T. 0	430,000.00	430,387.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	410,000.00	425,329.90	
FRANCE O.A.T. 0.5	60,000.00	48,310.20	
FRANCE O.A.T. 0.5	440,000.00	458,950.80	
FRANCE O.A.T. 0.5	250,000.00	263,377.50	
FRANCE O.A.T. 0.5	160,000.00	158,992.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	70,000.00	68,159.70	
FRANCE O.A.T. 0.75	420,000.00	450,378.60	
FRANCE O.A.T. 0.75	380,000.00	407,937.60	
FRANCE O.A.T. 0.75	120,000.00	117,129.60	
FRANCE O.A.T. 1	130,000.00	139,098.70	
FRANCE O.A.T. 1	280,000.00	303,489.20	
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	339,171.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	339,777.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	390,000.00	448,527.30	
FRANCE O.A.T. 1.5	230,000.00	272,370.60	
FRANCE O.A.T. 1.75	240,000.00	252,098.40	

FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	216,926.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	220,000.00	270,276.60	
FRANCE O.A.T. 1.75	150,000.00	194,820.00	
FRANCE O.A.T. 2	290,000.00	380,085.60	
FRANCE O.A.T. 2.25	120,000.00	125,260.80	
FRANCE O.A.T. 2.25	430,000.00	468,403.30	
FRANCE O.A.T. 2.5	280,000.00	345,976.40	
FRANCE O.A.T. 2.75	470,000.00	565,588.60	
FRANCE O.A.T. 3	490,000.00	507,831.10	
FRANCE O.A.T. 3.25	240,000.00	379,874.40	
FRANCE O.A.T. 3.5	490,000.00	588,739.90	
FRANCE O.A.T. 4	230,000.00	369,596.20	
FRANCE O.A.T. 4	170,000.00	329,109.80	
FRANCE O.A.T. 4	120,000.00	243,157.20	
FRANCE O.A.T. 4.25	250,000.00	280,967.50	
FRANCE O.A.T. 4.5	270,000.00	475,564.50	
FRANCE O.A.T. 4.75	220,000.00	356,840.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	390,000.00	569,680.80	
FRANCE O.A.T. 5.75	340,000.00	561,319.60	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	519,308.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	236,890.00	
IRISH GOVT 0.2	120,000.00	123,944.40	
IRISH GOVT 0.9	120,000.00	129,782.40	
IRISH GOVT 1.1	130,000.00	142,948.00	
IRISH GOVT 1.3	150,000.00	169,986.00	
IRISH GOVT 1.35	60,000.00	67,908.60	
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	120,283.00	
IRISH GOVT 2	70,000.00	91,236.60	
IRISH GOVT 2.4	100,000.00	122,328.00	
IRISH GOVT 3.4	80,000.00	89,288.80	
IRISH GOVT 3.9	50,000.00	54,318.00	
IRISH GOVT 5.4	50,000.00	61,626.50	
NETHERLANDS GOVT 0	170,000.00	173,272.50	
NETHERLANDS GOVT 0	140,000.00	142,699.20	
NETHERLANDS GOVT 0	40,000.00	40,500.40	

NETHERLANDS GOVT 0	80,000.00	71,800.80	
NETHERLANDS GOVT 0.25	200,000.00	207,380.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	80,000.00	83,572.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	40,000.00	42,191.60	
NETHERLANDS GOVT 0.5	50,000.00	52,944.50	
NETHERLANDS GOVT 0.75	170,000.00	182,836.70	
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	108,218.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	100,000.00	105,520.00	
NETHERLANDS GOVT 2	200,000.00	217,466.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	110,000.00	113,953.40	
NETHERLANDS GOVT 2.5	140,000.00	182,414.40	
NETHERLANDS GOVT 2.75	140,000.00	226,970.80	
NETHERLANDS GOVT 3.75	100,000.00	107,749.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	160,000.00	276,188.80	
NETHERLANDS GOVT 4	130,000.00	210,046.20	
NETHERLANDS GOVT 5.5	150,000.00	210,552.00	
REP OF AUSTRIA 0	180,000.00	182,655.00	
REP OF AUSTRIA 0	90,000.00	91,793.70	
REP OF AUSTRIA 0	120,000.00	121,357.20	
REP OF AUSTRIA 0	120,000.00	111,193.20	
REP OF AUSTRIA 0.5	150,000.00	158,538.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	30,000.00	31,746.60	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	213,608.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	130,000.00	139,776.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	50,000.00	52,566.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	40,000.00	43,185.60	
REP OF AUSTRIA 1.5	70,000.00	87,150.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	80,000.00	84,824.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	100,000.00	129,688.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	20,000.00	32,208.60	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	212,886.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	150,000.00	318,384.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	60,000.00	97,001.40	
REP OF AUSTRIA 4.85	100,000.00	126,767.00	
SPANISH GOV'T 0	250,000.00	253,237.50	

SPANISH GOV'T 0.1	130,000.00	126,233.90	
SPANISH GOV'T 0.25	390,000.00	398,346.00	
SPANISH GOV'T 0.35	300,000.00	305,784.00	
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	302,841.00	
SPANISH GOV'T 0.45	300,000.00	304,497.00	
SPANISH GOV'T 0.5	230,000.00	234,694.30	
SPANISH GOV'T 0.6	80,000.00	82,624.00	
SPANISH GOV'T 0.8	100,000.00	105,314.00	
SPANISH GOV'T 1	150,000.00	138,370.50	
SPANISH GOV'T 1.2	60,000.00	61,726.80	
SPANISH GOV'T 1.25	240,000.00	260,563.20	
SPANISH GOV'T 1.3	290,000.00	313,693.00	
SPANISH GOV'T 1.4	100,000.00	109,574.00	
SPANISH GOV'T 1.4	190,000.00	208,523.10	
SPANISH GOV'T 1.45	20,000.00	18,220.40	
SPANISH GOV'T 1.45	200,000.00	219,198.00	
SPANISH GOV'T 1.45	230,000.00	253,653.20	
SPANISH GOV'T 1.5	200,000.00	219,350.00	
SPANISH GOV'T 1.85	160,000.00	184,214.40	
SPANISH GOV'T 1.95	220,000.00	244,211.00	
SPANISH GOV'T 1.95	200,000.00	230,380.00	
SPANISH GOV'T 2.15	250,000.00	277,760.00	
SPANISH GOV'T 2.35	120,000.00	145,150.80	
SPANISH GOV'T 2.7	80,000.00	106,799.20	
SPANISH GOV'T 2.75	150,000.00	166,641.00	
SPANISH GOV'T 2.9	190,000.00	260,731.30	
SPANISH GOV'T 3.45	160,000.00	252,820.80	
SPANISH GOV'T 4.2	100,000.00	150,546.00	
SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	337,185.00	
SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	303,362.50	
SPANISH GOV'T 4.7	120,000.00	200,778.00	
SPANISH GOV'T 4.8	100,000.00	114,634.00	
SPANISH GOV'T 4.9	230,000.00	389,629.20	
SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	275,754.00	
SPANISH GOV'T 5.15	130,000.00	238,054.70	

	SPANISH GOV'T 5.75	260,000.00	411,052.20	
	SPANISH GOV'T 5.9	270,000.00	357,023.70	
	SPANISH GOV'T 6	180,000.00	261,828.00	
ユーロ 小計		50,600,000.00	59,625,626.50	
			(7,784,125,539)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.125	260,000.00	260,436.80	
	UK TSY GILT 0.125	100,000.00	99,970.00	
	UK TSY GILT 0.125	220,000.00	218,132.20	
	UK TSY GILT 0.125	200,000.00	194,644.00	
	UK TSY GILT 0.25	200,000.00	188,120.00	
	UK TSY GILT 0.375	100,000.00	99,830.00	
	UK TSY GILT 0.375	180,000.00	173,406.60	
	UK TSY GILT 0.5	130,000.00	130,803.40	
	UK TSY GILT 0.5	110,000.00	86,523.80	
	UK TSY GILT 0.625	260,000.00	264,459.00	
	UK TSY GILT 0.625	120,000.00	112,536.00	
	UK TSY GILT 0.625	230,000.00	193,347.20	
	UK TSY GILT 0.75	130,000.00	132,078.70	
	UK TSY GILT 0.875	130,000.00	132,064.40	
	UK TSY GILT 0.875	170,000.00	155,368.10	
	UK TSY GILT 1	120,000.00	123,204.00	
	UK TSY GILT 1.25	100,000.00	100,334.00	
	UK TSY GILT 1.5	80,000.00	84,857.60	
	UK TSY GILT 1.5	110,000.00	115,603.40	
	UK TSY GILT 1.625	80,000.00	96,925.60	
	UK TSY GILT 1.625	140,000.00	150,943.80	
	UK TSY GILT 1.625	80,000.00	88,182.40	
	UK TSY GILT 1.75	310,000.00	317,365.60	
	UK TSY GILT 1.75	100,000.00	109,110.00	
	UK TSY GILT 1.75	90,000.00	100,123.20	
	UK TSY GILT 1.75	220,000.00	255,079.00	
	UK TSY GILT 2	30,000.00	32,319.60	
	UK TSY GILT 2.25	250,000.00	263,062.50	
	UK TSY GILT 2.5	60,000.00	87,891.00	
	UK TSY GILT 2.75	90,000.00	97,910.10	

	UK TSY GILT 3.25	180,000.00	251,236.80	
	UK TSY GILT 3.5	250,000.00	365,337.50	
	UK TSY GILT 3.5	90,000.00	167,751.90	
	UK TSY GILT 4	140,000.00	262,900.40	
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	249,310.00	
	UK TSY GILT 4.25	100,000.00	135,709.00	
	UK TSY GILT 4.25	180,000.00	258,998.40	
	UK TSY GILT 4.25	140,000.00	211,961.40	
	UK TSY GILT 4.25	190,000.00	292,026.20	
	UK TSY GILT 4.25	90,000.00	148,707.00	
	UK TSY GILT 4.25	90,000.00	154,672.20	
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	371,444.00	
	UK TSY GILT 4.5	70,000.00	100,772.00	
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	324,386.00	
	UK TSY GILT 4.75	130,000.00	178,265.10	
	UK TSY GILT 4.75	70,000.00	110,707.10	
	UK TSY GILT 5	80,000.00	94,856.00	
	UK TSY GILT 6	60,000.00	84,130.20	
	英ポンド 小計	6,860,000.00	8,227,803.20 (1,232,442,641)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.125	350,000.00	341,834.50	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	770,000.00	803,495.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	340,000.00	354,055.60	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	720,000.00	760,680.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1,010,000.00	1,056,247.90	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.25	190,000.00	227,156.40	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	660,000.00	731,669.40	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	550,000.00	573,199.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	320,000.00	470,105.60	
	スウェーデンクローナ 小計	4,910,000.00	5,318,443.40 (68,448,366)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.25	200,000.00	196,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.375	330,000.00	330,801.90	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	420,000.00	430,966.20	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	250,000.00	258,927.50	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	510,000.00	529,757.40	

	NORWEGIAN GOV'T 1.75	300,000.00	311,178.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	700,000.00	722,281.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	400,000.00	422,296.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	410,000.00	437,597.10	
ノルウェークローネ 小計		3,520,000.00	3,640,505.10	(47,399,376)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0	450,000.00	448,380.00	
	DENMARK - BULLET 0.25	320,000.00	323,760.00	
	DENMARK - BULLET 0.25	230,000.00	215,832.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	430,000.00	452,059.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	1,010,000.00	1,064,540.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	670,000.00	704,170.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	520,000.00	572,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	950,000.00	1,685,205.00	
	DENMARK - BULLET 7	90,000.00	114,183.00	
デンマーククローネ 小計		4,670,000.00	5,580,129.00	(97,987,065)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	700,000.00	699,893.55	
	POLAND GOVT BOND 0.25	140,000.00	134,979.60	
	POLAND GOVT BOND 1.25	200,000.00	194,668.00	
	POLAND GOVT BOND 2.25	560,000.00	595,330.40	
	POLAND GOVT BOND 2.5	350,000.00	379,998.50	
	POLAND GOVT BOND 2.5	640,000.00	697,452.80	
	POLAND GOVT BOND 2.75	520,000.00	574,927.60	
	POLAND GOVT BOND 3.25	220,000.00	244,041.60	
	POLAND GOVT BOND 4	260,000.00	285,079.60	
	POLAND GOVT BOND 5.75	540,000.00	583,659.00	
ポーランドズロチ 小計		4,130,000.00	4,390,030.65	(125,885,885)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	200,000.00	199,481.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	170,000.00	167,059.34	
	AUSTRALIAN GOVT. 0.5	320,000.00	314,099.84	
	AUSTRALIAN GOVT. 1	260,000.00	245,410.62	
	AUSTRALIAN GOVT. 1	160,000.00	148,739.04	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.25	140,000.00	132,685.28	

	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	250,000.00	245,575.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	130,000.00	105,775.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	250,000.00	258,495.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	250,000.00	267,550.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	180,000.00	194,562.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	160,000.00	172,687.52	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	280,000.00	309,232.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	100,000.00	110,654.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	250,000.00	275,825.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	150,000.00	162,840.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	100,000.00	104,530.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	120,000.00	129,585.60	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	230,000.00	254,978.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	250,000.00	285,850.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	80,000.00	90,680.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	80,000.00	97,069.60	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	170,000.00	199,410.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	120,000.00	154,608.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	200,000.00	221,438.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	100,000.00	106,920.00	
オーストラリアドル 小計		4,700,000.00	4,955,741.24 (414,745,984)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.875	70,000.00	69,652.10	
	SINGAPORE GOV'T 2.125	300,000.00	317,430.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	90,000.00	97,965.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	230,000.00	241,339.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	113,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	150,000.00	171,750.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	120,000.00	133,476.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	160,000.00	178,123.20	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	323,880.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	180,000.00	186,657.89	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	293,375.00	
シンガポールドル 小計		1,950,000.00	2,127,148.19 (173,086,048)	
イスラエルシェケル	ISRAEL FIXED 0.75	170,000.00	171,507.90	

		ISRAEL FIXED 1.5	560,000.00	578,900.00	
		ISRAEL FIXED 1.75	210,000.00	222,427.80	
		ISRAEL FIXED 2.25	540,000.00	597,007.80	
		ISRAEL FIXED 3.75	370,000.00	488,111.40	
		ISRAEL FIXED 6.25	420,000.00	550,922.40	
		イスラエルシェケル 小計		2,270,000.00	2,608,877.30
合計				18,913,583,233	(18,913,583,233)

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 159銘柄	43.0%	44.2%
カナダドル	国債証券 23銘柄	1.9%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 268銘柄	40.1%	41.2%
英ポンド	国債証券 48銘柄	6.3%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	0.2%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	2.1%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	0.9%	0.9%
イスラエルシェケル	国債証券 6銘柄	0.4%	0.5%

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。

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		

流動資産		
金銭信託	652,035,892	727,633,001
コール・ローン	667,623,445	1,668,590,743
株式	152,354,149,040	187,837,731,440
派生商品評価勘定	128,163,700	1,611,200
未収配当金	1,981,191,957	1,741,114,046
前払金	-	83,065,000
差入委託証拠金	62,380,000	13,270,000
流動資産合計	155,845,544,034	192,073,015,430
資産合計	155,845,544,034	192,073,015,430
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,797,600	84,886,300
前受金	126,530,000	-
未払解約金	75,208,007	497,729,231
未払利息	1,925	4,829
その他未払費用	132,811	57,245
流動負債合計	203,670,343	582,677,605
負債合計	203,670,343	582,677,605
純資産の部		
元本等		
元本	66,420,614,464	60,391,040,010
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	89,221,259,227	131,099,297,815
元本等合計	155,641,873,691	191,490,337,825
純資産合計	155,641,873,691	191,490,337,825
負債純資産合計	155,845,544,034	192,073,015,430

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	(2021年 4月26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。	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 2,663,600,000円	株式 3,306,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,420,614,464口	60,391,040,010口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.3433円 (10,000口当たりの純資産額 23,433円)	1口当たり純資産額 3.1708円 (10,000口当たりの純資産額 31,708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 4月28日 至 2021年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク

	有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,194,833,900	-	3,321,200,000	126,366,100
	東証株価指数先物	3,194,833,900	-	3,321,200,000	126,366,100
合計		3,194,833,900	-	3,321,200,000	126,366,100

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,747,610,100	-	3,664,335,000	△83,275,100
	東証株価指数先物	3,747,610,100	-	3,664,335,000	△83,275,100
合計		3,747,610,100	-	3,664,335,000	△83,275,100

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,808,381,443円
同期中における追加設定元本額	16,957,041,638円
同期中における一部解約元本額	19,344,808,617円
2020年 4月27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	9,930,085,411円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,002,421,458円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,651,519,341円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,204,800,316円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	82,255,976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）	7,056,016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）	25,925,290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）	71,999,208円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	121,550,280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）	84,468,752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）	183,080,997円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,807,172,658円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	12,989,825,879円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	348,878,578円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	402,912,826円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	297,633,454円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	14,913,973円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	90,110,330円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	73,374,401円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	225,263,505円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	109,513,205円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	133,932,515円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,244,259円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	20,155,703円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	628,342円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	2,812,060円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	1,964,032円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,752,764円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,916,736,716円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,951,358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＞	220,267,664円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,203,480,644円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,413,624,299円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,994,664,617円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	57,396,433円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	218,485,657円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	657,085円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	898,124,937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＞	58,124,475円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	405,907,028円

SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,106,480,802円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	936,340,998円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,882,119,746円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,225,167円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	66,011,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	80,438,386円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	48,200,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	23,412,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	209,289,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	402,959,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	115,926,629円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	55,415,739円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	10,193,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	71,756,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	968,188,755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）	191,083,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	22,115,210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＞	929,127,958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＞	189,817,826円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,542,313,109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＞	10,043,124円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	14,237,375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＞	15,653,159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＞	101,389,039円
合計	66,420,614,464円

(2021年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,420,614,464円
同期中における追加設定元本額	10,321,155,755円
同期中における一部解約元本額	16,350,730,209円
2021年 4月26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	9,377,992,498円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	882,687,081円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,279,019,277円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,170,940,243円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	121,064,129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）	4,744,492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）	20,265,196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）	59,910,031円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	126,034,866円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	99,406,160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)	198,180,525円
国内株式指数ファンド (TOPIX)	1,201,230,099円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	16,039,342,551円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	423,754,988円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	464,864,383円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	302,064,707円
イオン・バランス戦略ファンド	48,431,067円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	23,321,027円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	134,683,136円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	112,157,344円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	371,384,457円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	185,233,234円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	216,782,444円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,448,491円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	223,855,528円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	11,130,956円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	50,852,277円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	47,513,827円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,257,418円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	3,065,048,127円
バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	18,087,538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>	129,489,749円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,117,958,002円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,802,540,670円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,769,935,339円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	42,846,949円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	175,681,640円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	800,989,888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>	49,447,751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>	888,393,536円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	684,285,651円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,094,565,514円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	373,938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>	54,101,733円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,991,493円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,007,263円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	132,156,315円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	271,614,480円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	72,269,436円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	43,489,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,479,610円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	50,100,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	670,876,217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)	175,567,216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>	280,176,797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＞	127,955,140円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	692,837,428円
SMAM・世界バランスファンドVA 2＜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＞	20,287,354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＞	50,751,185円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	42,473,420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＞	382,523,535円
合計	60,391,040,010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	3,500	2,933.00	10,265,500	
日本水産	89,900	501.00	45,039,900	
マルハニチロ	15,000	2,451.00	36,765,000	
雪国まいたけ	6,100	1,954.00	11,919,400	
カネコ種苗	4,700	1,595.00	7,496,500	
サカタのタネ	11,500	3,925.00	45,137,500	
ホクト	8,100	2,000.00	16,200,000	
日鉄鉱業	2,300	6,670.00	15,341,000	
I N P E X	356,900	730.00	260,537,000	
石油資源開発	12,600	2,016.00	25,401,600	
K & O エナジーグループ	5,800	1,437.00	8,334,600	
ヒノキヤグループ	3,300	2,598.00	8,573,400	
ショーボンドホールディングス	13,900	4,730.00	65,747,000	
ミライト・ホールディングス	32,000	1,772.00	56,704,000	
タマホーム	6,300	2,534.00	15,964,200	
ベステラ	3,200	1,675.00	5,360,000	
スペースバリューホールディングス	14,200	750.00	10,650,000	
安藤・間	61,900	851.00	52,676,900	
東急建設	30,800	569.00	17,525,200	

コムシスホールディングス	34,200	3,400.00	116,280,000	
ビーアールホールディングス	13,600	562.00	7,643,200	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,071.00	13,047,300	
東建コーポレーション	2,900	10,240.00	29,696,000	
オリエンタル白石	39,700	299.00	11,870,300	
大成建設	69,400	4,105.00	284,887,000	
大林組	222,000	996.00	221,112,000	
清水建設	208,200	894.00	186,130,800	
飛島建設	9,400	1,097.00	10,311,800	
長谷工コーポレーション	72,500	1,495.00	108,387,500	
松井建設	11,800	715.00	8,437,000	
銭高組	1,700	4,530.00	7,701,000	
鹿島建設	163,000	1,509.00	245,967,000	
不動テトラ	6,900	1,849.00	12,758,100	
大末建設	7,100	956.00	6,787,600	
鉄建建設	6,500	1,866.00	12,129,000	
西松建設	16,600	2,879.00	47,791,400	
三井住友建設	54,500	471.00	25,669,500	
大豊建設	5,200	4,010.00	20,852,000	
前田建設工業	58,300	939.00	54,743,700	
奥村組	12,400	2,779.00	34,459,600	
東鉄工業	8,800	2,519.00	22,167,200	
浅沼組	3,200	4,475.00	14,320,000	
戸田建設	94,900	788.00	74,781,200	
熊谷組	10,200	2,997.00	30,569,400	
北野建設	2,400	2,451.00	5,882,400	
矢作建設工業	12,100	807.00	9,764,700	
ピーエス三菱	10,400	646.00	6,718,400	
日本ハウスホールディングス	22,100	317.00	7,005,700	
大東建託	24,500	11,840.00	290,080,000	
新日本建設	10,500	836.00	8,778,000	
N I P P O	17,500	2,931.00	51,292,500	
東亜道路工業	1,900	4,485.00	8,521,500	
前田道路	14,500	2,106.00	30,537,000	
日本道路	2,300	7,960.00	18,308,000	
東亜建設工業	6,800	2,435.00	16,558,000	

日本国土開発	22,200	589.00	13,075,800	
若築建設	6,500	1,278.00	8,307,000	
東洋建設	26,200	577.00	15,117,400	
五洋建設	96,800	860.00	83,248,000	
世紀東急工業	13,300	876.00	11,650,800	
福田組	2,800	4,965.00	13,902,000	
住友林業	53,000	2,515.00	133,295,000	
巴コーポレーション	15,200	375.00	5,700,000	
大和ハウス工業	207,100	3,292.00	681,773,200	
ライト工業	12,200	1,772.00	21,618,400	
積水ハウス	243,300	2,260.00	549,858,000	
ユアテック	13,900	781.00	10,855,900	
日本リーテック	5,400	1,813.00	9,790,200	
中電工	7,900	2,348.00	18,549,200	
関電工	32,600	978.00	31,882,800	
きんでん	47,100	1,830.00	86,193,000	
東京エネシス	8,900	907.00	8,072,300	
トーエネック	2,900	3,890.00	11,281,000	
住友電設	6,400	2,391.00	15,302,400	
日本電設工業	11,200	1,920.00	21,504,000	
協和エクシオ	33,200	2,914.00	96,744,800	
新日本空調	6,400	2,224.00	14,233,600	
九電工	15,900	3,895.00	61,930,500	
三機工業	15,400	1,396.00	21,498,400	
日揮ホールディングス	75,500	1,260.00	95,130,000	
中外炉工業	4,300	2,241.00	9,636,300	
ヤマト	9,400	665.00	6,251,000	
太平電業	5,400	2,663.00	14,380,200	
高砂熱学工業	19,300	1,655.00	31,941,500	
朝日工業社	2,500	2,852.00	7,130,000	
明星工業	15,900	771.00	12,258,900	
大気社	10,600	3,015.00	31,959,000	
ダイダン	5,000	2,760.00	13,800,000	
日比谷総合設備	7,800	1,892.00	14,757,600	
レイズネクスト	12,500	1,172.00	14,650,000	
ニッポン	18,800	1,562.00	29,365,600	

日清製粉グループ本社	80,600	1,771.00	142,742,600	
昭和産業	5,400	2,981.00	16,097,400	
鳥越製粉	8,500	816.00	6,936,000	
中部飼料	8,700	1,400.00	12,180,000	
フィード・ワン	10,500	863.00	9,061,500	
日本甜菜製糖	5,100	1,597.00	8,144,700	
DM三井製糖ホールディングス	5,300	1,819.00	9,640,700	
日新製糖	4,200	1,785.00	7,497,000	
森永製菓	16,900	3,740.00	63,206,000	
中村屋	2,700	3,820.00	10,314,000	
江崎グリコ	19,600	4,150.00	81,340,000	
名糖産業	5,800	1,500.00	8,700,000	
井村屋グループ	4,500	2,420.00	10,890,000	
不二家	5,100	2,166.00	11,046,600	
山崎製パン	53,600	1,701.00	91,173,600	
モロゾフ	1,700	5,520.00	9,384,000	
亀田製菓	3,900	4,635.00	18,076,500	
寿スピリッツ	6,900	6,680.00	46,092,000	
カルビー	32,800	2,622.00	86,001,600	
森永乳業	13,200	5,730.00	75,636,000	
六甲バター	5,900	1,612.00	9,510,800	
ヤクルト本社	49,200	5,380.00	264,696,000	
明治ホールディングス	46,900	6,760.00	317,044,000	
雪印メグミルク	17,100	2,215.00	37,876,500	
プリマハム	9,400	3,435.00	32,289,000	
日本ハム	27,200	4,860.00	132,192,000	
丸大食品	6,700	1,675.00	11,222,500	
S Foods	6,200	3,285.00	20,367,000	
柿安本店	3,000	2,508.00	7,524,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	40,200	700.00	28,140,000	
サッポロホールディングス	24,800	2,176.00	53,964,800	
アサヒグループホールディングス	156,800	4,641.00	727,708,800	
キリンホールディングス	304,100	2,073.00	630,399,300	
宝ホールディングス	53,000	1,414.00	74,942,000	
オエノンホールディングス	24,500	394.00	9,653,000	
養命酒製造	3,700	1,869.00	6,915,300	

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	55,400	1,740.00	96,396,000	
サントリー食品インターナショナル	47,500	3,765.00	178,837,500	
ダイドーグループホールディングス	3,900	5,220.00	20,358,000	
伊藤園	21,700	6,220.00	134,974,000	
キーコーヒー	7,000	2,068.00	14,476,000	
日清オイリオグループ	8,700	3,090.00	26,883,000	
不二製油グループ本社	17,600	2,860.00	50,336,000	
かどや製油	1,400	4,175.00	5,845,000	
J-オイルミルズ	6,400	1,862.00	11,916,800	
キッコーマン	51,500	6,560.00	337,840,000	
味の素	171,400	2,216.50	379,908,100	
キュービー	39,800	2,597.00	103,360,600	
ハウス食品グループ本社	26,700	3,425.00	91,447,500	
カゴメ	29,300	3,275.00	95,957,500	
焼津水産化学工業	4,800	991.00	4,756,800	
アリアケジャパン	6,700	6,340.00	42,478,000	
ニチレイ	34,000	2,769.00	94,146,000	
東洋水産	36,700	4,510.00	165,517,000	
イトアンドホールディングス	4,300	1,844.00	7,929,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	864.00	4,579,200	
日清食品ホールディングス	28,000	7,920.00	221,760,000	
永谷園ホールディングス	4,300	2,235.00	9,610,500	
一正蒲鉾	4,000	1,255.00	5,020,000	
フジッコ	7,400	1,911.00	14,141,400	
ロック・フィールド	7,500	1,602.00	12,015,000	
日本たばこ産業	384,200	2,074.00	796,830,800	
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,736.00	9,374,400	
わらべや日洋ホールディングス	5,600	1,943.00	10,880,800	
なとり	5,500	1,960.00	10,780,000	
ピクルスコーポレーション	2,000	3,525.00	7,050,000	
北の達人コーポレーション	24,800	514.00	12,747,200	
ユーグレナ	31,000	956.00	29,636,000	
ミヨシ油脂	4,700	1,211.00	5,691,700	
理研ビタミン	8,100	1,415.00	11,461,500	
片倉工業	10,600	1,433.00	15,189,800	

グンゼ	5,100	3,920.00	19,992,000	
東洋紡	29,100	1,350.00	39,285,000	
ユニチカ	24,200	386.00	9,341,200	
富士紡ホールディングス	3,700	4,615.00	17,075,500	
倉敷紡績	6,900	1,844.00	12,723,600	
シキボウ	6,300	974.00	6,136,200	
日本毛織	22,500	976.00	21,960,000	
帝国繊維	8,300	2,142.00	17,778,600	
帝人	65,500	1,790.00	117,245,000	
東レ	508,300	696.70	354,132,610	
住江織物	2,700	2,075.00	5,602,500	
アツギ	11,300	544.00	6,147,200	
ダイニック	6,000	783.00	4,698,000	
セーレン	17,400	1,925.00	33,495,000	
小松マテーレ	12,300	964.00	11,857,200	
ワコールホールディングス	18,300	2,397.00	43,865,100	
ホギメディカル	9,400	3,275.00	30,785,000	
T S I ホールディングス	28,900	323.00	9,334,700	
マツオカコーポレーション	2,900	1,850.00	5,365,000	
ワールド	10,200	1,424.00	14,524,800	
オンワードホールディングス	46,900	290.00	13,601,000	
ゴールドウイン	11,600	6,700.00	77,720,000	
デサント	12,400	1,838.00	22,791,200	
特種東海製紙	4,500	4,365.00	19,642,500	
王子ホールディングス	313,200	715.00	223,938,000	
日本製紙	31,600	1,263.00	39,910,800	
北越コーポレーション	50,800	557.00	28,295,600	
中越パルプ工業	5,400	1,223.00	6,604,200	
大王製紙	33,200	1,800.00	59,760,000	
レンゴー	72,800	913.00	66,466,400	
トーモク	5,400	1,780.00	9,612,000	
ザ・パックス	5,800	2,759.00	16,002,200	
クラレ	109,600	1,194.00	130,862,400	
旭化成	463,300	1,205.50	558,508,150	
昭和電工	53,000	3,190.00	169,070,000	
住友化学	547,500	554.00	303,315,000	

住友精化	3,600	3,965.00	14,274,000	
日産化学	38,500	5,840.00	224,840,000	
ラサ工業	2,800	2,271.00	6,358,800	
クレハ	5,900	7,690.00	45,371,000	
多木化学	2,900	6,120.00	17,748,000	
テイカ	6,000	1,415.00	8,490,000	
石原産業	14,800	915.00	13,542,000	
日本曹達	9,800	3,300.00	32,340,000	
東ソー	107,500	1,994.00	214,355,000	
トクヤマ	20,700	2,784.00	57,628,800	
セントラル硝子	14,100	2,260.00	31,866,000	
東亜合成	43,400	1,228.00	53,295,200	
大阪ソーダ	6,900	2,573.00	17,753,700	
関東電化工業	17,900	883.00	15,805,700	
デンカ	25,500	4,410.00	112,455,000	
信越化学工業	129,200	19,155.00	2,474,826,000	
堺化学工業	5,500	1,959.00	10,774,500	
第一稀元素化学工業	8,600	1,350.00	11,610,000	
エア・ウォーター	71,000	1,802.00	127,942,000	
日本酸素ホールディングス	57,500	2,011.00	115,632,500	
日本化学工業	2,500	2,953.00	7,382,500	
日本パーカライジング	36,600	1,097.00	40,150,200	
高压ガス工業	13,000	708.00	9,204,000	
四国化成工業	9,800	1,281.00	12,553,800	
ステラ ケミファ	4,000	3,130.00	12,520,000	
保土谷化学工業	2,200	4,580.00	10,076,000	
日本触媒	12,800	5,870.00	75,136,000	
大日精化工業	5,700	2,299.00	13,104,300	
カネカ	18,000	4,365.00	78,570,000	
三菱瓦斯化学	69,700	2,600.00	181,220,000	
三井化学	59,900	3,460.00	207,254,000	
J S R	70,200	3,430.00	240,786,000	
東京応化工業	12,100	7,500.00	90,750,000	
大阪有機化学工業	6,400	4,290.00	27,456,000	
三菱ケミカルホールディングス	468,100	813.10	380,612,110	
KHネオケム	11,800	2,637.00	31,116,600	

ダイセル	94,200	834.00	78,562,800	
住友ベークライト	11,200	4,465.00	50,008,000	
積水化学工業	146,400	2,088.00	305,683,200	
日本ゼオン	63,200	1,653.00	104,469,600	
アイカ工業	19,500	3,990.00	77,805,000	
宇部興産	35,000	2,251.00	78,785,000	
積水樹脂	11,500	2,094.00	24,081,000	
タキロンシーアイ	16,500	698.00	11,517,000	
旭有機材	5,100	1,404.00	7,160,400	
ニチバン	4,800	1,928.00	9,254,400	
リケンテクノス	19,800	500.00	9,900,000	
大倉工業	3,800	1,943.00	7,383,400	
積水化成成品工業	12,000	586.00	7,032,000	
群栄化学工業	2,600	2,413.00	6,273,800	
ダイキョーニシカワ	15,400	733.00	11,288,200	
森六ホールディングス	4,600	2,083.00	9,581,800	
日本化薬	44,600	1,025.00	45,715,000	
カーリットホールディングス	8,700	720.00	6,264,000	
日本精化	5,900	1,494.00	8,814,600	
扶桑化学工業	5,300	4,035.00	21,385,500	
トリケミカル研究所	6,200	3,845.00	23,839,000	
A D E K A	32,400	2,147.00	69,562,800	
日油	26,100	5,890.00	153,729,000	
新日本理化	15,000	285.00	4,275,000	
ハリマ化成グループ	6,700	918.00	6,150,600	
花王	171,000	7,090.00	1,212,390,000	
第一工業製薬	2,700	3,665.00	9,895,500	
ニイタカ	2,000	2,653.00	5,306,000	
三洋化成工業	4,100	5,290.00	21,689,000	
大日本塗料	10,100	869.00	8,776,900	
日本ペイントホールディングス	288,500	1,613.00	465,350,500	
関西ペイント	78,500	2,850.00	223,725,000	
中国塗料	18,000	985.00	17,730,000	
日本特殊塗料	6,500	1,035.00	6,727,500	
藤倉化成	12,600	541.00	6,816,600	
太陽ホールディングス	5,100	5,770.00	29,427,000	

D I C	29,400	2,821.00	82,937,400	
サカタインクス	15,700	1,029.00	16,155,300	
東洋インキ S Cホールディングス	13,500	2,030.00	27,405,000	
T & K T O K A	8,200	801.00	6,568,200	
富士フイルムホールディングス	125,500	7,033.00	882,641,500	
資生堂	142,000	7,694.00	1,092,548,000	
ライオン	92,700	2,078.00	192,630,600	
高砂香料工業	4,900	2,679.00	13,127,100	
マンダム	15,400	2,014.00	31,015,600	
ミルボン	9,700	5,890.00	57,133,000	
ファンケル	26,000	3,605.00	93,730,000	
コーセー	13,400	16,260.00	217,884,000	
コタ	6,000	1,510.00	9,060,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,700	2,671.00	81,999,700	
ノエビアホールディングス	6,000	4,840.00	29,040,000	
新日本製薬	2,000	2,180.00	4,360,000	
エスター	5,400	1,876.00	10,130,400	
アグロ カネショウ	3,600	1,466.00	5,277,600	
コニシ	11,800	1,680.00	19,824,000	
長谷川香料	12,200	2,141.00	26,120,200	
小林製薬	19,900	9,910.00	197,209,000	
荒川化学工業	7,000	1,238.00	8,666,000	
メック	5,200	2,461.00	12,797,200	
タカラバイオ	18,600	2,827.00	52,582,200	
J C U	8,000	4,105.00	32,840,000	
デクセリアルズ	20,300	2,026.00	41,127,800	
アース製薬	5,300	6,240.00	33,072,000	
北興化学工業	7,400	1,087.00	8,043,800	
大成ラミック	3,200	2,823.00	9,033,600	
クミアイ化学工業	30,500	951.00	29,005,500	
日本農薬	16,800	569.00	9,559,200	
アキレス	6,100	1,410.00	8,601,000	
有沢製作所	11,500	985.00	11,327,500	
日東電工	45,600	9,410.00	429,096,000	
レック	9,200	1,220.00	11,224,000	
三光合成	9,800	448.00	4,390,400	

藤森工業	6,000	4,250.00	25,500,000	
未来工業	3,600	1,811.00	6,519,600	
J S P	5,200	1,802.00	9,370,400	
エフピコ	13,300	4,460.00	59,318,000	
天馬	6,000	2,275.00	13,650,000	
信越ポリマー	11,200	1,012.00	11,334,400	
東リ	26,000	250.00	6,500,000	
ニフコ	26,300	3,740.00	98,362,000	
バルカー	6,100	2,133.00	13,011,300	
ユニ・チャーム	151,500	4,333.00	656,449,500	
協和キリン	71,400	3,320.00	237,048,000	
武田薬品工業	594,100	3,663.00	2,176,188,300	
アステラス製薬	618,700	1,649.00	1,020,236,300	
大日本住友製薬	53,400	1,879.00	100,338,600	
塩野義製薬	89,800	5,714.00	513,117,200	
日本新薬	20,300	7,530.00	152,859,000	
中外製薬	223,000	4,242.00	945,966,000	
科研製薬	12,400	4,450.00	55,180,000	
エーザイ	79,200	7,320.00	579,744,000	
ロート製薬	34,300	2,872.00	98,509,600	
小野薬品工業	164,300	2,823.50	463,901,050	
久光製薬	20,700	6,530.00	135,171,000	
持田製薬	10,200	3,920.00	39,984,000	
参天製薬	124,200	1,452.00	180,338,400	
扶桑薬品工業	3,300	2,452.00	8,091,600	
日本ケミファ	2,500	2,439.00	6,097,500	
ツムラ	24,000	3,735.00	89,640,000	
日医工	20,800	935.00	19,448,000	
キッセイ薬品工業	13,400	2,268.00	30,391,200	
生化学工業	12,400	1,001.00	12,412,400	
栄研化学	12,700	2,201.00	27,952,700	
鳥居薬品	4,600	2,806.00	12,907,600	
J C R ファーマ	20,400	3,000.00	61,200,000	
東和薬品	10,000	2,224.00	22,240,000	
富士製薬工業	6,500	1,208.00	7,852,000	
ゼリア新薬工業	12,800	2,013.00	25,766,400	

第一三共	612,900	3,009.00	1,844,216,100	
キョーリン製薬ホールディングス	15,500	1,907.00	29,558,500	
大幸薬品	9,200	1,219.00	11,214,800	
ダイト	4,600	3,560.00	16,376,000	
大塚ホールディングス	148,200	4,312.00	639,038,400	
大正製薬ホールディングス	16,900	6,610.00	111,709,000	
ペプチドリーム	36,400	4,885.00	177,814,000	
あすか製薬ホールディングス	8,000	1,426.00	11,408,000	
サワイグループホールディングス	15,600	5,200.00	81,120,000	
日本コークス工業	75,400	103.00	7,766,200	
ニチレキ	8,800	1,473.00	12,962,400	
ユシロ化学工業	7,200	1,102.00	7,934,400	
MORESCO	5,800	1,110.00	6,438,000	
出光興産	79,100	2,599.00	205,580,900	
ENEOSホールディングス	1,075,700	462.20	497,188,540	
コスモエネルギーホールディングス	22,700	2,348.00	53,299,600	
横浜ゴム	41,200	2,048.00	84,377,600	
TOYO TIRE	38,000	2,070.00	78,660,000	
ブリヂストン	189,900	4,467.00	848,283,300	
住友ゴム工業	63,200	1,340.00	84,688,000	
オカモト	4,400	4,065.00	17,886,000	
ニッタ	7,200	2,638.00	18,993,600	
住友理工	15,300	700.00	10,710,000	
三ツ星ベルト	9,000	1,714.00	15,426,000	
バンドー化学	14,700	745.00	10,951,500	
日東紡績	10,800	3,880.00	41,904,000	
A G C	65,500	4,925.00	322,587,500	
日本板硝子	17,700	671.00	11,876,700	
日本電気硝子	27,100	2,664.00	72,194,400	
オハラ	3,600	1,626.00	5,853,600	
住友大阪セメント	13,400	3,535.00	47,369,000	
太平洋セメント	42,600	2,747.00	117,022,200	
日本ヒューム	11,000	710.00	7,810,000	
日本コンクリート工業	24,200	389.00	9,413,800	
三谷セキサン	3,400	3,790.00	12,886,000	
アジアパイルホールディングス	16,100	503.00	8,098,300	

東海カーボン	70,100	1,743.00	122,184,300	
日本カーボン	4,200	4,670.00	19,614,000	
東洋炭素	5,100	2,173.00	11,082,300	
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	3,430.00	14,749,000	
TOTO	51,000	6,250.00	318,750,000	
日本碍子	78,700	1,953.00	153,701,100	
日本特殊陶業	54,600	1,822.00	99,481,200	
MARUWA	2,500	11,760.00	29,400,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	2,963.00	6,814,900	
黒崎播磨	1,600	4,615.00	7,384,000	
東京窯業	14,100	318.00	4,483,800	
フジミインコーポレーテッド	5,800	4,605.00	26,709,000	
ニチアス	18,000	2,829.00	50,922,000	
ニチハ	10,000	3,120.00	31,200,000	
日本製鉄	337,300	1,877.00	633,112,100	
神戸製鋼所	129,600	759.00	98,366,400	
合同製鐵	4,600	2,046.00	9,411,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	203,100	1,401.00	284,543,100	
東京製鐵	27,800	1,019.00	28,328,200	
共英製鋼	8,900	1,558.00	13,866,200	
大和工業	15,500	3,255.00	50,452,500	
東京鐵鋼	3,400	1,902.00	6,466,800	
大阪製鐵	5,000	1,281.00	6,405,000	
淀川製鋼所	9,200	2,442.00	22,466,400	
丸一鋼管	22,900	2,719.00	62,265,100	
モリ工業	2,800	2,475.00	6,930,000	
大同特殊鋼	11,800	4,800.00	56,640,000	
日本冶金工業	6,100	1,915.00	11,681,500	
山陽特殊製鋼	9,000	1,636.00	14,724,000	
愛知製鋼	4,200	3,490.00	14,658,000	
日立金属	67,100	1,945.00	130,509,500	
大平洋金属	5,400	2,137.00	11,539,800	
新日本電工	48,600	365.00	17,739,000	
栗本鐵工所	4,400	1,720.00	7,568,000	
三菱製鋼	8,700	835.00	7,264,500	
日本精線	1,500	3,680.00	5,520,000	

大紀アルミニウム工業所	10,900	955.00	10,409,500	
日本軽金属ホールディングス	19,500	2,078.00	40,521,000	
三井金属鉱業	18,900	3,660.00	69,174,000	
東邦亜鉛	4,500	2,282.00	10,269,000	
三菱マテリアル	46,500	2,432.00	113,088,000	
住友金属鉱山	90,200	4,672.00	421,414,400	
DOWAホールディングス	17,800	4,530.00	80,634,000	
古河機械金属	11,800	1,233.00	14,549,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,100	897.00	9,059,700	
東邦チタニウム	13,500	989.00	13,351,500	
U A C J	10,800	2,471.00	26,686,800	
C Kサンエツ	1,900	3,620.00	6,878,000	
古河電気工業	22,100	2,851.00	63,007,100	
住友電気工業	246,300	1,618.50	398,636,550	
フジクラ	86,700	514.00	44,563,800	
昭和電線ホールディングス	7,200	1,627.00	11,714,400	
タツタ電線	13,500	604.00	8,154,000	
平河ヒューテック	5,100	1,304.00	6,650,400	
リョービ	9,900	1,616.00	15,998,400	
アサヒホールディングス	26,400	2,138.00	56,443,200	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,289.00	7,324,800	
トーカロ	18,400	1,515.00	27,876,000	
アルファC o	5,300	1,135.00	6,015,500	
SUMCO	90,400	2,801.00	253,210,400	
川田テクノロジーズ	1,900	4,395.00	8,350,500	
R S T e c h n o l o g i e s	2,400	6,710.00	16,104,000	
東洋製罐グループホールディングス	45,900	1,270.00	58,293,000	
ホッカンホールディングス	5,300	1,397.00	7,404,100	
横河ブリッジホールディングス	12,100	2,081.00	25,180,100	
駒井ハルテック	2,300	2,069.00	4,758,700	
三和ホールディングス	67,500	1,368.00	92,340,000	
文化シャッター	20,900	961.00	20,084,900	
三協立山	11,300	819.00	9,254,700	
L I X I L	97,500	3,120.00	304,200,000	
ノーリツ	15,300	1,684.00	25,765,200	
長府製作所	7,000	2,062.00	14,434,000	

リンナイ	13,800	11,310.00	156,078,000	
日東精工	13,100	566.00	7,414,600	
岡部	17,800	750.00	13,350,000	
ジーテクト	9,400	1,401.00	13,169,400	
東ブレ	13,800	1,440.00	19,872,000	
高周波熱錬	19,000	553.00	10,507,000	
東京製綱	6,000	1,082.00	6,492,000	
パイオラックス	10,700	1,481.00	15,846,700	
エイチワン	9,100	784.00	7,134,400	
日本発條	71,700	783.00	56,141,100	
立川ブラインド工業	3,800	1,317.00	5,004,600	
三益半導体工業	5,500	2,895.00	15,922,500	
日本製鋼所	21,900	2,630.00	57,597,000	
三浦工業	30,500	5,730.00	174,765,000	
タクマ	23,500	2,290.00	53,815,000	
ツガミ	14,600	1,851.00	27,024,600	
オークマ	8,300	6,020.00	49,966,000	
芝浦機械	7,500	2,632.00	19,740,000	
アマダ	102,800	1,200.00	123,360,000	
アイダエンジニアリング	18,900	935.00	17,671,500	
F U J I	27,700	2,950.00	81,715,000	
牧野フライス製作所	8,400	4,170.00	35,028,000	
オーエスジー	35,500	1,814.00	64,397,000	
旭ダイヤモンド工業	21,600	523.00	11,296,800	
DMG森精機	45,200	1,742.00	78,738,400	
ソディック	15,800	981.00	15,499,800	
ディスコ	9,600	38,100.00	365,760,000	
日東工器	4,300	1,976.00	8,496,800	
日進工具	6,200	1,623.00	10,062,600	
豊和工業	5,200	927.00	4,820,400	
石川製作所	2,400	1,757.00	4,216,800	
島精機製作所	10,300	2,242.00	23,092,600	
オプトラン	9,100	2,978.00	27,099,800	
フリュー	8,300	1,008.00	8,366,400	
ヤマシンフィルタ	14,300	849.00	12,140,700	
日阪製作所	10,600	855.00	9,063,000	

やまびこ	13,800	1,206.00	16,642,800	
平田機工	3,300	7,320.00	24,156,000	
マルマエ	3,200	1,710.00	5,472,000	
タツモ	3,700	1,982.00	7,333,400	
ナブテスコ	41,400	5,040.00	208,656,000	
三井海洋開発	7,900	2,100.00	16,590,000	
レオン自動機	7,800	1,183.00	9,227,400	
SMC	20,900	65,130.00	1,361,217,000	
ホソカワミクロン	2,500	6,290.00	15,725,000	
ユニオンツール	2,800	3,555.00	9,954,000	
オイレス工業	9,900	1,590.00	15,741,000	
日精エー・エス・ピー機械	2,100	5,120.00	10,752,000	
サトーホールディングス	9,500	2,723.00	25,868,500	
技研製作所	6,300	4,760.00	29,988,000	
日本エアーテック	3,100	1,245.00	3,859,500	
日精樹脂工業	7,400	1,003.00	7,422,200	
ワイエイシイホールディングス	3,900	963.00	3,755,700	
小松製作所	323,300	3,191.00	1,031,650,300	
住友重機械工業	40,500	3,180.00	128,790,000	
日立建機	33,500	3,285.00	110,047,500	
日工	13,300	717.00	9,536,100	
巴工業	3,700	2,145.00	7,936,500	
井関農機	8,500	1,562.00	13,277,000	
TOWA	7,000	2,191.00	15,337,000	
北川鉄工所	3,700	1,518.00	5,616,600	
ローツェ	3,100	10,240.00	31,744,000	
クボタ	375,200	2,544.50	954,696,400	
荏原実業	2,000	4,950.00	9,900,000	
三菱化工機	2,600	2,763.00	7,183,800	
月島機械	13,600	1,242.00	16,891,200	
帝国電機製作所	6,200	1,354.00	8,394,800	
新東工業	18,000	749.00	13,482,000	
澁谷工業	6,200	3,385.00	20,987,000	
アイチ コーポレーション	12,900	851.00	10,977,900	
小森コーポレーション	17,900	767.00	13,729,300	
鶴見製作所	6,000	1,688.00	10,128,000	

酒井重工業	2,200	2,097.00	4,613,400	
荏原製作所	29,600	4,755.00	140,748,000	
西島製作所	7,900	843.00	6,659,700	
北越工業	9,100	1,055.00	9,600,500	
ダイキン工業	90,900	22,110.00	2,009,799,000	
オルガノ	2,200	7,530.00	16,566,000	
トーヨーカネツ	3,300	2,510.00	8,283,000	
栗田工業	38,500	4,975.00	191,537,500	
椿本チエイン	9,800	2,899.00	28,410,200	
大同工業	4,300	961.00	4,132,300	
木村化工機	7,500	738.00	5,535,000	
アネスト岩田	12,500	1,008.00	12,600,000	
ダイフク	39,100	11,010.00	430,491,000	
サムコ	2,000	3,400.00	6,800,000	
加藤製作所	6,000	1,036.00	6,216,000	
タダノ	36,100	1,172.00	42,309,200	
フジテック	24,900	2,436.00	60,656,400	
C K D	16,600	2,390.00	39,674,000	
キトー	7,200	1,799.00	12,952,800	
平和	19,900	1,831.00	36,436,900	
理想科学工業	6,500	1,320.00	8,580,000	
SANKYO	17,300	2,830.00	48,959,000	
日本金銭機械	10,100	579.00	5,847,900	
マースグループホールディングス	5,500	1,597.00	8,783,500	
フクシマガリレイ	5,000	4,025.00	20,125,000	
竹内製作所	11,700	2,964.00	34,678,800	
アマノ	18,900	2,732.00	51,634,800	
J U K I	10,400	864.00	8,985,600	
蛇の目ミシン工業	8,300	781.00	6,482,300	
マックス	9,800	1,604.00	15,719,200	
グローリー	18,700	2,336.00	43,683,200	
新晃工業	6,700	2,258.00	15,128,600	
大和冷機工業	11,800	1,108.00	13,074,400	
セガサミーホールディングス	64,800	1,600.00	103,680,000	
リケン	4,300	2,356.00	10,130,800	
T P R	9,900	1,540.00	15,246,000	

ツバキ・ナカシマ	13,500	1,582.00	21,357,000	
ホシザキ	22,500	9,970.00	224,325,000	
大豊工業	7,400	997.00	7,377,800	
日本精工	145,600	1,017.00	148,075,200	
NTN	169,200	317.00	53,636,400	
ジェイテクト	68,600	1,028.00	70,520,800	
不二越	6,600	4,355.00	28,743,000	
日本トムソン	23,100	670.00	15,477,000	
THK	44,500	3,800.00	169,100,000	
ユーシン精機	6,400	898.00	5,747,200	
前澤給装工業	6,800	1,107.00	7,527,600	
イーグル工業	9,700	1,186.00	11,504,200	
日本ピラー工業	7,500	1,769.00	13,267,500	
キッツ	23,000	693.00	15,939,000	
マキタ	92,800	5,250.00	487,200,000	
日立造船	56,700	813.00	46,097,100	
三菱重工業	112,400	3,225.00	362,490,000	
I H I	48,300	2,122.00	102,492,600	
スター精密	11,400	1,653.00	18,844,200	
日清紡ホールディングス	45,600	825.00	37,620,000	
イビデン	34,400	5,260.00	180,944,000	
コニカミノルタ	147,000	605.00	88,935,000	
ブラザー工業	86,600	2,362.00	204,549,200	
ミネベアミツミ	122,500	2,758.00	337,855,000	
日立製作所	343,200	5,179.00	1,777,432,800	
東芝	105,000	4,465.00	468,825,000	
三菱電機	713,000	1,633.50	1,164,685,500	
富士電機	42,900	4,800.00	205,920,000	
安川電機	76,700	5,160.00	395,772,000	
シンフォニアテクノロジー	10,000	1,518.00	15,180,000	
明電舎	12,500	2,398.00	29,975,000	
オリジン	4,300	1,330.00	5,719,000	
山洋電気	3,700	5,880.00	21,756,000	
デンヨー	6,600	2,001.00	13,206,600	
東芝テック	7,600	4,315.00	32,794,000	
芝浦メカトロニクス	1,500	6,010.00	9,015,000	

マブチモーター	19,800	4,545.00	89,991,000	
日本電産	171,900	12,985.00	2,232,121,500	
トレックス・セミコンダクター	5,100	1,911.00	9,746,100	
東光高岳	4,500	1,526.00	6,867,000	
ダイヘン	7,800	4,730.00	36,894,000	
ヤーマン	11,900	1,523.00	18,123,700	
J V C ケンウッド	58,200	218.00	12,687,600	
ミマキエンジニアリング	11,200	644.00	7,212,800	
I - P E X	4,300	1,904.00	8,187,200	
日新電機	16,900	1,208.00	20,415,200	
大崎電気工業	18,300	581.00	10,632,300	
オムロン	59,100	8,700.00	514,170,000	
日東工業	10,600	1,948.00	20,648,800	
I D E C	10,400	1,722.00	17,908,800	
正興電機製作所	2,100	1,943.00	4,080,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,000	3,005.00	78,130,000	
メルコホールディングス	2,800	3,965.00	11,102,000	
日本電気	90,500	6,330.00	572,865,000	
富士通	64,200	16,180.00	1,038,756,000	
沖電気工業	30,800	1,160.00	35,728,000	
電気興業	4,000	2,579.00	10,316,000	
サンケン電気	8,500	5,170.00	43,945,000	
アイホン	5,100	1,735.00	8,848,500	
ルネサスエレクトロニクス	308,000	1,251.00	385,308,000	
セイコーエプソン	88,800	1,941.00	172,360,800	
ワコム	52,700	711.00	37,469,700	
アルバック	13,400	5,130.00	68,742,000	
E I Z O	6,300	4,055.00	25,546,500	
日本信号	17,700	945.00	16,726,500	
京三製作所	19,700	408.00	8,037,600	
能美防災	9,700	2,139.00	20,748,300	
ホーチキ	6,300	1,310.00	8,253,000	
エレコム	16,000	2,331.00	37,296,000	
パナソニック	761,500	1,313.50	1,000,230,250	
シャープ	82,700	1,831.00	151,423,700	
アンリツ	43,000	2,364.00	101,652,000	

富士通ゼネラル	22,100	2,844.00	62,852,400	
ソニーグループ	447,300	11,700.00	5,233,410,000	
T D K	34,400	15,130.00	520,472,000	
帝国通信工業	6,400	1,079.00	6,905,600	
タムラ製作所	28,100	513.00	14,415,300	
アルプスアルパイン	59,700	1,289.00	76,953,300	
鈴木	4,200	1,233.00	5,178,600	
日本トリム	2,100	3,845.00	8,074,500	
ローランド ディー. ジー.	5,500	1,703.00	9,366,500	
フォスター電機	8,900	1,233.00	10,973,700	
SMK	2,500	2,851.00	7,127,500	
ヨコオ	5,400	2,690.00	14,526,000	
ホシデン	19,500	1,073.00	20,923,500	
ヒロセ電機	11,000	17,960.00	197,560,000	
日本航空電子工業	16,700	1,699.00	28,373,300	
T O A	10,800	880.00	9,504,000	
マクセルホールディングス	15,000	1,479.00	22,185,000	
古野電気	10,500	1,109.00	11,644,500	
ユニデンホールディングス	2,600	2,456.00	6,385,600	
スミダコーポレーション	7,500	1,067.00	8,002,500	
アイコム	3,500	2,649.00	9,271,500	
リオン	3,500	2,815.00	9,852,500	
船井電機	16,500	920.00	15,180,000	
横河電機	71,700	2,014.00	144,403,800	
新電元工業	3,400	3,420.00	11,628,000	
アズビル	48,100	4,455.00	214,285,500	
東亜ディーケーケー	5,800	819.00	4,750,200	
日本光電工業	29,800	3,300.00	98,340,000	
共和電業	15,700	380.00	5,966,000	
日本電子材料	3,100	2,131.00	6,606,100	
堀場製作所	14,300	7,250.00	103,675,000	
アドバンテスト	52,900	10,560.00	558,624,000	
エスベック	7,000	1,872.00	13,104,000	
キーエンス	70,100	52,140.00	3,655,014,000	
日置電機	3,700	5,470.00	20,239,000	
シスメックス	55,800	11,510.00	642,258,000	

日本マイクロニクス	12,900	1,752.00	22,600,800	
メガチップス	7,500	3,800.00	28,500,000	
OBARA GROUP	4,400	3,650.00	16,060,000	
コーセル	9,700	1,086.00	10,534,200	
イリソ電子工業	6,200	5,020.00	31,124,000	
オブテックスグループ	12,400	1,685.00	20,894,000	
千代田インテグレ	4,500	1,963.00	8,833,500	
レーザーテック	31,300	19,600.00	613,480,000	
スタンレー電気	50,300	3,210.00	161,463,000	
岩崎電気	4,100	1,436.00	5,887,600	
ウシオ電機	37,800	1,472.00	55,641,600	
日本セラミック	7,700	2,595.00	19,981,500	
古河電池	5,600	1,663.00	9,312,800	
山一電機	5,500	1,587.00	8,728,500	
図研	5,000	2,896.00	14,480,000	
日本電子	13,100	6,360.00	83,316,000	
カシオ計算機	57,900	1,927.00	111,573,300	
ファナック	62,700	25,780.00	1,616,406,000	
日本シイエムケイ	20,300	450.00	9,135,000	
エンプラス	3,500	4,200.00	14,700,000	
大真空	3,000	2,350.00	7,050,000	
ローム	29,600	11,070.00	327,672,000	
浜松ホトニクス	51,000	6,540.00	333,540,000	
三井ハイテック	7,100	4,435.00	31,488,500	
新光電気工業	23,800	3,305.00	78,659,000	
京セラ	108,800	7,145.00	777,376,000	
太陽誘電	31,700	4,995.00	158,341,500	
村田製作所	209,700	8,923.00	1,871,153,100	
双葉電子工業	14,200	882.00	12,524,400	
北陸電気工業	6,100	931.00	5,679,100	
ニチコン	23,100	1,090.00	25,179,000	
日本ケミコン	5,200	1,705.00	8,866,000	
KOA	10,500	1,624.00	17,052,000	
市光工業	12,100	708.00	8,566,800	
小糸製作所	42,600	6,860.00	292,236,000	
SCREENホールディングス	12,500	10,520.00	131,500,000	

キヤノン電子	7,200	1,788.00	12,873,600	
キヤノン	355,200	2,652.00	941,990,400	
リコー	182,000	1,175.00	213,850,000	
象印マホービン	19,600	1,750.00	34,300,000	
東京エレクトロン	41,800	49,060.00	2,050,708,000	
トヨタ紡織	21,000	1,806.00	37,926,000	
ユニプレス	13,000	1,030.00	13,390,000	
豊田自動織機	57,500	9,180.00	527,850,000	
モリタホールディングス	12,100	1,619.00	19,589,900	
三桜工業	11,100	1,169.00	12,975,900	
デンソー	157,300	6,949.00	1,093,077,700	
東海理化電機製作所	19,400	1,822.00	35,346,800	
川崎重工業	55,900	2,504.00	139,973,600	
日本車輛製造	3,400	2,410.00	8,194,000	
三菱ロジスネクスト	10,400	1,247.00	12,968,800	
日産自動車	843,900	555.30	468,617,670	
いすゞ自動車	206,700	1,106.00	228,610,200	
トヨタ自動車	723,500	8,265.00	5,979,727,500	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,100	896.00	80,729,600	
三菱自動車工業	267,600	295.00	78,942,000	
武蔵精密工業	16,500	1,944.00	32,076,000	
日産車体	11,000	734.00	8,074,000	
新明和工業	20,600	978.00	20,146,800	
極東開発工業	12,700	1,661.00	21,094,700	
トピー工業	7,600	1,316.00	10,001,600	
タチエス	11,900	1,184.00	14,089,600	
N O K	35,600	1,409.00	50,160,400	
フタバ産業	19,900	551.00	10,964,900	
K Y B	8,200	2,851.00	23,378,200	
大同メタル工業	21,000	560.00	11,760,000	
プレス工業	39,600	317.00	12,553,200	
太平洋工業	15,900	1,216.00	19,334,400	
河西工業	16,400	425.00	6,970,000	
アイシン	51,900	3,855.00	200,074,500	
マツダ	225,100	856.00	192,685,600	

今仙電機製作所	8,900	716.00	6,372,400	
本田技研工業	562,200	3,290.00	1,849,638,000	
スズキ	141,800	4,316.00	612,008,800	
S U B A R U	205,400	2,070.00	425,178,000	
安永	4,600	1,234.00	5,676,400	
ヤマハ発動機	100,700	2,752.00	277,126,400	
T B K	13,100	412.00	5,397,200	
エクセディ	10,000	1,637.00	16,370,000	
豊田合成	23,200	2,740.00	63,568,000	
愛三工業	14,200	687.00	9,755,400	
ヨロズ	8,000	1,200.00	9,600,000	
エフ・シー・シー	12,100	1,750.00	21,175,000	
シマノ	26,800	26,100.00	699,480,000	
テイ・エス テック	33,200	1,548.00	51,393,600	
ジャムコ	8,200	939.00	7,699,800	
テルモ	218,800	4,171.00	912,614,800	
日機装	23,000	1,110.00	25,530,000	
日本エム・ディ・エム	4,600	2,148.00	9,880,800	
島津製作所	91,500	4,040.00	369,660,000	
J M S	7,300	978.00	7,139,400	
長野計器	6,500	1,205.00	7,832,500	
ブイ・テクノロジー	3,400	5,700.00	19,380,000	
東京計器	6,400	1,021.00	6,534,400	
インターアクション	3,800	2,577.00	9,792,600	
東京精密	12,000	5,260.00	63,120,000	
マニー	28,600	2,699.00	77,191,400	
ニコン	109,900	1,023.00	112,427,700	
トプコン	37,300	1,500.00	55,950,000	
オリンパス	395,800	2,268.50	897,872,300	
理研計器	6,200	2,863.00	17,750,600	
タムロン	5,900	2,200.00	12,980,000	
H O Y A	141,700	13,075.00	1,852,727,500	
ノーリツ銅機	6,700	2,655.00	17,788,500	
エー・アンド・デイ	6,700	1,349.00	9,038,300	
朝日インテック	75,300	2,996.00	225,598,800	
シチズン時計	90,800	365.00	33,142,000	

メニコン	11,000	6,720.00	73,920,000	
松風	4,200	2,006.00	8,425,200	
セイコーホールディングス	10,100	1,901.00	19,200,100	
ニプロ	54,000	1,314.00	70,956,000	
スノーピーク	4,300	3,985.00	17,135,500	
パラマウントベッドホールディングス	13,800	2,189.00	30,208,200	
トランザクション	5,100	1,229.00	6,267,900	
ニホンフラッシュ	6,900	1,301.00	8,976,900	
前田工織	7,700	3,350.00	25,795,000	
永大産業	13,800	300.00	4,140,000	
アートネイチャー	10,600	667.00	7,070,200	
バンダイナムコホールディングス	59,100	8,100.00	478,710,000	
SHOEI	6,200	4,390.00	27,218,000	
フランスベッドホールディングス	11,700	916.00	10,717,200	
パイロットコーポレーション	12,700	3,470.00	44,069,000	
萩原工業	5,100	1,463.00	7,461,300	
トッパン・フォームズ	12,600	1,134.00	14,288,400	
フジシールインターナショナル	14,500	2,438.00	35,351,000	
タカラトミー	32,100	952.00	30,559,200	
廣済堂	6,800	983.00	6,684,400	
プロネクサス	8,200	1,171.00	9,602,200	
大建工業	5,500	2,039.00	11,214,500	
凸版印刷	107,700	1,905.00	205,168,500	
大日本印刷	86,100	2,244.00	193,208,400	
共同印刷	2,600	2,838.00	7,378,800	
NISSHA	14,600	1,335.00	19,491,000	
TAKARA & COMPANY	4,700	1,868.00	8,779,600	
アシックス	64,000	1,774.00	113,536,000	
ローランド	4,200	4,620.00	19,404,000	
ヤマハ	42,400	6,130.00	259,912,000	
河合楽器製作所	2,600	3,255.00	8,463,000	
ピジョン	46,000	3,990.00	183,540,000	
オリバー	2,000	2,623.00	5,246,000	
キングジム	8,400	990.00	8,316,000	
リンテック	15,400	2,421.00	37,283,400	
イトーキ	18,200	381.00	6,934,200	

任天堂	40,900	61,450.00	2,513,305,000	
三菱鉛筆	11,500	1,540.00	17,710,000	
タカスタンダード	14,300	1,594.00	22,794,200	
コクヨ	34,600	1,717.00	59,408,200	
ナカバヤシ	10,500	600.00	6,300,000	
グローブライド	3,500	4,470.00	15,645,000	
オカムラ	27,500	1,271.00	34,952,500	
美津濃	7,000	2,242.00	15,694,000	
東京電力ホールディングス	603,000	318.00	191,754,000	
中部電力	218,200	1,297.00	283,005,400	
関西電力	271,500	1,086.00	294,849,000	
中国電力	101,800	1,247.00	126,944,600	
北陸電力	68,000	714.00	48,552,000	
東北電力	163,500	994.00	162,519,000	
四国電力	60,400	797.00	48,138,800	
九州電力	155,400	999.00	155,244,600	
北海道電力	68,700	456.00	31,327,200	
沖縄電力	13,800	1,441.00	19,885,800	
電源開発	56,700	1,731.00	98,147,700	
エフオン	5,300	1,064.00	5,639,200	
イーレックス	10,900	1,840.00	20,056,000	
レノバ	12,200	3,450.00	42,090,000	
東京瓦斯	138,200	2,257.50	311,986,500	
大阪瓦斯	128,100	2,037.00	260,939,700	
東邦瓦斯	35,000	6,360.00	222,600,000	
北海道瓦斯	5,900	1,522.00	8,979,800	
広島ガス	22,700	375.00	8,512,500	
西部ガスホールディングス	8,300	2,584.00	21,447,200	
静岡ガス	20,300	930.00	18,879,000	
メタウォーター	8,300	2,274.00	18,874,200	
SBSホールディングス	5,200	2,695.00	14,014,000	
東武鉄道	73,500	2,884.00	211,974,000	
相鉄ホールディングス	25,100	2,340.00	58,734,000	
東急	178,600	1,408.00	251,468,800	
京浜急行電鉄	91,600	1,453.00	133,094,800	
小田急電鉄	113,800	2,956.00	336,392,800	

京王電鉄	39,700	7,080.00	281,076,000	
京成電鉄	53,500	3,470.00	185,645,000	
富士急行	9,800	5,420.00	53,116,000	
新京成電鉄	3,300	2,188.00	7,220,400	
東日本旅客鉄道	125,900	7,577.00	953,944,300	
西日本旅客鉄道	64,100	6,052.00	387,933,200	
東海旅客鉄道	59,400	16,360.00	971,784,000	
西武ホールディングス	87,200	1,171.00	102,111,200	
鴻池運輸	11,500	1,125.00	12,937,500	
西日本鉄道	20,200	2,870.00	57,974,000	
ハマキョウレックス	5,600	3,060.00	17,136,000	
サカイ引越センター	3,200	5,040.00	16,128,000	
近鉄グループホールディングス	67,100	3,995.00	268,064,500	
阪急阪神ホールディングス	89,400	3,485.00	311,559,000	
南海電気鉄道	32,900	2,446.00	80,473,400	
京阪ホールディングス	29,900	3,995.00	119,450,500	
神戸電鉄	2,800	3,565.00	9,982,000	
名古屋鉄道	54,800	2,549.00	139,685,200	
山陽電気鉄道	6,300	1,854.00	11,680,200	
日本通運	23,200	7,930.00	183,976,000	
ヤマトホールディングス	94,800	2,969.00	281,461,200	
山九	17,300	4,685.00	81,050,500	
丸全昭和運輸	5,300	3,180.00	16,854,000	
センコーグループホールディングス	36,100	1,004.00	36,244,400	
トナミホールディングス	1,900	5,290.00	10,051,000	
ニッコンホールディングス	23,200	2,234.00	51,828,800	
福山通運	8,500	4,285.00	36,422,500	
セイノーホールディングス	50,400	1,512.00	76,204,800	
神奈川中央交通	2,400	3,605.00	8,652,000	
日立物流	14,600	3,285.00	47,961,000	
丸和運輸機関	13,800	1,933.00	26,675,400	
C & F ロジホールディングス	7,000	1,732.00	12,124,000	
九州旅客鉄道	52,500	2,486.00	130,515,000	
S Gホールディングス	127,700	2,517.00	321,420,900	
日本郵船	55,700	4,090.00	227,813,000	
商船三井	39,800	4,150.00	165,170,000	

川崎汽船	20,800	2,869.00	59,675,200	
N Sユニテッド海運	4,500	2,154.00	9,693,000	
飯野海運	34,600	528.00	18,268,800	
乾汽船	6,500	1,194.00	7,761,000	
日本航空	164,600	2,302.00	378,909,200	
A N Aホールディングス	182,700	2,506.50	457,937,550	
ランコム	2,200	8,750.00	19,250,000	
日新	6,700	1,336.00	8,951,200	
三菱倉庫	23,700	3,180.00	75,366,000	
三井倉庫ホールディングス	7,500	2,167.00	16,252,500	
住友倉庫	23,600	1,401.00	33,063,600	
澁澤倉庫	4,500	2,108.00	9,486,000	
東陽倉庫	20,900	322.00	6,729,800	
日本トランスシティ	18,000	512.00	9,216,000	
川西倉庫	4,000	1,181.00	4,724,000	
安田倉庫	7,600	931.00	7,075,600	
東洋埠頭	4,900	1,497.00	7,335,300	
上組	37,000	2,136.00	79,032,000	
近鉄エクスプレス	12,700	2,551.00	32,397,700	
エーアイティー	6,800	1,026.00	6,976,800	
N E C ネットエスアイ	22,400	1,833.00	41,059,200	
システナ	24,800	2,221.00	55,080,800	
デジタルアーツ	4,100	8,930.00	36,613,000	
日鉄ソリューションズ	10,200	3,515.00	35,853,000	
キューブシステム	5,100	1,158.00	5,905,800	
コア	4,500	1,505.00	6,772,500	
ラクーンホールディングス	5,900	2,949.00	17,399,100	
ソリトンシステムズ	4,300	1,807.00	7,770,100	
ソフトクリエイトホールディングス	3,200	2,546.00	8,147,200	
T I S	69,800	2,680.00	187,064,000	
電算システム	3,400	3,285.00	11,169,000	
グリー	44,100	566.00	24,960,600	
GMOペパボ	700	6,410.00	4,487,000	
コーエーテクモホールディングス	18,500	4,875.00	90,187,500	
三菱総合研究所	3,100	3,940.00	12,214,000	
ファインデックス	7,800	1,197.00	9,336,600	

ブレインパッド	2,100	5,370.00	11,277,000	
K L a b	14,300	835.00	11,940,500	
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディングス	10,500	1,193.00	12,526,500	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,746.00	4,119,000	
ネクソン	177,100	3,625.00	641,987,500	
アイスタイル	13,900	475.00	6,602,500	
エムアップホールディングス	2,200	2,903.00	6,386,600	
エイチーム	6,600	1,724.00	11,378,400	
エニグモ	7,400	1,300.00	9,620,000	
テクノスジャパン	8,900	671.00	5,971,900	
コロプラ	23,700	808.00	19,149,600	
ブロードリーフ	36,500	546.00	19,929,000	
デジタルハーツホールディングス	4,600	1,526.00	7,019,600	
システム情報	5,800	1,022.00	5,927,600	
メディアドゥ	2,700	6,060.00	16,362,000	
じげん	22,000	402.00	8,844,000	
ブイキューブ	4,100	3,225.00	13,222,500	
サイバーリンクス	2,700	1,621.00	4,376,700	
フィックスターズ	9,500	990.00	9,405,000	
CARTA HOLDINGS	4,000	1,473.00	5,892,000	
オブティム	5,200	2,851.00	14,825,200	
セレス	2,600	4,005.00	10,413,000	
SHIFT	3,100	15,400.00	47,740,000	
ティーガイア	7,100	1,901.00	13,497,100	
テクマトリックス	11,400	2,156.00	24,578,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,400	2,183.00	37,984,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	13,780.00	205,322,000	
システムリサーチ	3,000	1,981.00	5,943,000	
インターネットイニシアティブ	18,900	2,518.00	47,590,200	
さくらインターネット	10,300	799.00	8,229,700	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,600	6,340.00	10,144,000	
SRAホールディングス	4,700	2,628.00	12,351,600	
朝日ネット	7,500	752.00	5,640,000	
eBASE	9,300	1,014.00	9,430,200	
アバント	8,000	1,785.00	14,280,000	

アドソル日進	3,100	2,753.00	8,534,300	
フリービット	6,000	924.00	5,544,000	
コムチュア	6,300	2,656.00	16,732,800	
アステリア	6,400	850.00	5,440,000	
アイル	4,700	1,799.00	8,455,300	
マークライنز	3,700	3,030.00	11,211,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,300	2,045.00	16,973,500	
g u m i	11,200	1,222.00	13,686,400	
テラスカイ	2,600	3,045.00	7,917,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	2,182.00	9,600,800	
P C Iホールディングス	4,000	1,433.00	5,732,000	
ネオジャパン	2,100	1,698.00	3,565,800	
P R T I M E S	1,700	3,405.00	5,788,500	
ダブルスタンダード	1,400	3,875.00	5,425,000	
オープンドア	4,900	1,966.00	9,633,400	
アカツキ	2,900	4,155.00	12,049,500	
U b i c o mホールディングス	2,100	3,360.00	7,056,000	
カナミックネットワーク	8,500	707.00	6,009,500	
チェンジ	9,900	3,575.00	35,392,500	
オークネット	5,300	1,325.00	7,022,500	
エイトレッド	2,000	2,732.00	5,464,000	
マクロミル	16,700	879.00	14,679,300	
オロ	2,500	3,590.00	8,975,000	
ユーザーローカル	1,300	4,695.00	6,103,500	
プロトコーポレーション	8,000	1,203.00	9,624,000	
野村総合研究所	127,700	3,310.00	422,687,000	
サイバネットシステム	6,700	874.00	5,855,800	
インテージホールディングス	10,200	1,336.00	13,627,200	
ソースネクスト	38,400	331.00	12,710,400	
インフォコム	6,500	2,940.00	19,110,000	
HEROZ	2,200	2,852.00	6,274,400	
ラクスル	6,000	5,450.00	32,700,000	
I P S	1,600	2,540.00	4,064,000	
イーソル	5,100	1,229.00	6,267,900	
アルテリア・ネットワークス	8,400	1,572.00	13,204,800	
E d u L a b	900	7,390.00	6,651,000	

ギフトィ	3,400	3,255.00	11,067,000	
ベース	800	6,440.00	5,152,000	
フォーカスシステムズ	6,900	920.00	6,348,000	
クレスコ	6,300	1,660.00	10,458,000	
フジ・メディア・ホールディングス	72,400	1,322.00	95,712,800	
オービック	22,000	20,740.00	456,280,000	
ジャストシステム	9,900	6,530.00	64,647,000	
TDCソフト	7,700	1,052.00	8,100,400	
Zホールディングス	964,800	517.60	499,380,480	
トレンドマイクロ	37,500	5,330.00	199,875,000	
日本オラクル	14,200	10,300.00	146,260,000	
アルファシステムズ	2,200	3,615.00	7,953,000	
フューチャー	8,800	1,984.00	17,459,200	
CAC Holdings	6,100	1,443.00	8,802,300	
S Bテクノロジー	2,800	3,250.00	9,100,000	
オービックビジネスコンサルタント	7,000	6,190.00	43,330,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	3,635.00	114,139,000	
アイティフォー	11,200	793.00	8,881,600	
大塚商会	37,700	5,370.00	202,449,000	
サイボウズ	8,300	2,527.00	20,974,100	
電通国際情報サービス	8,700	4,000.00	34,800,000	
ACCESS	9,900	888.00	8,791,200	
デジタルガレージ	11,900	4,600.00	54,740,000	
EMシステムズ	13,100	844.00	11,056,400	
ウェザーニューズ	2,400	5,470.00	13,128,000	
C I J	6,500	900.00	5,850,000	
WOWOW	3,500	2,735.00	9,572,500	
スカラ	8,600	801.00	6,888,600	
ネットワンシステムズ	28,800	3,370.00	97,056,000	
アルゴグラフィックス	5,500	3,210.00	17,655,000	
マーベラス	12,800	841.00	10,764,800	
エイベックス	12,600	1,488.00	18,748,800	
日本ユニシス	24,500	3,455.00	84,647,500	
兼松エレクトロニクス	3,700	3,660.00	13,542,000	
都築電気	3,300	1,861.00	6,141,300	
TBSホールディングス	46,700	2,127.00	99,330,900	

日本テレビホールディングス	58,200	1,427.00	83,051,400	
朝日放送グループホールディングス	11,000	698.00	7,678,000	
テレビ朝日ホールディングス	21,900	1,999.00	43,778,100	
スカパーJ S A Tホールディングス	47,900	474.00	22,704,600	
テレビ東京ホールディングス	5,200	2,281.00	11,861,200	
ビジョン	10,100	1,020.00	10,302,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	3,100	2,219.00	6,878,900	
コネクシオ	4,500	1,383.00	6,223,500	
日本電信電話	818,500	2,778.50	2,274,202,250	
KDDI	561,700	3,318.00	1,863,720,600	
ソフトバンク	636,500	1,426.00	907,649,000	
光通信	8,200	22,050.00	180,810,000	
エムティーアイ	9,500	783.00	7,438,500	
GMOインターネット	25,500	3,175.00	80,962,500	
ファイバーゲート	2,800	1,583.00	4,432,400	
KADOKAWA	19,000	4,325.00	82,175,000	
学研ホールディングス	9,600	1,405.00	13,488,000	
ゼンリン	13,900	1,252.00	17,402,800	
アイネット	5,000	1,476.00	7,380,000	
松竹	4,700	12,620.00	59,314,000	
東宝	41,300	4,445.00	183,578,500	
東映	2,300	23,970.00	55,131,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	185,700	1,690.00	313,833,000	
ピー・シー・エー	1,400	4,950.00	6,930,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,200	1,841.00	5,891,200	
D T S	13,700	2,538.00	34,770,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,900	6,330.00	189,267,000	
シーイーシー	8,500	1,403.00	11,925,500	
カプコン	60,000	3,525.00	211,500,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,229.00	5,161,800	
ジャステック	5,800	1,257.00	7,290,600	
S C S K	16,200	6,450.00	104,490,000	
日本システムウエア	3,000	2,041.00	6,123,000	
アイネス	8,500	1,403.00	11,925,500	
T K C	11,400	3,465.00	39,501,000	
富士ソフト	7,400	5,480.00	40,552,000	

N S D	22,400	1,779.00	39,849,600	
コナミホールディングス	25,400	6,490.00	164,846,000	
福井コンピュータホールディングス	3,600	4,470.00	16,092,000	
J B C Cホールディングス	6,000	1,401.00	8,406,000	
ミロク情報サービス	7,400	1,911.00	14,141,400	
ソフトバンクグループ	556,000	10,135.00	5,635,060,000	
伊藤忠食品	2,000	5,150.00	10,300,000	
エレマテック	7,500	1,181.00	8,857,500	
あらた	5,500	4,510.00	24,805,000	
東京エレクトロニクス デバイス	2,700	5,240.00	14,148,000	
フィールズ	9,400	504.00	4,737,600	
双日	384,200	308.00	118,333,600	
アルフレッサ ホールディングス	72,700	1,991.00	144,745,700	
横浜冷凍	18,400	888.00	16,339,200	
アルコニックス	8,000	1,500.00	12,000,000	
神戸物産	48,400	3,095.00	149,798,000	
あい ホールディングス	10,800	2,124.00	22,939,200	
ダイワボウホールディングス	31,500	1,694.00	53,361,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	16,700	2,218.00	37,040,600	
ラクト・ジャパン	3,500	2,823.00	9,880,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,400	712.00	10,252,800	
八洲電機	8,800	963.00	8,474,400	
レスターホールディングス	7,700	1,983.00	15,269,100	
ジュテックホールディングス	3,200	1,014.00	3,244,800	
T O K A I ホールディングス	32,400	898.00	29,095,200	
三洋貿易	8,900	1,080.00	9,612,000	
ウイン・パートナーズ	5,900	991.00	5,846,900	
シップヘルスケアホールディングス	25,000	2,890.00	72,250,000	
コメダホールディングス	15,200	2,004.00	30,460,800	
アセンテック	2,400	1,513.00	3,631,200	
小野建	7,400	1,305.00	9,657,000	
佐島電機	7,800	799.00	6,232,200	
伯東	5,700	1,259.00	7,176,300	
コンドーテック	7,100	1,010.00	7,171,000	
ナガイレーベン	9,700	2,613.00	25,346,100	
三菱食品	6,900	3,015.00	20,803,500	

松田産業	5,900	2,215.00	13,068,500	
第一興商	11,000	4,385.00	48,235,000	
メディopalホールディングス	69,700	2,063.00	143,791,100	
S P K	5,500	1,301.00	7,155,500	
萩原電気ホールディングス	3,400	2,555.00	8,687,000	
アズワン	5,100	14,060.00	71,706,000	
尾家産業	4,000	1,207.00	4,828,000	
シモジマ	6,000	1,202.00	7,212,000	
ドウシシャ	6,700	1,865.00	12,495,500	
高速	5,000	1,412.00	7,060,000	
丸文	10,900	512.00	5,580,800	
ハピネット	6,900	1,476.00	10,184,400	
日本ライフライン	22,700	1,516.00	34,413,200	
タカショー	7,500	757.00	5,677,500	
マルカ	3,600	1,984.00	7,142,400	
I D O M	25,700	647.00	16,627,900	
進和	5,200	2,100.00	10,920,000	
ダイトロン	4,100	1,869.00	7,662,900	
シークス	9,800	1,485.00	14,553,000	
オーハシテクニカ	5,300	1,438.00	7,621,400	
伊藤忠商事	490,800	3,430.00	1,683,444,000	
丸紅	694,000	899.50	624,253,000	
長瀬産業	39,700	1,679.00	66,656,300	
蝶理	5,600	1,573.00	8,808,800	
豊田通商	70,100	4,755.00	333,325,500	
三共生興	16,400	520.00	8,528,000	
兼松	27,400	1,422.00	38,962,800	
三井物産	570,300	2,269.50	1,294,295,850	
日本紙パルプ商事	3,900	3,645.00	14,215,500	
カメイ	9,700	1,168.00	11,329,600	
スターゼン	5,800	2,327.00	13,496,600	
山善	26,400	992.00	26,188,800	
椿本興業	1,800	3,510.00	6,318,000	
住友商事	444,600	1,498.00	666,010,800	
内田洋行	3,000	4,765.00	14,295,000	
三菱商事	427,400	3,012.00	1,287,328,800	

第一実業	3,400	4,145.00	14,093,000	
キャノンマーケティングジャパン	17,700	2,601.00	46,037,700	
西華産業	5,600	1,668.00	9,340,800	
佐藤商事	7,900	992.00	7,836,800	
菱洋エレクトロ	5,500	2,700.00	14,850,000	
東京産業	10,100	600.00	6,060,000	
ユアサ商事	7,100	3,020.00	21,442,000	
阪和興業	13,800	3,195.00	44,091,000	
正栄食品工業	4,600	4,190.00	19,274,000	
カナデン	7,200	1,148.00	8,265,600	
菱電商事	6,400	1,640.00	10,496,000	
フルサト工業	5,500	1,314.00	7,227,000	
岩谷産業	17,000	6,760.00	114,920,000	
極東貿易	3,700	1,361.00	5,035,700	
イワキ	10,800	748.00	8,078,400	
三愛石油	17,600	1,250.00	22,000,000	
稲畑産業	16,400	1,654.00	27,125,600	
G S I クレオス	5,200	1,176.00	6,115,200	
ヤマエ久野	6,800	1,058.00	7,194,400	
ワキタ	14,400	1,063.00	15,307,200	
東邦ホールディングス	23,100	1,874.00	43,289,400	
サンゲツ	18,800	1,543.00	29,008,400	
ミツウロコグループホールディングス	10,600	1,444.00	15,306,400	
シナネンホールディングス	3,100	3,030.00	9,393,000	
伊藤忠エネクス	14,400	1,045.00	15,048,000	
サンリオ	19,600	1,792.00	35,123,200	
サンワテクノス	6,000	1,108.00	6,648,000	
リョーサン	8,200	2,161.00	17,720,200	
新光商事	12,800	751.00	9,612,800	
トーヨー	4,700	1,794.00	8,431,800	
三信電気	4,800	2,145.00	10,296,000	
東陽テクニカ	9,200	1,066.00	9,807,200	
モスフードサービス	10,200	3,050.00	31,110,000	
加賀電子	6,700	2,385.00	15,979,500	
ソーダニッカ	12,000	546.00	6,552,000	
立花エレテック	6,100	1,589.00	9,692,900	

PAL TAC	11,300	5,840.00	65,992,000	
三谷産業	12,400	453.00	5,617,200	
太平洋興発	7,700	668.00	5,143,600	
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,300	2,710.00	6,233,000	
国際紙パルプ商事	24,700	239.00	5,903,300	
ヤマタネ	4,700	1,486.00	6,984,200	
日鉄物産	4,600	3,855.00	17,733,000	
泉州電業	2,500	3,605.00	9,012,500	
トラスコ中山	15,800	2,766.00	43,702,800	
オートバックスセブン	27,800	1,472.00	40,921,600	
モリト	10,000	606.00	6,060,000	
加藤産業	9,600	3,245.00	31,152,000	
イノテック	5,500	1,316.00	7,238,000	
イエローハット	13,300	1,845.00	24,538,500	
J Kホールディングス	8,100	807.00	6,536,700	
日伝	6,100	2,119.00	12,925,900	
杉本商事	4,100	2,291.00	9,393,100	
因幡電機産業	18,000	2,583.00	46,494,000	
東テク	2,900	2,972.00	8,618,800	
ミスミグループ本社	88,000	3,110.00	273,680,000	
タキヒヨー	4,100	1,925.00	7,892,500	
スズケン	29,900	3,955.00	118,254,500	
ジェコス	6,700	922.00	6,177,400	
ローソン	18,000	5,060.00	91,080,000	
サンエー	5,000	4,295.00	21,475,000	
カワチ薬品	5,000	2,568.00	12,840,000	
エービーシー・マート	11,000	5,940.00	65,340,000	
アスクル	6,400	3,970.00	25,408,000	
ゲオホールディングス	9,800	1,117.00	10,946,600	
アダストリア	10,200	1,819.00	18,553,800	
くら寿司	4,300	7,720.00	33,196,000	
キャンドゥ	4,900	2,147.00	10,520,300	
パルグループホールディングス	7,300	1,562.00	11,402,600	
エディオン	28,000	1,166.00	32,648,000	
サーラコーポレーション	16,100	607.00	9,772,700	
ハローズ	3,000	2,960.00	8,880,000	

フジオフードグループ本社	7,900	1,411.00	11,146,900	
あみやき亭	2,700	2,776.00	7,495,200	
大黒天物産	1,900	8,260.00	15,694,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,046.00	7,112,800	
アルペン	5,800	2,406.00	13,954,800	
クオールホールディングス	10,700	1,417.00	15,161,900	
ジンズホールディングス	4,000	8,010.00	32,040,000	
ビックカメラ	41,700	1,133.00	47,246,100	
DCMホールディングス	42,900	1,112.00	47,704,800	
Monotaro	100,200	2,820.00	282,564,000	
アークランドサービスホールディングス	6,500	2,184.00	14,196,000	
J. フロント リテイリング	85,800	994.00	85,285,200	
ドトール・日レスホールディングス	11,500	1,615.00	18,572,500	
マツモトキヨシホールディングス	29,000	4,525.00	131,225,000	
ブロンコビリー	5,000	2,401.00	12,005,000	
ZOZO	41,800	3,485.00	145,673,000	
物語コーポレーション	4,000	7,290.00	29,160,000	
ココカラファイン	6,200	7,700.00	47,740,000	
三越伊勢丹ホールディングス	124,400	735.00	91,434,000	
Hamee	2,300	1,673.00	3,847,900	
ウエルシアホールディングス	37,100	3,555.00	131,890,500	
クリエイトSDホールディングス	10,200	3,370.00	34,374,000	
シュッピン	6,800	1,117.00	7,595,600	
オイシックス・ラ・大地	7,200	3,005.00	21,636,000	
ネクステージ	12,200	1,756.00	21,423,200	
ジョイフル本田	20,100	1,365.00	27,436,500	
ホットランド	8,000	1,293.00	10,344,000	
すかいらーくホールディングス	80,000	1,631.00	130,480,000	
SFPホールディングス	5,300	1,322.00	7,006,600	
綿半ホールディングス	6,600	1,303.00	8,599,800	
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	1,152.00	22,694,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,529.00	8,868,200	
BEENOS	3,800	2,945.00	11,191,000	
あさひ	5,600	1,499.00	8,394,400	
日本調剤	5,500	1,693.00	9,311,500	

コスモス薬品	7,100	15,990.00	113,529,000	
セブン&アイ・ホールディングス	275,200	4,520.00	1,243,904,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	39,300	752.00	29,553,600	
ツルハホールディングス	15,300	12,830.00	196,299,000	
サンマルクホールディングス	7,300	1,660.00	12,118,000	
トリドールホールディングス	18,100	1,715.00	31,041,500	
JMホールディングス	6,100	2,090.00	12,749,000	
アレンザホールディングス	5,400	1,278.00	6,901,200	
パロックジャパンリミテッド	8,000	756.00	6,048,000	
クスリのアオキホールディングス	7,200	8,080.00	58,176,000	
FOOD & LIFE COMPANIE	38,700	5,100.00	197,370,000	
メディカルシステムネットワーク	8,300	837.00	6,947,100	
ノジマ	12,400	2,796.00	34,670,400	
カッパ・クリエイト	11,300	1,440.00	16,272,000	
良品計画	93,800	2,308.00	216,490,400	
アドヴァン	8,300	961.00	7,976,300	
アルビス	3,000	2,364.00	7,092,000	
コナカ	18,700	329.00	6,152,300	
G-7ホールディングス	4,600	2,831.00	13,022,600	
イオン北海道	11,100	1,108.00	12,298,800	
コジマ	14,000	874.00	12,236,000	
コーナン商事	9,800	3,035.00	29,743,000	
エコス	3,400	1,891.00	6,429,400	
ワタミ	11,400	961.00	10,955,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	140,400	2,425.00	340,470,000	
西松屋チェーン	15,900	1,672.00	26,584,800	
ゼンショーホールディングス	38,200	2,790.00	106,578,000	
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,609.00	9,814,900	
サイゼリヤ	11,400	2,349.00	26,778,600	
V Tホールディングス	29,100	415.00	12,076,500	
フジ・コーポレーション	3,000	2,719.00	8,157,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	1,905.00	16,764,000	
ハイデイ日高	10,400	1,686.00	17,534,400	
コロワイド	18,900	1,827.00	34,530,300	
ピーシーデポコーポレーション	11,400	459.00	5,232,600	

壱番屋	5,100	4,865.00	24,811,500	
スギホールディングス	14,100	8,720.00	122,952,000	
薬王堂ホールディングス	3,500	2,411.00	8,438,500	
スクロール	10,700	1,017.00	10,881,900	
ヨンドシーホールディングス	7,200	1,878.00	13,521,600	
木曽路	9,700	2,296.00	22,271,200	
S R Sホールディングス	12,000	815.00	9,780,000	
千趣会	19,800	388.00	7,682,400	
リテールパートナーズ	9,200	1,283.00	11,803,600	
ケーヨー	16,300	723.00	11,784,900	
上新電機	8,200	2,762.00	22,648,400	
日本瓦斯	35,100	1,880.00	65,988,000	
ロイヤルホールディングス	9,200	1,921.00	17,673,200	
いなげや	8,000	1,648.00	13,184,000	
チヨダ	11,100	892.00	9,901,200	
ライフコーポレーション	5,400	3,710.00	20,034,000	
リンガーハット	9,800	2,224.00	21,795,200	
MrMaxHD	11,600	668.00	7,748,800	
AOKIホールディングス	17,900	590.00	10,561,000	
オークワ	11,600	1,188.00	13,780,800	
コメリ	10,800	2,923.00	31,568,400	
青山商事	19,500	798.00	15,561,000	
しまむら	8,100	11,190.00	90,639,000	
高島屋	53,500	1,164.00	62,274,000	
松屋	17,400	907.00	15,781,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,000	834.00	28,356,000	
近鉄百貨店	3,200	3,135.00	10,032,000	
丸井グループ	60,300	2,062.00	124,338,600	
アクシアル リテイリング	5,700	4,620.00	26,334,000	
イオン	270,400	3,026.00	818,230,400	
イズミ	14,600	4,410.00	64,386,000	
平和堂	12,300	2,308.00	28,388,400	
フジ	8,700	2,077.00	18,069,900	
ヤオコー	8,100	7,190.00	58,239,000	
ゼビオホールディングス	10,400	876.00	9,110,400	
ケーズホールディングス	62,300	1,495.00	93,138,500	

日産東京販売ホールディングス	20,900	243.00	5,078,700	
Genky Drug Stores	3,200	3,410.00	10,912,000	
ブックオフグループホールディングス	6,100	965.00	5,886,500	
アインホールディングス	10,400	6,240.00	64,896,000	
元気寿司	2,900	2,469.00	7,160,100	
ヤマダホールディングス	234,300	558.00	130,739,400	
アークランドサカモト	11,400	1,557.00	17,749,800	
ニトリホールディングス	28,000	20,100.00	562,800,000	
グルメ杵屋	6,900	944.00	6,513,600	
吉野家ホールディングス	24,400	2,029.00	49,507,600	
松屋フーズホールディングス	3,600	3,495.00	12,582,000	
サガミホールディングス	12,900	1,035.00	13,351,500	
関西スーパーマーケット	6,600	1,113.00	7,345,800	
王将フードサービス	4,600	5,610.00	25,806,000	
プレナス	8,300	2,002.00	16,616,600	
ミニストップ	6,900	1,429.00	9,860,100	
アークス	13,100	2,407.00	31,531,700	
パローホールディングス	13,900	2,380.00	33,082,000	
ベルク	3,600	5,940.00	21,384,000	
ファーストリテイリング	9,400	88,220.00	829,268,000	
サンドラッグ	26,500	3,880.00	102,820,000	
ベルーナ	15,800	1,219.00	19,260,200	
じもとホールディングス	5,600	698.00	3,908,800	
めぶきフィナンシャルグループ	366,400	237.00	86,836,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,400	1,211.00	11,383,400	
九州フィナンシャルグループ	142,600	423.00	60,319,800	
ゆうちょ銀行	199,000	988.00	196,612,000	
富山第一銀行	18,800	288.00	5,414,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	429,100	414.00	177,647,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	47,900	698.00	33,434,200	
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,306.00	8,750,200	
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,361.00	27,151,500	
ひろぎんホールディングス	104,600	603.00	63,073,800	
新生銀行	57,800	1,603.00	92,653,400	
あおぞら銀行	42,200	2,341.00	98,790,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,819,900	572.50	2,759,392,750	

りそなホールディングス	811,000	438.70	355,785,700	
三井住友トラスト・ホールディングス	132,500	3,692.00	489,190,000	
三井住友フィナンシャルグループ	487,200	3,767.00	1,835,282,400	
千葉銀行	235,500	685.00	161,317,500	
群馬銀行	145,900	359.00	52,378,100	
武蔵野銀行	10,500	1,649.00	17,314,500	
千葉興業銀行	20,200	266.00	5,373,200	
筑波銀行	30,600	166.00	5,079,600	
七十七銀行	22,300	1,360.00	30,328,000	
青森銀行	5,600	2,299.00	12,874,400	
秋田銀行	4,800	1,375.00	6,600,000	
山形銀行	8,600	1,018.00	8,754,800	
岩手銀行	4,800	2,107.00	10,113,600	
東邦銀行	67,000	217.00	14,539,000	
東北銀行	4,000	1,043.00	4,172,000	
みちのく銀行	4,500	1,041.00	4,684,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,800	1,879.00	119,880,200	
静岡銀行	168,800	836.00	141,116,800	
十六銀行	8,900	2,021.00	17,986,900	
スルガ銀行	64,200	390.00	25,038,000	
八十二銀行	154,500	367.00	56,701,500	
山梨中央銀行	8,100	815.00	6,601,500	
大垣共立銀行	14,200	1,986.00	28,201,200	
福井銀行	6,200	1,794.00	11,122,800	
北國銀行	6,700	2,547.00	17,064,900	
清水銀行	3,000	1,590.00	4,770,000	
富山銀行	1,500	2,747.00	4,120,500	
滋賀銀行	14,100	2,182.00	30,766,200	
南都銀行	10,400	1,814.00	18,865,600	
百五銀行	66,300	310.00	20,553,000	
京都銀行	25,300	5,970.00	151,041,000	
紀陽銀行	25,100	1,457.00	36,570,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	47,200	927.00	43,754,400	
山陰合同銀行	46,400	507.00	23,524,800	
中国銀行	61,200	863.00	52,815,600	
伊予銀行	92,600	598.00	55,374,800	

百十四銀行	7,500	1,541.00	11,557,500	
四国銀行	9,800	708.00	6,938,400	
阿波銀行	11,000	2,206.00	24,266,000	
大分銀行	4,500	1,957.00	8,806,500	
宮崎銀行	4,900	2,260.00	11,074,000	
佐賀銀行	4,500	1,383.00	6,223,500	
沖縄銀行	6,700	2,749.00	18,418,300	
琉球銀行	15,300	721.00	11,031,300	
セブン銀行	238,400	233.00	55,547,200	
みずほフィナンシャルグループ	956,100	1,542.50	1,474,784,250	
山口フィナンシャルグループ	89,000	647.00	57,583,000	
名古屋銀行	5,600	2,798.00	15,668,800	
北洋銀行	108,200	277.00	29,971,400	
愛知銀行	2,400	2,804.00	6,729,600	
中京銀行	3,000	1,695.00	5,085,000	
愛媛銀行	9,500	919.00	8,730,500	
京葉銀行	32,400	417.00	13,510,800	
栃木銀行	40,500	175.00	7,087,500	
北日本銀行	2,700	1,812.00	4,892,400	
東和銀行	12,600	613.00	7,723,800	
トモニホールディングス	57,600	301.00	17,337,600	
フィデアホールディングス	75,000	125.00	9,375,000	
池田泉州ホールディングス	82,400	169.00	13,925,600	
F P G	22,000	675.00	14,850,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	4,500	1,607.00	7,231,500	
S B I ホールディングス	86,300	2,959.00	255,361,700	
ジャフコ グループ	11,200	7,460.00	83,552,000	
大和証券グループ本社	523,100	560.00	292,936,000	
野村ホールディングス	1,075,400	571.20	614,268,480	
岡三証券グループ	62,600	451.00	28,232,600	
丸三証券	22,100	626.00	13,834,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,300	396.00	30,214,800	
水戸証券	24,200	303.00	7,332,600	
いちよし証券	16,300	601.00	9,796,300	
松井証券	36,200	897.00	32,471,400	
マネックスグループ	63,800	858.00	54,740,400	

極東証券	10,900	822.00	8,959,800	
岩井コスモホールディングス	7,500	1,690.00	12,675,000	
藍澤證券	13,900	1,007.00	13,997,300	
スパークス・グループ	33,800	292.00	9,869,600	
かんぽ生命保険	87,900	2,096.00	184,238,400	
SOMPOホールディングス	124,000	4,073.00	505,052,000	
アニコム ホールディングス	22,200	1,021.00	22,666,200	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	170,300	3,135.00	533,890,500	
第一生命ホールディングス	371,600	1,932.50	718,117,000	
東京海上ホールディングス	233,300	5,289.00	1,233,923,700	
T & Dホールディングス	210,200	1,307.00	274,731,400	
アドバンスクリエイト	4,000	1,063.00	4,252,000	
全国保証	18,500	4,965.00	91,852,500	
日本モーゲージサービス	4,200	1,040.00	4,368,000	
アルヒ	11,500	1,791.00	20,596,500	
プレミアグループ	3,900	2,461.00	9,597,900	
クレディセゾン	41,500	1,215.00	50,422,500	
芙蓉総合リース	7,400	7,170.00	53,058,000	
みずほリース	11,100	3,200.00	35,520,000	
東京センチュリー	16,300	6,880.00	112,144,000	
日本証券金融	28,700	798.00	22,902,600	
アイフル	123,900	300.00	37,170,000	
リコーリース	6,100	3,440.00	20,984,000	
イオンフィナンシャルサービス	43,200	1,226.00	52,963,200	
アコム	142,000	474.00	67,308,000	
ジャックス	8,500	2,115.00	17,977,500	
オリエントコーポレーション	199,800	146.00	29,170,800	
オリックス	435,200	1,752.00	762,470,400	
三菱HCキャピタル	240,100	625.00	150,062,500	
日本取引所グループ	190,500	2,685.00	511,492,500	
イー・ギャランティ	8,800	2,127.00	18,717,600	
NECキャピタルソリューション	3,500	1,898.00	6,643,000	
いちご	82,300	344.00	28,311,200	
日本駐車場開発	89,800	159.00	14,278,200	
スター・マイカ・ホールディングス	5,200	1,146.00	5,959,200	

S R Eホールディングス	1,000	5,560.00	5,560,000	
ヒューリック	149,300	1,266.00	189,013,800	
三栄建築設計	3,500	2,032.00	7,112,000	
野村不動産ホールディングス	42,700	2,602.00	111,105,400	
三重交通グループホールディングス	18,800	478.00	8,986,400	
サムティ	10,100	1,977.00	19,967,700	
ディア・ライフ	16,100	465.00	7,486,500	
日本商業開発	6,500	1,688.00	10,972,000	
プレサンスコーポレーション	11,800	1,648.00	19,446,400	
日本管理センター	5,600	1,261.00	7,061,600	
フージャースホールディングス	13,600	658.00	8,948,800	
オープンハウス	22,200	4,615.00	102,453,000	
東急不動産ホールディングス	191,300	590.00	112,867,000	
飯田グループホールディングス	58,100	2,668.00	155,010,800	
ハウスドゥ	4,800	1,061.00	5,092,800	
ケイアイスター不動産	2,300	3,730.00	8,579,000	
グッドコムアセット	3,900	1,431.00	5,580,900	
ジェイ・エス・ビー	1,700	3,380.00	5,746,000	
パーク 2 4	38,300	2,115.00	81,004,500	
パラカ	4,600	1,680.00	7,728,000	
三井不動産	321,200	2,399.00	770,558,800	
三菱地所	462,700	1,820.00	842,114,000	
平和不動産	12,000	3,650.00	43,800,000	
東京建物	70,200	1,616.00	113,443,200	
ダイビル	19,000	1,334.00	25,346,000	
京阪神ビルディング	12,900	1,491.00	19,233,900	
住友不動産	158,600	3,676.00	583,013,600	
テーオーシー	16,500	726.00	11,979,000	
東京楽天地	1,800	4,390.00	7,902,000	
スターツコーポレーション	7,800	2,701.00	21,067,800	
フジ住宅	11,800	679.00	8,012,200	
空港施設	13,100	598.00	7,833,800	
ゴールドクレスト	7,400	1,609.00	11,906,600	
日本エスコン	13,600	748.00	10,172,800	
タカラレーベン	35,000	351.00	12,285,000	
A V A N T I A	7,800	893.00	6,965,400	

イオンモール	35,500	1,759.00	62,444,500	
カチタス	17,500	3,205.00	56,087,500	
トーセイ	11,500	1,077.00	12,385,500	
サンフロンティア不動産	11,200	945.00	10,584,000	
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	1,038.00	7,888,800	
ランドビジネス	13,800	361.00	4,981,800	
日本空港ビルデング	22,800	4,945.00	112,746,000	
日本工営	4,700	2,954.00	13,883,800	
L I F U L L	29,900	384.00	11,481,600	
ミクシィ	13,200	2,737.00	36,128,400	
ジェイエシーリクルートメント	5,500	1,801.00	9,905,500	
日本M&Aセンター	112,200	2,950.00	330,990,000	
メンバーズ	2,600	2,585.00	6,721,000	
U T グループ	10,100	3,630.00	36,663,000	
アイティメディア	2,900	1,901.00	5,512,900	
タケエイ	9,100	1,261.00	11,475,100	
夢真ビーネックスグループ	10,100	1,460.00	14,746,000	
コシダカホールディングス	19,800	554.00	10,969,200	
パソナグループ	7,900	2,019.00	15,950,100	
リンクアンドモチベーション	15,200	643.00	9,773,600	
G C A	13,300	796.00	10,586,800	
エス・エム・エス	23,900	3,280.00	78,392,000	
パーソルホールディングス	68,900	2,054.00	141,520,600	
リニカル	6,600	733.00	4,837,800	
クックパッド	29,600	304.00	8,998,400	
スタジオアリス	4,600	2,387.00	10,980,200	
シミックホールディングス	4,900	1,619.00	7,933,100	
総合警備保障	27,100	4,860.00	131,706,000	
カカクコム	50,900	2,977.00	151,529,300	
アイロムグループ	3,300	2,492.00	8,223,600	
セントケア・ホールディング	6,400	1,205.00	7,712,000	
ルネサンス	7,300	1,116.00	8,146,800	
ディップ	10,900	3,075.00	33,517,500	
デジタルホールディングス	5,400	1,912.00	10,324,800	
新日本科学	11,100	722.00	8,014,200	
ベネフィット・ワン	25,400	2,873.00	72,974,200	

エムスリー	120,400	7,589.00	913,715,600	
アウトソーシング	39,700	1,726.00	68,522,200	
ウェルネット	14,600	571.00	8,336,600	
ワールドホールディングス	2,900	2,800.00	8,120,000	
ディー・エヌ・エー	29,600	2,124.00	62,870,400	
博報堂D Yホールディングス	95,200	1,785.00	169,932,000	
ぐるなび	15,600	595.00	9,282,000	
タカミヤ	12,900	550.00	7,095,000	
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	736.00	5,667,200	
ファンコミュニケーションズ	23,800	397.00	9,448,600	
ライク	2,700	2,473.00	6,677,100	
エスプール	18,300	988.00	18,080,400	
WDBホールディングス	3,700	2,376.00	8,791,200	
手間いらず	900	5,860.00	5,274,000	
アドウェイズ	9,900	836.00	8,276,400	
バリューコマース	4,800	3,635.00	17,448,000	
インフォマート	70,900	1,026.00	72,743,400	
J Pホールディングス	27,700	306.00	8,476,200	
E P Sホールディングス	10,700	1,176.00	12,583,200	
プレステージ・インターナショナル	26,500	764.00	20,246,000	
アミューズ	4,600	2,348.00	10,800,800	
ドリームインキュベータ	4,300	1,002.00	4,308,600	
クイック	6,300	1,166.00	7,345,800	
電通グループ	77,000	3,340.00	257,180,000	
イオンファンタジー	3,400	2,013.00	6,844,200	
シーティーエス	8,900	852.00	7,582,800	
H. U. グループホールディングス	19,800	3,600.00	71,280,000	
アルプス技研	6,800	2,024.00	13,763,200	
日本空調サービス	11,200	735.00	8,232,000	
オリエンタルランド	72,600	15,700.00	1,139,820,000	
ダスキン	16,400	2,590.00	42,476,000	
明光ネットワークジャパン	13,600	600.00	8,160,000	
ファルコホールディングス	4,600	1,680.00	7,728,000	
ラウンドワン	24,400	1,099.00	26,815,600	
リゾートトラスト	32,900	1,751.00	57,607,900	
ビー・エム・エル	8,800	3,695.00	32,516,000	

りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,368.00	14,637,600	
リソー教育	40,400	307.00	12,402,800	
ユー・エス・エス	76,600	2,027.00	155,268,200	
東京個別指導学院	9,400	592.00	5,564,800	
サイバーエージェント	168,800	1,946.00	328,484,800	
楽天グループ	318,700	1,376.00	438,531,200	
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,580.00	7,900,000	
モーニングスター	13,700	487.00	6,671,900	
山田コンサルティンググループ	5,800	1,157.00	6,710,600	
セントラルスポーツ	4,100	2,328.00	9,544,800	
フルキャストホールディングス	7,000	1,920.00	13,440,000	
エン・ジャパン	12,500	3,450.00	43,125,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,800	8,630.00	119,094,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,900	15,220.00	44,138,000	
K e e P e r 技研	4,900	2,322.00	11,377,800	
G u n o s y	6,100	966.00	5,892,600	
イー・ガーディアン	3,300	2,900.00	9,570,000	
ジャパンマテリアル	21,400	1,324.00	28,333,600	
ベクトル	9,600	963.00	9,244,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,900	1,251.00	7,380,900	
キャリアリンク	2,700	2,238.00	6,042,600	
I B J	7,800	923.00	7,199,400	
アサンテ	4,100	1,839.00	7,539,900	
バリューHR	4,000	1,632.00	6,528,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,600	5,180.00	29,008,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,681.00	5,883,500	
シグマクシス	4,500	2,104.00	9,468,000	
ウィルグループ	6,600	1,030.00	6,798,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,800	270.00	4,266,000	
メドピア	3,300	5,960.00	19,668,000	
リクルートホールディングス	488,800	5,038.00	2,462,574,400	
エラン	9,400	1,323.00	12,436,200	
日本郵政	516,600	911.00	470,622,600	
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,712.00	20,715,200	
鎌倉新書	8,200	1,288.00	10,561,600	
アトラエ	5,000	1,750.00	8,750,000	

ストライク	2,700	4,730.00	12,771,000	
ソラスト	17,200	1,414.00	24,320,800	
セラク	2,800	2,327.00	6,515,600	
インソース	6,100	2,517.00	15,353,700	
ベйкаレント・コンサルティング	4,500	31,000.00	139,500,000	
Orchestra Holdings	2,200	2,998.00	6,595,600	
アイモバイル	3,300	1,337.00	4,412,100	
グレイステクノロジー	7,200	2,832.00	20,390,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,800	2,252.00	44,589,600	
ミダック	1,800	5,500.00	9,900,000	
日総工産	7,100	734.00	5,211,400	
キュービーネットホールディングス	5,000	1,761.00	8,805,000	
RPAホールディングス	9,700	806.00	7,818,200	
マネジメントソリューションズ	4,000	2,018.00	8,072,000	
プロレド・パートナーズ	1,200	3,095.00	3,714,000	
カーブスホールディングス	20,200	940.00	18,988,000	
ダイレクトマーケティングミックス	3,200	3,465.00	11,088,000	
ポピンズホールディングス	1,700	4,295.00	7,301,500	
LITALICO	3,100	4,815.00	14,926,500	
リログループ	38,300	2,338.00	89,545,400	
東祥	5,300	1,809.00	9,587,700	
エイチ・アイ・エス	10,400	2,205.00	22,932,000	
ラックランド	3,000	2,416.00	7,248,000	
共立メンテナンス	11,700	3,475.00	40,657,500	
イチネンホールディングス	8,600	1,269.00	10,913,400	
建設技術研究所	5,000	2,543.00	12,715,000	
長大	3,500	1,740.00	6,090,000	
燦ホールディングス	4,800	1,081.00	5,188,800	
東京テアトル	6,200	1,251.00	7,756,200	
ナガワ	2,200	8,230.00	18,106,000	
東京都競馬	4,700	5,890.00	27,683,000	
カナモト	12,400	2,701.00	33,492,400	
西尾レントオール	6,500	3,000.00	19,500,000	
トランス・コスモス	6,900	3,090.00	21,321,000	
乃村工藝社	30,700	816.00	25,051,200	

日本管財	7,100	2,138.00	15,179,800	
トーカイ	6,700	2,409.00	16,140,300	
セコム	67,200	9,220.00	619,584,000	
セントラル警備保障	3,800	3,155.00	11,989,000	
丹青社	15,500	835.00	12,942,500	
メイテック	8,900	6,050.00	53,845,000	
応用地質	8,800	1,317.00	11,589,600	
船井総研ホールディングス	14,600	2,027.00	29,594,200	
オオバ	8,700	837.00	7,281,900	
ベネッセホールディングス	26,000	2,478.00	64,428,000	
イオンディライト	8,300	3,335.00	27,680,500	
ダイセキ	11,800	4,190.00	49,442,000	
合 計	74,505,800		187,837,731,440	

(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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	633,599,484	1,942,451,000
金銭信託	100,485,366	302,937,580
コール・ローン	103,015,575	695,167,542
株式	186,251,660,602	283,850,458,884
投資証券	4,618,495,180	6,801,473,940
派生商品評価勘定	27,953,556	59,535,179
未収入金	1,865,057,554	45,617,843

未収配当金	227,793,045	309,276,064
差入委託証拠金	1,118,430,587	1,650,022,983
流動資産合計	194,946,490,949	295,656,941,015
資産合計	194,946,490,949	295,656,941,015
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,203,874	372,922
前受金	17,362,275	59,485,972
未払金	54,739,686	-
未払解約金	1,290,294,992	1,041,495,833
未払利息	297	2,012
その他未払費用	41,742	20,043
流動負債合計	1,371,642,866	1,101,376,782
負債合計	1,371,642,866	1,101,376,782
純資産の部		
元本等		
元本	58,066,751,593	57,943,987,779
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	135,508,096,490	236,611,576,454
元本等合計	193,574,848,083	294,555,564,233
純資産合計	193,574,848,083	294,555,564,233
負債純資産合計	194,946,490,949	295,656,941,015

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,066,751,593口	57,943,987,779口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3337円 (10,000口当たりの純資産額 33,337円)	1口当たり純資産額 5.0835円 (10,000口当たりの純資産額 50,835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 4月28日 至 2021年 4月26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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,140,907,036	-	2,158,269,311	17,362,275
	SPMINI 2006	1,588,735,520	-	1,613,607,260	24,871,740
	DJ EUR 2006	345,470,467	-	338,741,361	△6,729,106
	FTSE 2006	108,338,229	-	107,004,466	△1,333,763
	SPI200 2006	98,362,820	-	98,916,224	553,404
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	122,693,920	-	122,578,600	△115,320
	米ドル	112,008,000	-	111,893,600	△114,400
	スウェーデンク ローナ	213,800	-	214,200	400
	ニュージーランド ドル	2,581,320	-	2,591,600	10,280
	香港ドル	6,672,000	-	6,657,600	△14,400
	イスラエルシケ ル	1,218,800	-	1,221,600	2,800
	売建	1,848,430,927	-	1,846,928,200	1,502,727
	米ドル	1,355,179,520	-	1,353,482,200	1,697,320
	カナダドル	66,299,310	-	66,346,200	△46,890
	ユーロ	180,363,014	-	180,327,000	36,014
	英ポンド	106,303,800	-	106,480,000	△176,200
	スイスフラン	68,546,410	-	68,485,200	61,210
	スウェーデンク ローナ	15,258,873	-	15,315,300	△56,427
	ノルウェークロー ネ	3,947,500	-	3,950,700	△3,200
	デンマーククロー ネ	15,133,300	-	15,132,000	1,300
	オーストラリアド ル	6,848,000	-	6,895,000	△47,000
	香港ドル	20,576,080	-	20,527,600	48,480
	シンガポールドル	9,058,320	-	9,070,800	△12,480
	イスラエルシケ ル	916,800	-	916,200	600
合計		4,112,031,883	-	4,127,776,111	18,749,682

(2021年 4月26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	3,815,195,008	-	3,874,680,980	59,485,972
	SPMINI 2106	2,876,715,575	-	2,925,410,377	48,694,802
	DJ EUR 2106	618,765,224	-	626,649,138	7,883,914
	FTSE 2106	174,694,085	-	175,703,670	1,009,585
	SPI200 2106	145,020,124	-	146,917,795	1,897,671
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	267,446,017	-	267,769,732	△323,715
	米ドル	169,433,700	-	169,385,320	48,380
	カナダドル	15,563,400	-	15,580,614	△17,214
	ユーロ	50,680,070	-	50,915,339	△235,269
	英ポンド	8,965,740	-	8,987,382	△21,642
	スイスフラン	11,771,100	-	11,813,200	△42,100
	スウェーデンク ローナ	2,690,100	-	2,702,700	△12,600
	ノルウェークロー ネ	387,150	-	390,600	△3,450
	デンマーククロー ネ	1,046,580	-	1,053,600	△7,020
	オーストラリアド ル	4,159,600	-	4,184,500	△24,900
	ニュージーランド ドル	772,557	-	776,893	△4,336
	香港ドル	834,420	-	834,000	420
	シンガポールドル	811,440	-	813,690	△2,250
	イスラエルシケ ル	330,160	-	331,894	△1,734
	合計	4,082,641,025	-	4,142,450,712	59,162,257

(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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,156,918,145円
同期中における追加設定元本額	27,917,523,800円
同期中における一部解約元本額	20,007,690,352円
2020年 4月27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	25,451,218,551円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	354,132,894円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,402,748,729円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	898,409,075円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	67,502,372円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	2,062,158円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	8,137,497円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	23,861,394円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	50,148,540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)	42,133,260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)	93,012,458円
外国株式指数ファンド	558,034,519円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,826,411,908円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	243,195,509円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	245,763,764円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	180,873,346円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,810,021円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	63,308,584円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	50,183,200円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	158,005,784円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	76,905,157円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	92,680,407円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,402,638円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	11,277,567円
三井住友DS・年金バランス30 (債券重点型)	218,126円
三井住友DS・年金バランス50 (標準型)	848,695円
三井住友DS・年金バランス70 (株式重点型)	538,088円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,759,348円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	1,296,632,642円
バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	7,995,785円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	71,673,896円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,521,663,602円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,513,925,274円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,117,486,464円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	19,789,865円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,693,203円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	347,233円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,885,446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>	64,157,112円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	177,133,917円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	760,554,540円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	648,495,263円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,550,284,613円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	837,014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)	293,533,256円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	131,650,499円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	17,994,714円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	13,073,387円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,812,692円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	43,227,998円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	112,493,525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>	634,241,041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>	137,128,409円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,665,809,160円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	251,019,233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>	95,964,227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>	6,000,355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>	7,004,719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>	7,446,085円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンドII<適格機関投資家限定>	135,212,835円
合計	58,066,751,593円

(2021年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,066,751,593円
同期中における追加設定元本額	16,895,224,068円
同期中における一部解約元本額	17,017,987,882円
2021年 4月26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	28,763,062,087円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	278,659,320円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,185,860,476円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	826,468,614円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	68,282,666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）	1,307,216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）	6,153,493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）	17,918,101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）	44,256,436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）	43,724,486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）	93,759,250円
外国株式指数ファンド	597,608,127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	9,332,591,971円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	226,710,914円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	247,923,480円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	161,310,710円
イオン・バランス戦略ファンド	53,042,866円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,361,494円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	93,387,800円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	79,384,983円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	253,475,380円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	124,628,072円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	143,424,749円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,364,778円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	185,695,612円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	3,502,496円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	13,766,131円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	11,897,831円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,957,599円
SMBC・DCインデックスファンド（MSCIコクサイ）	36,164,679円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	765,606,897円

バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	5,449,180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＞	42,227,299円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	890,427,813円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,017,321,892円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	4,322,684,584円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	13,987,860円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	76,827,086円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	582,908,081円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	46,776,376円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	123,376,353円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	563,978,699円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	436,244,612円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,003,186,093円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	241,876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）	249,141,886円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	90,384,153円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	11,959,916円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	9,138,921円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	4,880,615円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	27,135,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	73,803,151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＞	168,068,608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＞	80,082,212円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	2,365,412,561円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	154,088,266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＞	1,460,825,276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＞	12,940,494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＞	34,488,574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＞	28,712,764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＞	341,028,483円
合計	57,943,987,779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	31,974	20.01	639,799.74	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	16.12	316,467.84	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	74.19	871,509.93	

CHEVRON CORPORATION	98,304	101.55	9,982,771.20
CONOCOPHILLIPS	70,648	49.72	3,512,618.56
DEVON ENERGY CORPORATION	31,182	21.44	668,542.08
EOG RESOURCES INC	30,830	69.06	2,129,119.80
EXXON MOBIL CORPORATION	216,177	55.57	12,012,955.89
HALLIBURTON CO	44,317	19.06	844,682.02
HESS CORPORATION	14,344	67.29	965,207.76
KINDER MORGAN INC	105,940	16.78	1,777,673.20
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,933	53.00	1,798,449.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	24.65	1,197,497.00
ONEOK INC	21,278	50.60	1,076,666.80
PHILLIPS 66	22,492	76.49	1,720,413.08
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,578	146.45	1,549,148.10
SCHLUMBERGER LTD	73,444	25.71	1,888,245.24
VALERO ENERGY CORP	22,007	70.18	1,544,451.26
WILLIAMS COS INC	64,802	23.61	1,529,975.22
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,102	290.30	3,222,910.60
ALBEMARLE CORPORATION	5,548	161.23	894,504.04
AMCOR PLC	82,302	11.73	965,402.46
AVERY DENNISON CORP	4,232	202.16	855,541.12
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	32.51	409,300.90
BALL CORPORATION	17,166	93.98	1,613,260.68
CELANESE CORPORATION	6,420	157.30	1,009,866.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	47.32	567,934.64
CORTEVA INC	39,348	48.63	1,913,493.24
CROWN HOLDINGS INC	6,863	109.61	752,253.43
DOW INC	38,654	62.11	2,400,799.94
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	76.81	2,146,378.64
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	113.60	798,267.20
ECOLAB INC	13,341	226.78	3,025,471.98
FMC CORPORATION	6,676	115.90	773,748.40
FREEPORT-MCMORAN INC	75,431	36.54	2,756,248.74
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	56.78	1,086,769.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,734	144.54	1,696,032.36
LINDE PLC	26,732	291.60	7,795,051.20

LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	104.41	1,454,535.71
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	350.82	1,084,735.44
MOSAIC CO/THE	18,584	33.95	630,926.80
NEWMONT CORPORATION	41,882	65.72	2,752,485.04
NUCOR CORP	15,455	77.83	1,202,862.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	142.33	666,389.06
PPG INDUSTRIES INC	12,256	174.65	2,140,510.40
RPM INTERNATIONAL INC	5,917	94.77	560,754.09
SEALED AIR CORP	7,895	48.39	382,039.05
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,573	273.92	3,443,996.16
STEEL DYNAMICS,INC.	10,191	51.89	528,810.99
VULCAN MATERIALS CO	6,698	176.57	1,182,665.86
WESTROCK CO	13,034	53.30	694,712.20
3M COMPANY	29,504	202.20	5,965,708.80
ALLEGION PLC	4,764	138.35	659,099.40
AMETEK INC	11,312	135.01	1,527,233.12
BOEING CO	27,549	238.38	6,567,130.62
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	44.47	1,923,460.91
CATERPILLAR INC	27,618	230.11	6,355,177.98
CUMMINS INC	7,315	262.47	1,919,968.05
DEERE & CO	15,109	376.27	5,685,063.43
DOVER CORP	6,972	148.14	1,032,832.08
EATON CORP PLC	19,959	142.97	2,853,538.23
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	92.46	2,882,717.88
FASTENAL COMPANY	29,892	52.18	1,559,764.56
FORTIVE CORP	15,750	73.96	1,164,870.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,166	104.90	751,713.40
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	330.58	1,090,914.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	186.48	2,357,480.16
GENERAL ELECTRIC CO	454,142	13.55	6,153,624.10
HEICO CORP	1,888	139.20	262,809.60
HEICO CORP-CLASS A	3,183	126.98	404,177.34
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,419	224.50	8,176,065.50
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	31.96	608,007.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	206.13	434,315.91

IDEX CORP	3,839	225.19	864,504.41
ILLINOIS TOOL WORKS	15,933	228.52	3,641,009.16
INGERSOLL-RAND INC	16,781	51.62	866,235.22
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	65.48	753,020.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,644	62.90	2,430,707.60
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,215	211.02	2,366,589.30
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,527	334.46	510,720.42
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	12,847	377.29	4,847,044.63
MASCO CORP	14,885	64.75	963,803.75
NORDSON CORP	3,207	213.93	686,073.51
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	342.04	2,837,221.80
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	71.28	1,504,792.08
OWENS CORNING	5,205	95.85	498,899.25
PACCAR INC	18,041	93.35	1,684,127.35
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,691	318.12	2,128,540.92
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	64.31	528,628.20
PLUG POWER INC	22,755	27.98	636,684.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,825	80.54	6,348,565.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	269.06	1,673,284.14
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,207	434.22	2,260,983.54
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	59.97	455,772.00
SMITH(A.O.) CORP	7,157	68.36	489,252.52
SNAP-ON INC	2,285	238.69	545,406.65
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,007	209.09	1,674,183.63
SUNRUN INC	6,112	55.69	340,377.28
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	443.46	913,527.60
TEXTRON INC	11,803	60.43	713,255.29
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	175.33	2,237,035.47
TRANSDIGM GROUP INC	2,681	595.33	1,596,079.73
UNITED RENTALS INC	3,596	318.94	1,146,908.24
WABTEC CORP	9,231	85.41	788,419.71
WW GRAINGER INC	2,390	423.56	1,012,308.40
XYLEM INC	9,124	110.48	1,008,019.52
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	83.36	669,297.44
CINTAS CORP	4,615	353.72	1,632,417.80

COPART INC	10,977	124.68	1,368,612.36
COSTAR GROUP INC	2,054	933.73	1,917,881.42
EQUIFAX INC	6,127	229.72	1,407,494.44
IHS MARKIT LTD	19,584	106.81	2,091,767.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	137.14	949,968.78
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	100.66	699,285.02
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	106.39	1,214,441.85
ROBERT HALF INTL INC	5,555	87.00	483,285.00
ROLLINS INC	11,493	35.80	411,449.40
TRANSUNION	9,497	103.27	980,755.19
VERISK ANALYTICS INC	7,929	188.88	1,497,629.52
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	117.96	1,599,065.76
WASTE MANAGEMENT INC	22,023	135.50	2,984,116.50
AMERCO	390	595.67	232,311.30
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	6,925	99.78	690,976.50
CSX CORPORATION	40,214	103.11	4,146,465.54
DELTA AIR LINES INC	8,299	45.80	380,094.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	110.84	963,088.76
FEDEX CORP	13,083	277.74	3,633,672.42
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	169.20	746,341.20
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	301.62	1,538,262.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	46.74	371,115.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,783	282.00	3,604,806.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	257.76	1,269,725.76
SOUTHWEST AIRLINES	7,076	61.53	435,386.28
UBER TECHNOLOGIES INC	49,619	57.93	2,874,428.67
UNION PACIFIC CORP	34,975	223.54	7,818,311.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,671	178.96	6,562,642.16
XPO LOGISTICS INC	4,716	136.87	645,478.92
APTIV PLC	14,147	144.89	2,049,758.83
AUTOLIV INC	4,001	105.85	423,505.85
BORGWARNER INC	12,075	50.97	615,462.75
FORD MOTOR COMPANY	194,883	12.22	2,381,470.26
GENERAL MOTORS CO	65,911	57.53	3,791,859.83
LEAR CORP	2,749	187.56	515,602.44

TESLA INC	38,906	729.40	28,378,036.40
D.R.HORTON INC	18,162	98.21	1,783,690.02
GARMIN LTD	6,854	141.35	968,847.17
HASBRO INC	7,491	97.15	727,750.65
LENNAR CORP-CL A	14,494	101.86	1,476,358.84
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	340.98	2,209,891.38
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	203.34	582,162.42
NEWELL BRANDS INC	17,587	26.54	466,758.98
NIKE INC -CL B	63,986	130.19	8,330,337.34
NVR INC	173	4,862.59	841,228.07
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,599	101.07	1,273,380.93
PULTE GROUP INC	13,075	53.91	704,873.25
VF CORP	17,117	88.38	1,512,800.46
WHIRLPOOL CORP	3,212	238.94	767,475.28
AIRBNB INC-CLASS A	2,549	174.25	444,163.25
ARAMARK	13,242	39.51	523,191.42
CARNIVAL CORP	40,398	27.27	1,101,653.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,381	1,468.53	2,028,039.93
DARDEN RESTAURANTS INC	6,111	143.97	879,800.67
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	397.71	843,542.91
DRAFTKINGS INC - CL A	8,947	58.12	519,999.64
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	127.40	1,862,205.80
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	59.76	1,053,807.84
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	148.36	2,183,117.40
MCDONALD'S CORPORATION	38,673	234.58	9,071,912.34
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	11,044	18.77	207,295.88
MGM MIRAGE	25,878	41.51	1,074,195.78
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	85.81	1,020,280.90
STARBUCKS CORP	61,056	117.56	7,177,743.36
VAIL RESORTS INC	2,038	333.41	679,489.58
WYNN RESORTS LTD	4,913	124.15	609,948.95
YUM! BRANDS INC	15,549	117.72	1,830,428.28
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	93.02	3,729,357.84
ALPHABET INC-CL A	15,456	2,299.93	35,547,718.08
ALPHABET INC-CL C	15,276	2,315.30	35,368,522.80

ALTICE USA INC-A	14,243	35.14	500,499.02	
CABLE ONE INC	246	1,846.14	454,150.44	
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,262	657.54	4,775,055.48	
COMCAST CORP-CLASS A	236,457	54.39	12,860,896.23	
DISCOVERY INC-A	7,075	38.40	271,680.00	
DISCOVERY INC-C	17,417	32.45	565,181.65	
DISH NETWORK CORP.	12,937	42.48	549,563.76	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	143.14	2,197,485.28	
FACEBOOK INC-A	123,699	301.13	37,249,479.87	
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	38.41	651,510.42	
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	37.34	327,583.82	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	250.32	994,771.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	29.72	583,284.72	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	154.86	203,176.32	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	159.63	1,308,327.48	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	47.24	486,005.12	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	46.61	356,473.28	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	46.48	192,473.68	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	81.78	614,331.36	
MATCH GROUP INC	12,773	149.01	1,903,304.73	
NETFLIX INC	22,733	505.55	11,492,668.15	
NEWS CORP-CLASS A	16,662	26.73	445,375.26	
OMNICOM GROUP	10,417	81.23	846,172.91	
PINTEREST INC- CLASS A	26,515	74.99	1,988,359.85	
ROKU INC	5,620	356.87	2,005,609.40	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.38	431,645.28	
SNAP INC-A	47,744	61.30	2,926,707.20	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	176.19	1,005,516.33	
THE WALT DISNEY CO.	93,161	183.02	17,050,326.22	
TWITTER INC	40,795	67.02	2,734,080.90	
VIACOMCBS INC	29,772	41.71	1,241,790.12	
ZILLOW GROUP INC-A	3,154	138.94	438,216.76	
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	137.00	1,083,122.00	
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	199.75	684,343.50	
AMAZON.COM INC	21,921	3,340.88	73,235,430.48	

AUTOZONE INC	1,137	1,471.35	1,672,924.95	
BEST BUY COMPANY INC	12,132	117.74	1,428,421.68	
BOOKING HOLDINGS INC	2,139	2,395.43	5,123,824.77	
BURLINGTON STORES INC	3,391	328.04	1,112,383.64	
CARMAX INC	8,427	131.08	1,104,611.16	
CARVANA CO	3,285	278.01	913,262.85	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	80.59	319,861.71	
DOLLAR GENERAL CORP	13,090	213.31	2,792,227.90	
DOLLAR TREE INC	12,047	115.56	1,392,151.32	
EBAY INC	36,668	60.91	2,233,447.88	
ETSY INC	6,272	214.59	1,345,908.48	
EXPEDIA GROUP INC	6,894	177.56	1,224,098.64	
GENUINE PARTS CO	7,406	122.33	905,975.98	
HOME DEPOT INC	55,148	323.89	17,861,885.72	
LKQ CORPORATION	15,922	44.99	716,330.78	
LOWE'S COMPANIES INC	38,030	200.93	7,641,367.90	
MERCADOLIBRE INC	2,337	1,600.91	3,741,326.67	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,833	532.61	2,041,494.13	
POOL CORP	2,107	419.53	883,949.71	
ROSS STORES INC	18,792	128.82	2,420,785.44	
TARGET CORP	26,147	206.01	5,386,543.47	
TJX COMPANIES INC	60,539	70.39	4,261,340.21	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	189.38	1,158,437.46	
ULTA BEAUTY INC	2,765	328.44	908,136.60	
WAYFAIR INC-CLASS A	3,266	308.18	1,006,515.88	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,674	373.28	8,463,750.72	
KROGER CO	40,843	37.35	1,525,486.05	
SYSCO CORP	25,165	82.64	2,079,635.60	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,873	53.02	2,008,026.46	
WALMART INC	72,907	139.90	10,199,689.30	
ALTRIA GROUP INC	94,742	47.39	4,489,823.38	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,559	59.41	1,637,280.19	
BROWN-FORMAN CORPORATION	16,130	77.10	1,243,623.00	
BUNGE LIMITED	7,174	85.10	610,507.40	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	48.77	518,815.26	

COCA-COLA CO/THE	208,965	54.47	11,382,323.55	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,193	56.57	520,048.01	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	37.61	926,672.79	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	240.58	2,136,590.98	
GENERAL MILLS INC	31,489	61.26	1,929,016.14	
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	46.39	693,020.21	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	129.77	748,513.36	
KELLOGG CO	12,949	63.28	819,412.72	
KEURIG DR PEPPER INC	29,587	36.18	1,070,457.66	
KRAFT HEINZ COMPANY	32,774	40.41	1,324,397.34	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	81.34	603,298.78	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	91.47	1,196,793.48	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	52.27	503,307.83	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,601	59.51	4,439,505.51	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	21,116	98.68	2,083,726.88	
PEPSICO INC	71,110	145.83	10,369,971.30	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	79,247	94.61	7,497,558.67	
THE HERSHEY COMPANY	7,514	161.43	1,212,985.02	
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	78.70	1,176,486.30	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	87.56	1,093,186.60	
CLOROX COMPANY	6,542	188.54	1,233,428.68	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	42,815	79.79	3,416,208.85	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,508	313.79	3,611,095.32	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	132.11	2,351,558.00	
PROCTER & GAMBLE CO	127,591	133.94	17,089,538.54	
ABBOTT LABORATORIES	90,543	123.31	11,164,857.33	
ABIOMED INC	2,288	351.03	803,156.64	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	620.12	2,389,942.48	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	121.65	972,348.45	
ANTHEM INC	12,576	381.95	4,803,403.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	87.87	2,322,755.58	
BECTON DICKINSON & CO	15,140	255.85	3,873,569.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	42.73	3,185,777.88	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	61.41	928,150.74	
CENTENE CORP	30,528	65.37	1,995,615.36	

CERNER CORP	15,537	75.56	1,173,975.72	
CIGNA CORPORATION	18,589	251.80	4,680,710.20	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,771	411.31	1,139,740.01	
CVS HEALTH CORPORATION	66,840	76.05	5,083,182.00	
DANAHER CORP	32,969	259.78	8,564,686.82	
DAVITA INC	4,138	113.60	470,076.80	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	66.20	785,396.80	
DEXCOM INC	4,765	415.00	1,977,475.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,336	97.45	3,151,143.20	
HCA HEALTHCARE INC	14,352	202.50	2,906,280.00	
HENRY SCHEIN INC	7,559	74.22	561,028.98	
HOLOGIC INC	13,592	73.36	997,109.12	
HUMANA INC.	6,899	448.64	3,095,167.36	
IDEXX LABORATORIES INC	4,260	559.10	2,381,766.00	
INSULET CORP	3,400	295.50	1,004,700.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,946	875.53	5,205,901.38	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	263.95	1,318,430.25	
MASIMO CORPORATION	2,941	246.28	724,309.48	
MCKESSON CORP	8,411	196.10	1,649,397.10	
MEDTRONIC PLC	69,837	131.20	9,162,614.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,698	255.44	689,177.12	
NOVOCURE LTD	4,517	207.63	937,864.71	
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	131.21	894,064.94	
RESMED INC	7,181	209.30	1,502,983.30	
STERIS PLC	4,287	214.82	920,933.34	
STRYKER CORP	17,769	267.00	4,744,323.00	
TELADOC HEALTH INC	6,122	182.45	1,116,958.90	
TELEFLEX INC	2,340	443.71	1,038,281.40	
UNITEDHEALTH GROUP INC	48,823	400.31	19,544,335.13	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	145.51	611,578.53	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,005	280.63	1,965,813.15	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	323.68	1,223,186.72	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	177.62	1,928,242.72	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,227	193.95	625,876.65	
ABBVIE INC	90,104	111.38	10,035,783.52	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,406	136.68	2,105,692.08	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,519	166.92	1,922,751.48	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	136.72	767,409.36	
AMGEN INC	30,216	257.03	7,766,418.48	
AVANTOR INC	25,606	33.18	849,607.08	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	640.42	781,312.40	
BIOGEN INC	7,987	262.63	2,097,625.81	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	78.73	714,868.40	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,054	66.01	7,660,724.54	
CATALENT INC	8,935	114.89	1,026,542.15	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	30.88	642,643.68	
ELI LILLY & CO	44,684	188.72	8,432,764.48	
EXACT SCIENCES CORP	8,428	133.96	1,129,014.88	
GILEAD SCIENCES INC	65,673	65.48	4,300,268.04	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	94.63	1,096,004.66	
ILLUMINA INC	7,655	414.97	3,176,595.35	
INCYTE CORP	9,243	85.58	791,015.94	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	42.69	288,584.40	
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	232.30	2,304,648.30	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	166.73	434,164.92	
JOHNSON & JOHNSON	134,979	165.52	22,341,724.08	
MERCK & CO. INC.	129,538	77.88	10,088,419.44	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	1,335.15	1,679,618.70	
MODERNA INC	14,409	173.63	2,501,834.67	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	96.73	404,911.78	
PERKINELMER INC	5,624	134.97	759,071.28	
PFIZER INC	283,848	38.66	10,973,563.68	
PPD INC	6,413	46.19	296,216.47	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	488.64	2,685,076.80	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,431	43.61	324,065.91	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	70.94	271,558.32	
SEAGEN INC	6,654	147.23	979,668.42	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	58,227	10.24	596,244.48	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,225	488.09	9,871,620.25	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	217.90	2,948,187.00	

VIATRIS INC	63,072	13.36	842,641.92	
WATERS CORP	2,901	306.50	889,156.50	
ZOETIS INC	24,975	170.54	4,259,236.50	
BANK OF AMERICA CORP	398,648	39.18	15,619,028.64	
CITIGROUP INC	108,059	71.38	7,713,251.42	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	44.93	934,499.07	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	38.34	1,424,331.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	179.12	1,593,630.64	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	14.90	790,623.80	
JPMORGAN CHASE & CO	156,788	150.19	23,547,989.72	
KEYCORP	51,128	20.77	1,061,928.56	
M & T BANK CORP	6,094	153.12	933,113.28	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,991	178.04	3,915,277.64	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,041	20.63	970,455.83	
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	564.22	1,489,540.80	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	70,316	57.62	4,051,607.92	
US BANCORP	70,743	57.23	4,048,621.89	
WELLS FARGO & COMPANY	200,117	43.86	8,777,131.62	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	48.90	984,797.10	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,523	144.33	5,127,034.59	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,412	249.14	1,597,485.68	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	53.19	411,956.55	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	47.60	2,009,053.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,244	271.98	19,104,963.12	
BLACKROCK INC	7,916	813.17	6,437,053.72	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	135.68	3,209,374.72	
CARLYLE GROUP INC/THE	9,341	41.53	387,931.73	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	104.37	590,838.57	
CME GROUP INC.	18,712	207.31	3,879,184.72	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	102.84	1,689,147.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	33.92	774,054.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	347.10	673,026.90	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	29.42	420,647.16	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,965	339.35	5,757,072.75	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,608	121.27	3,469,292.16	

INVESCO LIMITED	18,328	26.51	485,875.28
KKR & CO INC	25,154	55.10	1,385,985.40
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	507.46	970,263.52
MOODY'S CORP	8,519	327.73	2,791,931.87
MORGAN STANLEY	71,864	80.95	5,817,390.80
MSCI INC-A	4,383	486.50	2,132,329.50
NASDAQ INC	5,392	162.47	876,038.24
NORTHERN TRUST CORP	9,502	109.53	1,040,754.06
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	129.55	832,488.30
S&P GLOBAL INC	12,166	388.14	4,722,111.24
SCHWAB (CHARLES) CORP	77,565	67.14	5,207,714.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	57.85	317,075.85
STATE STREET CORP	18,694	81.11	1,516,270.34
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	40.68	1,131,921.00
T ROWE PRICE GROUP INC	11,312	178.56	2,019,870.72
THE BLACKSTONE GROUP INC	34,684	87.22	3,025,138.48
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	80.23	418,800.60
VOYA FINANCIAL INC	7,308	67.30	491,828.40
AFLAC INC	35,411	53.37	1,889,885.07
ALLEGHANY CORPORATION	689	679.85	468,416.65
ALLSTATE CORP	14,978	125.05	1,872,998.90
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	123.78	438,057.42
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	47.34	2,118,228.30
AON PLC	12,005	230.89	2,771,834.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	39.99	818,835.24
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,895	137.94	1,364,916.30
ASSURANT INC	3,114	155.79	485,130.06
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,865	57.79	281,148.35
BROWN & BROWN INC	14,036	50.48	708,537.28
CHUBB LTD	23,255	169.26	3,936,141.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	109.36	859,350.88
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	229.03	294,990.64
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	266.82	550,983.30
FNF GROUP	13,937	45.10	628,558.70
GLOBE LIFE INC	6,040	103.08	622,603.20

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	68.33	1,252,557.23
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	63.62	552,030.74
LOEWS CORPORATION	13,914	55.21	768,191.94
MARKEL CORP	702	1,188.84	834,565.68
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	127.67	3,399,213.75
METLIFE INC	39,703	62.79	2,492,951.37
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	62.71	885,716.04
PROGRESSIVE CORP	30,543	100.76	3,077,512.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	98.50	2,041,708.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	129.60	391,651.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	172.17	525,462.84
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	157.84	2,071,807.84
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	81.36	604,342.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	232.89	1,589,008.47
CBRE GROUP INC-A	18,244	82.90	1,512,427.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.99	260,977.00
ACCENTURE PLC-CL A	32,321	291.74	9,429,328.54
ADOBE INC	24,573	515.84	12,675,736.32
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	107.01	890,430.21
ANSYS INC	4,470	371.73	1,661,633.10
AUTODESK INC	11,506	295.27	3,397,376.62
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,463	195.86	4,399,603.18
AVALARA INC	4,319	146.70	633,597.30
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	73.79	562,501.17
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	162.63	957,728.07
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	142.08	2,024,640.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	94.22	657,561.38
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,376	119.80	644,044.80
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	140.48	911,715.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,320	82.72	853,670.40
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	26,533	78.69	2,087,881.77
COUPA SOFTWARE INC	3,490	268.13	935,773.70
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,093	219.30	1,994,094.90
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	143.24	294,358.20
DATADOG INC - CLASS A	8,402	89.57	752,567.14

DOCUSIGN INC	9,078	224.84	2,041,097.52
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	26.25	435,412.92
DYNATRACE INC	11,194	52.85	591,602.90
EPAM SYSTEMS INC	2,689	458.15	1,231,965.35
FAIR ISAAC CORP	1,494	542.49	810,480.06
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,016	153.01	4,898,768.16
FISERV INC	29,729	126.02	3,746,448.58
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	291.37	1,273,578.27
FORTINET INC	7,360	201.76	1,484,953.60
GARTNER INC	4,568	199.42	910,950.56
GLOBAL PAYMENTS INC	15,685	216.92	3,402,390.20
GODADDY INC - CLASS A	8,905	84.89	755,945.45
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	104.94	496,471.14
HUBSPOT INC	2,275	564.63	1,284,533.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,622	142.43	6,497,941.46
INTUIT INC	13,620	414.92	5,651,210.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	169.59	663,944.85
MASTERCARD INC-CL A	45,776	387.06	17,718,058.56
MICROSOFT CORP	369,581	261.15	96,516,078.15
MONGODB INC	2,659	306.18	814,132.62
NORTONLIFELOCK INC	31,347	22.25	697,470.75
OKTA INC	6,306	279.30	1,761,265.80
ORACLE CORPORATION	101,577	74.97	7,615,227.69
PALO ALTO NETWORKS INC	4,942	358.42	1,771,311.64
PAYCHEX INC	15,878	99.23	1,575,573.94
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	399.59	1,007,765.98
PAYPAL HOLDINGS INC	56,963	266.03	15,153,866.89
PTC INC	5,462	147.34	804,771.08
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	322.53	1,287,539.76
SALESFORCE.COM, INC.	47,267	233.51	11,037,317.17
SERVICENOW INC	10,018	552.70	5,536,948.60
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	23,822	42.56	1,013,864.32
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,505	235.64	354,638.20
SPLUNK INC	8,252	133.20	1,099,166.40
SQUARE INC-A	19,920	246.43	4,908,885.60

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	72.48	836,854.08
SYNOPSYS INC	7,869	251.45	1,978,660.05
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	2,140	726.49	1,554,688.60
TWILIO INC-A	7,283	384.64	2,801,333.12
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	451.50	910,224.00
VERISIGN INC	5,227	211.47	1,105,353.69
VISA INC	86,724	230.00	19,946,520.00
VMWARE INC	4,194	165.74	695,113.56
WESTERN UNION COMPANY	21,840	26.33	575,047.20
WIX.COM LTD	2,840	296.10	840,924.00
WORKDAY INC-CLASS A	9,080	254.80	2,313,584.00
ZENDESK INC	6,067	147.52	895,003.84
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,108	336.88	3,405,183.04
ZSCALER INC	3,503	190.26	666,480.78
AMPHENOL CORPORATION -CL A	31,396	68.80	2,160,044.80
APPLE INC	874,220	134.32	117,425,230.40
ARISTA NETWORKS INC	2,699	318.64	860,009.36
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	118.51	489,446.30
CDW CORP/DE	7,404	182.61	1,352,044.44
CISCO SYSTEMS INC	215,929	51.91	11,208,874.39
COGNEX CORP	8,698	85.67	745,157.66
CORNING INC	39,709	46.25	1,836,541.25
DELL TECHNOLOGIES INC-C	12,602	101.41	1,277,968.82
F5 NETWORKS INC	2,909	209.64	609,842.76
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	16.42	1,048,926.02
HP INC	73,161	34.42	2,518,201.62
IPG PHOTONICS CORP	1,776	227.99	404,910.24
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	25.30	441,738.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	147.86	1,410,880.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,312	189.98	1,579,113.76
NETAPP INC	10,919	76.94	840,107.86
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	89.15	1,126,321.10
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	134.72	2,347,496.00
TRIMBLE INC	12,759	82.54	1,053,127.86
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	68.07	1,011,315.99

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	497.41	1,361,411.17
AT&T INC	364,117	31.40	11,433,273.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	25.08	211,474.56
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	25.07	528,450.53
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	13.04	648,844.32
T-MOBILE US INC	29,019	133.32	3,868,813.08
VERIZON COMMUNICATIONS INC	211,595	57.30	12,124,393.50
AES CORPORATION	33,656	28.30	952,464.80
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	56.44	682,980.44
AMEREN CORPORATION	12,454	84.78	1,055,850.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	87.70	2,256,257.90
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	159.36	1,458,781.44
ATMOS ENERGY CORP	6,965	103.35	719,832.75
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	24.13	614,446.32
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	64.13	900,385.20
CONSOLIDATED EDISON INC	16,187	77.45	1,253,683.15
DOMINION ENERGY INC	41,951	79.38	3,330,070.38
DTE ENERGY COMPANY	10,496	137.83	1,446,663.68
DUKE ENERGY CORP	37,896	99.85	3,783,915.60
EDISON INTERNATIONAL	18,856	59.19	1,116,086.64
ENTERGY CORP	10,866	106.71	1,159,510.86
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,567	47.97	506,898.99
EVERGY INC	11,273	63.48	715,610.04
EVERSOURCE ENERGY	17,557	88.17	1,548,000.69
EXELON CORP	50,837	44.91	2,283,089.67
FIRSTENERGY CORP	26,948	36.70	988,991.60
NEXTERA ENERGY INC	100,635	78.24	7,873,682.40
NISOURCE INC	18,919	25.72	486,596.68
NRG ENERGY INC	13,547	37.12	502,864.64
OGE ENERGY CORP	11,870	32.95	391,116.50
P G & E CORPORATION	76,538	10.97	839,621.86
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	83.81	502,524.76
PPL CORPORATION	39,561	29.16	1,153,598.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,969	62.94	1,571,548.86
SEMPRA ENERGY	15,304	137.07	2,097,719.28

	SOUTHERN CO	55,514	65.33	3,626,729.62	
	UGI CORPORATION	10,588	44.19	467,883.72	
	VISTRA CORP	25,777	17.49	450,839.73	
	WEC ENERGY GROUP INC	16,438	96.79	1,591,034.02	
	XCEL ENERGY INC	26,959	71.08	1,916,245.72	
	ADVANCED MICRO DEVICES	62,122	82.76	5,141,216.72	
	ANALOG DEVICES INC	19,298	159.02	3,068,767.96	
	APPLIED MATERIALS INC	47,402	134.86	6,392,633.72	
	BROADCOM INC	21,006	466.13	9,791,526.78	
	ENPHASE ENERGY INC	6,292	166.97	1,050,575.24	
	INTEL CORP	209,686	59.24	12,421,798.64	
	KLA CORPORATION	8,157	332.07	2,708,694.99	
	LAM RESEARCH CORP	7,291	627.49	4,575,029.59	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	41,180	46.10	1,898,398.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	96.19	1,328,768.66	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,024	156.38	2,036,693.12	
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,027	86.03	4,992,062.81	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	380.79	854,111.97	
	NVIDIA CORP	31,711	610.61	19,363,053.71	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	201.56	2,913,952.92	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	42.55	889,805.60	
	QORVO INC	6,042	193.92	1,171,664.64	
	QUALCOMM INC	57,637	135.43	7,805,778.91	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	190.92	1,671,886.44	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,634	279.43	736,018.62	
	TERADYNE INC	8,542	131.53	1,123,529.26	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	46,835	188.82	8,843,384.70	
	XILINX INC	12,876	129.66	1,669,502.16	
	米ドル 小計	16,121,525		1,892,519,449.48	(204,183,923,404)
カナダドル	CAMECO CORP	18,890	20.41	385,544.90	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,883	36.89	2,209,083.87	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	9.35	701,811.00	
	ENBRIDGE INC	106,452	46.26	4,924,469.52	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	31.71	412,198.29	

INTER PIPELINE LTD	19,394	18.05	350,061.70
KEYERA CORP	11,374	25.79	293,335.46
PARKLAND CORP	7,666	38.49	295,064.34
PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	36.91	1,011,740.01
SUNCOR ENERGY INC	78,642	25.37	1,995,147.54
TC ENERGY CORP	47,323	59.21	2,801,994.83
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	13,447	82.47	1,108,974.09
B2GOLD CORP	42,963	6.33	271,955.79
BARRICK GOLD CORP	93,098	27.71	2,579,745.58
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	71.74	470,829.62
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	27.57	873,197.04
FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	178.04	1,809,776.60
KINROSS GOLD CORP	63,501	9.16	581,669.16
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	13,385	48.04	643,015.40
LUNDIN MINING CORP	28,209	14.85	418,903.65
NUTRIEN LTD	29,898	67.13	2,007,052.74
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	42.15	495,810.45
SSR MINING INC	11,552	20.45	236,238.40
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	27.36	678,911.04
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	96.87	429,909.06
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,382	53.34	1,140,515.88
YAMANA GOLD INC	53,588	5.94	318,312.72
BALLARD POWER SYSTEMS INC	9,158	27.33	250,288.14
CAE INC	12,891	38.02	490,115.82
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	99.15	381,033.45
WSP GLOBAL INC	6,141	128.02	786,170.82
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	41.04	406,829.52
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	78.83	446,729.61
THOMSON REUTERS CORP	10,122	114.69	1,160,892.18
AIR CANADA	5,737	25.07	143,826.59
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,544	135.85	4,964,502.40
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	461.94	3,286,703.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	121.64	1,747,236.96
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	42.62	386,392.92
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	82.63	1,198,961.30

QUEBECOR INC -CL B	9,953	35.60	354,326.80	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	34.64	943,316.48	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,001	201.21	603,831.21	
DOLLARAMA INC	17,025	57.75	983,193.75	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	44,270	41.64	1,843,402.80	
EMPIRE CO LTD A	9,148	39.41	360,522.68	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	69.30	601,731.90	
METRO INC	13,109	57.25	750,490.25	
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	111.90	479,043.90	
SAPUTO INC	13,425	39.85	534,986.25	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	37.00	608,539.00	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	34.20	384,784.20	
BANK OF MONTREAL	33,057	116.01	3,834,942.57	
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	78.00	4,937,946.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	126.52	2,974,864.76	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	88.04	1,496,063.72	
ROYAL BANK OF CANADA	73,234	116.56	8,536,155.04	
TORONTO-DOMINION BANK	92,906	84.21	7,823,614.26	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,755	56.58	3,720,417.90	
IGM FINANCIAL INC	6,433	41.55	267,291.15	
ONEX CORPORATION	4,217	81.01	341,619.17	
TMX GROUP LTD	3,142	137.31	431,428.02	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	572.39	797,339.27	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	35.24	500,408.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	68.87	334,088.37	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	163.51	1,154,053.58	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	26.60	2,654,946.00	
POWER CORP OF CANADA	25,796	34.86	899,248.56	
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,819	66.27	1,909,835.13	
FIRSTSERVICE CORP	1,820	209.68	381,617.60	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	11.05	287,222.65	
CGI INC-CL A	12,634	106.39	1,344,131.26	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,838.52	1,886,321.52	
OPEN TEXT CORPORATION	13,665	59.50	813,067.50	
SHOPIFY INC-CLASS A	5,661	1,373.73	7,776,685.53	

	BCE INC	8,379	58.13	487,071.27	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,236	61.07	1,113,672.52	
	TELUS CORPORATION	15,222	25.79	392,575.38	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	20.18	632,824.62	
	ALTAGAS LTD	17,347	21.57	374,174.79	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	42.45	128,623.50	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	54.85	347,529.60	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	34.53	253,588.32	
	EMERA INC	14,279	57.35	818,900.65	
	FORTIS INC	24,171	55.37	1,338,348.27	
	HYDRO ONE LTD	15,052	30.23	455,021.96	
	NORTHLAND POWER INC	8,016	44.12	353,665.92	
	カナダドル 小計	2,042,482		115,342,425.07 (9,984,040,314)	
ユーロ	ENI SPA	123,580	10.10	1,248,405.16	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	22,025	9.34	205,845.65	
	NESTE OYJ	22,153	50.74	1,124,043.22	
	OMV AG	7,130	42.51	303,096.30	
	REPSOL SA	81,853	10.01	819,348.53	
	TENARIS S.A.	25,963	8.88	230,551.44	
	TOTAL SE	130,580	36.77	4,802,079.50	
	VOPAK	3,130	37.85	118,470.50	
	AIR LIQUIDE SA	24,154	141.34	3,413,926.36	
	AKZO NOBEL	10,399	102.20	1,062,777.80	
	ARCELORMITTAL	36,689	25.10	920,893.90	
	ARKEMA	3,250	105.45	342,712.50	
	BASF SE	47,459	70.42	3,342,062.78	
	COVESTRO AG	9,346	55.14	515,338.44	
	CRH PLC	40,255	39.45	1,588,059.75	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	30.39	332,831.28	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.76	147,471.20	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,170	77.76	557,539.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,994	151.70	1,364,389.80	
	LANXESS	4,409	62.18	274,151.62	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	40.90	528,468.90	

SOLVAY SA	3,758	104.50	392,711.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	16.67	504,151.95
SYMRISE AG	6,524	111.05	724,490.20
UMICORE	9,351	49.81	465,773.31
UPM-KYMMENE OYJ	28,055	32.94	924,131.70
VOESTALPINE AG	6,056	36.74	222,497.44
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,285	27.04	332,186.40
AIRBUS SE	30,165	98.46	2,970,045.90
ALSTOM RGPT	11,800	47.30	558,140.00
BOUYGUES SA	11,049	34.57	381,963.93
BRENTAG SE	7,392	75.76	560,017.92
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	12.66	693,725.37
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	26,413	52.97	1,399,096.61
DASSAULT AVIATION SA	172	910.00	156,520.00
EIFFAGE SA	4,989	87.62	437,136.18
FERROVIAL SA	24,212	22.24	538,474.88
GEA GROUP AG	8,178	36.06	294,898.68
HOCHTIEF AG	1,931	75.66	146,099.46
KINGSPAN GROUP PLC	7,215	76.62	552,813.30
KION GROUP AG	3,179	86.32	274,411.28
KNORR-BREMSE AG	3,881	104.40	405,176.40
KONE OYJ-B	17,618	72.68	1,280,476.24
LEGRAND SA	13,323	82.92	1,104,743.16
MTU AERO ENGINES AG	2,957	196.50	581,050.50
PRYSMIAN SPA	12,526	27.13	339,830.38
RATIONAL AG	190	713.00	135,470.00
SAFRAN SA	15,933	121.24	1,931,716.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,924	137.24	3,832,289.76
SIEMENS AG-REG	39,550	142.94	5,653,277.00
SIEMENS ENERGY AG	19,855	29.15	578,773.25
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	31.92	366,505.44
THALES SA	5,403	86.14	465,414.42
VINCI S.A.	27,668	87.47	2,420,119.96
WARTSILA OYJ-B SHARES	26,753	11.03	295,219.35
BUREAU VERITAS SA	17,817	25.37	452,017.29

RANDSTAD NV	5,367	61.36	329,319.12
TELEPERFORMANCE	2,970	329.90	979,803.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	77.08	1,123,672.24
AENA SME SA	3,556	133.65	475,259.40
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	99.92	134,492.32
ATLANTIA SPA	26,501	16.35	433,291.35
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	10.36	171,839.23
DEUTSCHE POST AG-REG	51,345	48.74	2,502,555.30
GETLINK	22,311	13.08	291,827.88
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	86.31	1,542,618.63
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,564	68.50	175,634.00
CONTINENTAL AG	5,578	118.36	660,212.08
DAIMLER AG	44,402	73.70	3,272,427.40
FAURECIA	6,090	48.86	297,557.40
FERRARI NV	6,452	178.00	1,148,456.00
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	127.10	1,111,616.60
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	92.60	719,039.00
RENAULT SA	8,830	33.72	297,791.75
STELLANTIS NV	105,516	14.39	1,518,375.24
VALEO SA	9,522	28.05	267,092.10
VOLKSWAGEN AG	1,484	283.60	420,862.40
VOLKSWAGEN AG PFD	9,278	229.50	2,129,301.00
ADIDAS AG	9,675	266.10	2,574,517.50
ESSILORLUXOTTICA	14,521	140.90	2,046,008.90
HERMES INTERNATIONAL	1,676	1,050.00	1,759,800.00
KERING	3,983	648.80	2,584,170.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,228	628.10	8,936,606.80
MONCLER SPA	10,437	51.34	535,835.58
PUMA SE	5,052	89.86	453,972.72
SEB SA	1,127	151.10	170,289.70
ACCOR SA	10,451	33.66	351,780.66
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,599	175.50	1,509,124.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	42.12	243,664.20
SODEXO	3,900	83.00	323,700.00
BOLLORE	39,433	4.25	167,590.25

PUBLICIS GROUPE	10,736	54.80	588,332.80	
SCOUT24 AG	5,610	70.22	393,934.20	
SES	25,036	6.21	155,523.63	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	4,745	64.48	305,957.60	
VIVENDI SA	41,661	29.42	1,225,666.62	
DELIVERY HERO SE	6,675	129.95	867,416.25	
HELLOFRESH AG	8,096	69.78	564,938.88	
INDITEX	55,025	29.39	1,617,184.75	
JUST EAT TAKEAWAY	6,355	91.67	582,562.85	
PROSUS NV	25,646	93.05	2,386,360.30	
ZALANDO SE	7,911	90.50	715,945.50	
CARREFOUR SA	27,456	15.76	432,706.56	
COLRUYT NV	2,164	49.14	106,338.96	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	14,348	14.19	203,598.12	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	25.97	348,049.94	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	22.69	1,349,263.14	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,567	58.47	2,313,482.49	
DANONE	32,081	58.84	1,887,646.04	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.06	281,891.26	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	82.75	510,402.00	
HEINEKEN NV	13,143	96.80	1,272,242.40	
JDE PEET'S BV	2,166	32.65	70,719.90	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	109.35	895,904.55	
PERNOD-RICARD SA	11,112	173.45	1,927,376.40	
REMY COINTREAU	1,273	170.10	216,537.30	
BEIERSDORF AG	5,138	91.30	469,099.40	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	82.90	495,244.60	
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	96.26	870,479.18	
L'OREAL	12,964	345.45	4,478,413.80	
AMPLIFON SPA	7,567	35.83	271,125.61	
BIOMERIEUX	1,570	108.65	170,580.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	145.70	330,593.30	
DIASORIN SPA	1,313	152.55	200,298.15	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	65.26	725,560.68	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	39.74	848,965.62	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,760	50.36	2,405,193.60	
ORPEA	2,695	106.90	288,095.50	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	458.00	826,232.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	48.14	682,721.48	
ARGENX SE	2,330	243.30	566,889.00	
BAYER AG	50,652	54.53	2,762,053.56	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	86.33	605,173.30	
GALAPAGOS NV	2,318	67.34	156,094.12	
GRIFOLS S.A.	15,169	23.27	352,982.63	
IPSEN	1,498	80.04	119,899.92	
MERCK KGAA	6,553	143.75	941,993.75	
ORION OYJ	4,159	36.20	150,555.80	
QIAGEN N.V.	12,543	42.38	531,572.34	
RECORDATI SPA	4,578	46.54	213,060.12	
SANOFI	58,854	85.34	5,022,600.36	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	381.50	593,232.50	
UCB SA	6,623	80.08	530,369.84	
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	10.14	191,883.90	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	4.33	1,529,068.03	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	893,341	2.84	2,543,341.82	
BNP PARIBAS	58,640	50.51	2,961,906.40	
CAIXABANK	218,103	2.49	544,166.98	
COMMERZBANK AG	46,644	4.93	230,234.78	
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	12.17	707,563.80	
ERSTE GROUP BANK AG	14,968	28.63	428,533.84	
FINECOBANK SPA	32,034	13.83	443,190.39	
ING GROEP NV-CVA	205,237	10.20	2,094,238.34	
INTESA SANPAOLO	852,114	2.22	1,892,545.19	
KBC GROUPE SA	13,049	61.92	807,994.08	
MEDIOBANCA SPA	24,371	9.11	222,117.29	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,034	17.85	125,556.90	
SOCIETE GENERALE	41,025	21.45	879,986.25	
UNICREDIT SPA	112,845	8.08	912,351.82	
AMUNDI SA	3,955	71.85	284,166.75	

DEUTSCHE BANK AG -REG	102,459	9.82	1,006,762.13	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	146.45	1,469,039.95	
EURAZEO	1,792	68.85	123,379.20	
EXOR NV	6,204	69.76	432,791.04	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	91.02	538,292.28	
NATIXIS	45,362	4.05	183,852.18	
SOFINA	804	313.80	252,295.20	
WENDEL	1,082	110.50	119,561.00	
AEGON NV	91,609	3.77	345,549.14	
AGEAS	8,765	50.24	440,353.60	
ALLIANZ SE-REG	21,071	216.40	4,559,764.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	16.82	964,122.97	
AXA SA	100,473	23.18	2,328,964.14	
CNP ASSURANCES	8,978	14.44	129,687.21	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	153.70	470,014.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,008	255.70	1,791,945.60	
NN GROUP NV	14,069	41.49	583,722.81	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.85	288,197.70	
SAMPO OYJ-A SHS	24,178	39.70	959,866.60	
SCOR SE	6,322	27.86	176,130.92	
AROUNDTOWN SA	52,114	6.19	322,794.11	
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,590	45.42	798,937.80	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	116.40	428,352.00	
VONOVIA SE	27,415	56.20	1,540,723.00	
ADYEN NV	942	2,107.00	1,984,794.00	
AMADEUS IT GROUP SA	23,777	58.54	1,391,905.58	
ATOS SE	4,592	58.62	269,183.04	
BECHTLE AG	1,435	169.80	243,663.00	
CAPGEMINI SA	7,966	150.65	1,200,077.90	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,023	195.85	1,375,454.55	
EDENRED	12,139	46.85	568,712.15	
NEMETSCHEK SE	3,011	59.02	177,709.22	
NEXI SPA	20,612	15.83	326,287.96	
SAP SE	54,000	119.42	6,448,680.00	
TEAMVIEWER AG	9,059	38.37	347,593.83	

WORLDLINE SA	12,774	81.64	1,042,869.36	
NOKIA OYJ	280,161	3.50	982,944.86	
CELLNEX TELECOM SA	22,722	46.96	1,067,025.12	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	175,196	16.08	2,817,502.07	
ELISA OYJ	6,988	47.25	330,183.00	
ILIAD SA	1,016	154.85	157,327.60	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.64	152,350.56	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.92	507,788.77	
ORANGE S.A.	106,132	10.30	1,093,796.39	
PROXIMUS SA	9,697	18.31	177,552.07	
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.43	215,980.09	
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.47	119,932.44	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.34	110,062.56	
TELEFONICA S.A.	261,218	3.66	958,147.62	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	34.66	182,623.54	
E.ON SE	116,681	10.07	1,175,444.39	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.89	714,667.18	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	29,644	11.40	337,941.60	
ELIA GROUP SA/NV	1,464	90.25	132,126.00	
ENAGAS	14,471	18.05	261,273.90	
ENDESA S.A.	14,104	22.20	313,108.80	
ENEL SPA	420,487	8.73	3,672,953.94	
ENGIE	94,886	12.36	1,172,790.96	
FORTUM OYJ	24,312	23.24	565,010.88	
IBERDROLA SA	310,163	11.69	3,627,356.28	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	20.92	322,983.88	
RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	15.07	356,134.24	
RWE AG	32,165	33.88	1,089,750.20	
SNAM SPA	106,707	4.68	499,922.29	
SUEZ	18,986	19.84	376,682.24	
TERNA SPA	70,562	6.17	435,932.03	
UNIPER SE	10,456	30.37	317,548.72	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	25.73	734,874.53	
VERBUND AG	3,190	69.05	220,269.50	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	261.00	640,755.00	

	ASML HOLDING NV	21,794	554.10	12,076,055.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	66,553	34.56	2,300,404.44	
	STMICROELECTRONICS NV	33,261	32.21	1,071,336.81	
	ユーロ 小計	9,844,882		237,824,292.85 (31,047,961,431)	
英ポンド	BP PLC	1,057,250	2.92	3,088,227.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,867	13.56	2,886,902.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,653	12.94	2,442,301.73	
	ANGLO AMERICAN PLC	61,589	31.32	1,928,967.48	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	18.27	355,247.72	
	BHP GROUP PLC	110,160	22.12	2,437,290.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,626	69.30	459,181.80	
	EVRAZ PLC	28,275	6.46	182,826.15	
	FRESNILLO PLC	9,684	8.93	86,516.85	
	GLENCORE PLC	538,015	2.96	1,593,869.43	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	32.94	331,837.56	
	MONDI PLC	25,128	19.91	500,424.12	
	RIO TINTO PLC	57,926	61.19	3,544,491.94	
	ASHTED GROUP PLC	23,686	47.82	1,132,664.52	
	BAE SYSTEMS PLC	165,753	4.96	822,632.13	
	BUNZL PLC	17,064	24.54	418,750.56	
	DCC PLC	5,954	63.52	378,198.08	
	FERGUSON PLC	11,059	92.82	1,026,496.38	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	1.63	402,657.44	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	389,579	1.01	396,435.59	
	SMITHS GROUP PLC	16,787	16.47	276,481.89	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	122.65	451,965.25	
	EXPERIAN PLC	48,895	27.67	1,352,924.65	
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	61.98	507,244.32	
	RELX PLC	100,974	19.40	1,958,895.60	
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.11	463,082.92	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	7.82	365,333.85	
	BURBERRY GROUP PLC	23,066	20.78	479,311.48	
	PERSIMMON PLC	16,916	31.78	537,590.48	
	TAYLOR WIMPEY PLC	158,662	1.87	297,253.25	

THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	45.79	329,092.73
COMPASS GROUP PLC	93,018	15.67	1,458,057.15
ENTAIN PLC	28,865	16.90	487,962.82
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,790	51.82	403,677.80
WHITBREAD PLC	11,282	34.03	383,926.46
AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	5.74	252,559.68
INFORMA PLC	78,152	5.50	429,836.00
PEARSON PLC	39,623	8.01	317,380.23
WPP PLC	63,987	9.67	619,266.18
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	9.08	262,279.68
KINGFISHER PLC	109,678	3.63	399,118.24
NEXT PLC	6,860	80.12	549,623.20
OCADO GROUP PLC	27,379	22.36	612,194.44
SAINSBURY (J) PLC	67,872	2.42	164,385.98
TESCO PLC	399,930	2.22	890,044.21
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.79	262,272.47
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	22.94	384,726.74
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	119,386	27.34	3,264,013.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.34	220,559.36
DIAGEO PLC	120,446	32.96	3,969,900.16
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	14.86	743,294.59
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	66.54	2,487,597.90
UNILEVER PLC	133,961	41.13	5,510,485.73
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	14.92	661,776.60
ASTRAZENECA PLC	67,526	75.64	5,107,666.64
GLAXOSMITHKLINE PLC	258,176	13.42	3,466,270.97
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	23.92	181,337.52
BARCLAYS PLC	904,741	1.81	1,646,447.67
HSBC HOLDINGS PLC	1,044,428	4.19	4,376,153.32
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.42	1,601,594.86
NATWEST GROUP PLC	245,244	1.94	478,103.17
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.79	703,199.67
3I GROUP PLC	49,338	12.36	610,064.37
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	16.77	328,222.44

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,810	77.26	1,221,480.60	
	M&G PLC	133,064	2.10	280,365.84	
	SCHRODERS PLC	6,213	35.39	219,878.07	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	13.20	345,403.18	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	2.72	335,645.14	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	31.95	368,543.25	
	AVIVA PLC	198,601	3.99	792,417.99	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.98	188,601.22	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.72	854,660.82	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	21,914	7.22	158,306.73	
	PRUDENTIAL PLC	130,604	15.10	1,972,120.40	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	6.82	356,965.67	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	39.30	237,254.10	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	6.45	361,116.15	
	HALMA PLC	19,839	26.28	521,368.92	
	BT GROUP PLC	469,907	1.55	728,590.80	
	VODAFONE GROUP PLC	1,338,401	1.33	1,787,836.05	
	NATIONAL GRID PLC	182,788	9.03	1,651,489.58	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	24.38	302,750.84	
	SSE PLC	55,879	14.93	834,552.86	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	9.59	318,455.13	
	英ポンド 小計	15,165,706		88,506,937.63 (13,257,454,187)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	20.15	203,535.15	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	883.00	314,348.00	
	GIVAUDAN-REG	484	3,907.00	1,890,988.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	56.98	1,552,078.22	
	SIKA AG	7,399	276.10	2,042,863.90	
	ABB LTD	95,025	29.95	2,845,998.75	
	GEBERIT AG-REG	1,986	621.80	1,234,894.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	277.80	261,409.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	285.50	608,686.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	8,786	63.94	561,776.84	
	SGS SA	308	2,733.00	841,764.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,618	292.30	765,241.40	

	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,855	95.10	2,649,010.50	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,257	286.10	359,627.70	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	55.30	139,134.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	2,198.00	316,512.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	8,600.00	507,400.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	91,500.00	457,500.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	147,564	109.64	16,178,916.96	
	ALCON INC	26,585	69.38	1,844,467.30	
	SONOVA HOLDING AG	2,660	270.40	719,264.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	475	1,245.00	591,375.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	557.80	2,222,275.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	113,904	80.65	9,186,357.60	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	1,436	328.60	471,869.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	35,910	309.45	11,112,349.50	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	133.70	352,700.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	94.30	148,051.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	126,713	9.39	1,189,835.07	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,324	56.30	581,241.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	1,287.50	1,252,737.50	
	UBS GROUP AG	191,189	13.99	2,675,690.05	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	158.40	392,040.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,421	465.50	661,475.50	
	SWISS RE AG	15,168	83.26	1,262,887.68	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,733	377.70	2,920,754.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	89.95	351,344.70	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,063	137.50	558,662.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,150	106.35	866,752.50	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	477.50	668,022.50	
	スイスフラン 小計	899,451		73,761,839.92 (8,713,486,149)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	267.60	2,296,275.60	
	BOLIDEN AB	13,086	334.80	4,381,192.80	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	34,370	158.00	5,430,460.00	
	ALFA LAVAL AB	13,939	291.20	4,059,036.80	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	253.50	13,212,166.50	

ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	545.60	18,787,190.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	471.10	9,321,655.70	
EPIROC AB-A	34,230	204.40	6,996,612.00	
EPIROC AB-B	16,402	186.05	3,051,592.10	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,951	256.80	1,271,416.80	
NIBE INDUSTRIER-B	18,441	317.80	5,860,549.80	
SANDVIK AB	61,070	229.20	13,997,244.00	
SKANSKA AB-B SHS	17,183	227.20	3,903,977.60	
SKF AB-B SHARES	20,607	229.10	4,721,063.70	
VOLVO AB-B SHS	71,792	211.45	15,180,418.40	
SECURITAS AB-B SHS	16,123	146.60	2,363,631.80	
ELECTROLUX AB-SER B	15,098	243.60	3,677,872.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	122.20	2,272,064.60	
EVOLUTION GAMING GROUP	7,578	1,449.60	10,985,068.80	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	42,837	208.20	8,918,663.40	
ICA GRUPPEN AB	5,614	409.70	2,300,055.80	
SWEDISH MATCH AB	8,464	712.00	6,026,368.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,701	277.60	9,077,797.60	
NORDEA BANK ABP	167,942	84.85	14,249,878.70	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	104.35	9,215,878.95	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	94.20	7,316,325.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	152.20	6,989,176.20	
EQT AB	12,365	274.30	3,391,719.50	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,396	325.60	1,105,737.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	307.40	3,271,350.80	
INVESTOR AB-B SHS	23,614	714.10	16,862,757.40	
KINNEVIK AB-B SHS	12,465	468.10	5,834,866.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	489.40	1,648,299.20	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	494.50	2,632,223.50	
ERICSSON LM-B SHS	146,984	119.00	17,491,096.00	
HEXAGON AB-B SHS	14,730	852.00	12,549,960.00	
TELE2 AB-B SHS	25,537	115.90	2,959,738.30	
TELIA CO AB	128,045	35.06	4,489,897.92	
スウェーデンクローナ 小計	1,334,317		268,101,281.17 (3,450,463,488)	

ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	51,871	165.06	8,561,827.26	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	55.26	3,555,649.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	427.90	3,853,239.50	
	ADEVINTA ASA-B	11,815	150.25	1,775,203.75	
	SCHIBSTED ASA	3,372	417.50	1,407,810.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	368.00	2,016,640.00	
	MOWI ASA	22,242	205.50	4,570,731.00	
	ORKLA ASA	37,292	82.36	3,071,369.12	
	DNB ASA	49,048	180.60	8,858,068.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	194.60	2,220,775.20	
	TELENOR ASA	34,937	151.40	5,289,461.80	
	ノルウェークローネ 小計	300,818		45,180,775.87 (588,253,701)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	567.40	3,125,806.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	418.20	4,814,318.40	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S	205	2,803.00	574,615.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,488	1,314.00	13,781,232.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	14,190.00	2,383,920.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	311	15,170.00	4,717,870.00	
	DSV PANALPINA A S	10,873	1,318.00	14,330,614.00	
	PANDORA A/S	4,763	698.80	3,328,384.40	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,084.50	6,056,932.50	
	AMBU A/S-B	8,356	343.80	2,872,792.80	
	COLOPLAST-B	6,399	1,010.50	6,466,189.50	
	DEMANT A/S	4,455	311.40	1,387,287.00	
	GN STORE NORD A/S	6,484	559.60	3,628,446.40	
	GENMAB A/S	3,317	2,251.00	7,466,567.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	192.80	558,348.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	89,680	454.90	40,795,432.00	
	DANSKE BANK A/S	31,326	116.15	3,638,514.90	
	TRYG A/S	16,989	145.00	2,463,405.00	
	ORSTED A/S	9,555	990.20	9,461,361.00	
	デンマーククローネ 小計	228,871		131,852,037.30 (2,315,321,774)	
オーストラリア	AMPOL LTD	10,927	25.26	276,016.02	

ドル

OIL SEARCH LTD	105,618	3.78	399,236.04	
ORIGIN ENERGY LIMITED	109,448	4.13	452,020.24	
SANTOS LTD	84,586	6.98	590,410.28	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	31.13	164,802.22	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	22.80	1,148,071.20	
BHP GROUP LTD	153,209	47.56	7,286,620.04	
BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	21.84	504,263.76	
EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.78	403,527.60	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	92,105	21.66	1,994,994.30	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,266	44.34	987,274.44	
NEWCREST MINING LIMITED	42,131	28.38	1,195,677.78	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,015	11.38	557,790.70	
ORICA LIMITED	17,981	13.86	249,216.66	
RIO TINTO LIMITED	19,336	121.15	2,342,556.40	
SOUTH32 LTD	233,326	2.90	676,645.40	
CIMIC GROUP LTD	4,062	17.82	72,384.84	
BRAMBLES LIMITED	74,638	10.50	783,699.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.82	360,760.80	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	4.99	228,696.69	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	36.70	1,128,488.30	
CROWN RESORTS LTD	21,863	12.06	263,667.78	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	112,817	4.83	544,906.11	
REA GROUP LTD	2,833	159.89	452,968.37	
SEEK LIMITED	16,730	31.72	530,675.60	
WESFARMERS LIMITED	57,250	55.70	3,188,825.00	
COLES GROUP LIMITED	67,053	15.71	1,053,402.63	
WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	42.24	2,771,239.68	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,639	13.30	354,298.70	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	10.25	373,756.00	
COCHLEAR LIMITED	3,798	225.52	856,524.96	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	67.89	641,288.94	
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	36.58	771,142.98	
CSL LIMITED	23,602	273.34	6,451,370.68	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	148,002	28.70	4,247,657.40	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	90,927	89.39	8,127,964.53	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	172,940	26.46	4,575,992.40	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	189,179	25.12	4,752,176.48	
	AMP LIMITED	223,504	1.13	253,677.04	
	ASX LTD	11,180	72.96	815,692.80	
	MACQUARIE GROUP LTD	17,336	158.45	2,746,889.20	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	48.61	281,111.63	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	4.66	546,091.42	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.93	377,161.32	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	68,618	9.47	649,812.46	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	10.40	664,903.20	
	AFTERPAY LTD	11,190	123.56	1,382,636.40	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	14.52	406,080.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	30.80	243,597.20	
	XERO LTD	6,090	143.49	873,854.10	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.41	739,775.63	
	TPG TELECOM LTD	17,758	5.84	103,706.72	
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	8.71	283,005.32	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.89	161,065.80	
	オーストラリアドル 小計	3,460,890		72,290,072.03 (6,049,956,128)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.48	528,918.28	
	A2 MILK CO LTD	37,422	7.90	295,633.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	28,241	34.80	982,786.80	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	20,761	14.10	292,730.10	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	89,712	4.45	399,218.40	
	MERCURY NZ LTD	31,947	6.81	217,718.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,872	5.69	386,191.68	
	ニュージーランドドル 小計	346,666		3,103,197.86 (241,087,441)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	150,924	63.95	9,651,589.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	145.90	10,285,950.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	64,000	26.45	1,692,800.00	
	MTR CORPORATION	84,500	44.00	3,718,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	67.75	7,994,500.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	37.05	4,297,800.00	

	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	9.93	794,400.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	14.62	1,035,096.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	25.75	2,307,200.00	
	WH GROUP LIMITED	474,500	6.68	3,169,660.00	
	BANK OF EAST ASIA	38,420	16.78	644,687.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	27.30	5,118,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	150.30	5,831,640.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,900	484.80	30,493,920.00	
	AIA GROUP LTD	622,000	97.85	60,862,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,924	48.50	6,786,314.00	
	ESR CAYMAN LTD	64,600	26.55	1,715,130.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	21.45	2,102,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	35.00	2,918,440.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	42.00	3,562,986.00	
	SINO LAND CO	118,200	11.64	1,375,848.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	119.40	8,119,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	62.80	1,695,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	23.80	1,261,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	44.80	4,569,600.00	
	PCCW LIMITED	256,000	4.54	1,162,240.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	47.80	1,434,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	77.00	6,552,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	607,514	12.50	7,593,925.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	47.55	3,399,825.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,600	117.70	1,365,320.00	
	香港ドル 小計	4,169,099		203,513,321.40 (2,828,835,167)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	5.45	380,955.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	76,100	4.05	308,205.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.03	392,168.98	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.88	288,200.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	5.24	540,768.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	91,200	28.95	2,640,240.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	171,500	11.95	2,049,425.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,700	26.35	1,546,745.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	10.60	453,680.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	3.72	508,152.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.94	204,852.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.84	170,128.00	
	VENTURE CORP LTD	15,200	20.35	309,320.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,115	2.54	1,089,952.10	
シンガポールドル 小計		1,647,281		10,882,791.08 (885,532,710)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	20.56	590,298.16	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	454.20	630,883.80	
	BANK HAPOLIM BM	66,403	25.81	1,713,861.43	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	22.61	1,586,091.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	14.58	797,146.92	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	90.14	833,704.86	
	AZRIELI GROUP	2,140	224.60	480,644.00	
	NICE LTD	3,251	778.60	2,531,228.60	
イスラエルシェケル 小計		235,967		9,163,859.27 (304,142,990)	
合 計		55,797,955		283,850,458,884 (283,850,458,884)	

（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 591銘柄	69.3%	71.9%
カナダドル	株式 87銘柄	3.4%	3.5%
ユーロ	株式 234銘柄	10.5%	10.9%
英ポンド	株式 86銘柄	4.5%	4.7%
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 38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 19銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	2.1%	2.1%
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 31銘柄	1.0%	1.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	0.3%	0.3%

イスラエルシェケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
-----------	----	-----	------	------

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	444,297.04	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,496	1,165,057.60	
		AMERICAN TOWER CORP	23,040	5,853,081.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,936	577,930.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	1,423,854.72	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	830,901.75	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	581,916.42	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	22,634	4,236,632.12	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,002	2,086,858.08	
		DUKE REALTY CORP	17,601	798,557.37	
		EQUINIX INC	4,655	3,342,802.05	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	594,090.48	
		EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,467,063.18	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	990,736.88	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,164	909,436.56	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	977,416.44	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	649,568.01	
		INVITATION HOMES INC	27,735	941,325.90	
		IRON MOUNTAIN INC	14,204	572,705.28	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	721,265.12	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	896,998.20	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,364	392,691.96	
		PROLOGIS INC	38,832	4,460,631.84	
		PUBLIC STORAGE	8,249	2,283,075.73	
		REALTY INCOME CORPORATION	17,798	1,235,181.20	
		REGENCY CENTERS CORP	8,289	514,912.68	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	1,754,034.84	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	16,201	1,894,220.92	

	SUN COMMUNITIES INC	5,064	816,012.96	
	UDR INC	16,633	778,091.74	
	VENTAS INC	19,379	1,061,387.83	
	VEREIT INC	10,854	454,891.14	
	VICI PROPERTIES INC	27,615	850,542.00	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	390,202.92	
	WELLTOWER INC	21,015	1,585,371.60	
	WEYERHAEUSER CO	38,940	1,487,508.00	
	WP CAREY INC	8,640	634,003.20	
米ドル 小計		645,105	50,655,255.76	
			(5,465,195,543)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	219,596.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	152,689.32	
カナダドル 小計		11,412	372,285.62	
			(32,225,043)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	181,010.40	
	GECINA SA	2,189	263,446.15	
	KLEPIERRE	9,305	192,985.70	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,962	530,348.82	
ユーロ 小計		21,844	1,167,791.07	
			(152,455,124)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	229,306.20	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	283,650.87	
	SEGRO PLC	59,874	596,345.04	
英ポンド 小計		144,697	1,109,302.11	
			(166,162,363)	
オーストラリアドル	APA GROUP	55,644	562,560.84	
	DEXUS	54,256	543,645.12	
	GOODMAN GROUP	86,301	1,663,883.28	
	GPT GROUP	97,296	450,480.48	
	LENDLEASE GROUP	36,263	454,375.39	
	MIRVAC GROUP	200,053	518,137.27	
	SCENTRE GROUP	275,200	745,792.00	
	STOCKLAND	127,393	587,281.73	

		SYDNEY AIRPORT	73,899	458,173.80	
		TRANSURBAN GROUP	138,897	1,973,726.37	
		VICINITY CENTRES	167,788	265,943.98	
	オーストラリアドル 小計		1,312,990	8,224,000.26 (688,266,581)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	125,000	966,250.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,206,400.00	
		LINK REIT	110,100	8,246,490.00	
	香港ドル 小計		432,100	11,419,140.00 (158,726,046)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	170,500	530,255.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	238,488	517,518.96	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	222,388.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	272,057.00	
		SUNTEC REIT	102,700	159,185.00	
	シンガポールドル 小計		754,688	1,701,403.96 (138,443,240)	
	合計			6,801,473,940 (6,801,473,940)	

（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%	80.4%
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	0.1%	2.2%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.4%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.2%	10.1%
香港ドル	投資証券 3銘柄	0.1%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 5銘柄	0.0%	2.0%

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	136,683,620	251,077,719
金銭信託	646,925,215	762,512,013
コール・ローン	663,214,708	1,749,778,290
株式	3,662,360,965	9,586,932,925
投資信託受益証券	411,445,602	497,674,247
投資証券	119,441,221	912,831,155
派生商品評価勘定	101,259,570	16,583,310
未収入金	132,763	16,081,391
未収配当金	4,237,599	12,315,820
前払金	6,878,868	-
差入委託証拠金	650,095,027	785,870,472
流動資産合計	6,402,675,158	14,591,657,342
資産合計	6,402,675,158	14,591,657,342
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,112,301	33,807,564
前受金	-	121,915
未払解約金	4,770,000	290,000
未払利息	1,913	5,064
その他未払費用	96,472	64,023
流動負債合計	35,980,686	34,288,566
負債合計	35,980,686	34,288,566
純資産の部		
元本等		
元本	5,713,549,870	8,325,755,557
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	653,144,602	6,231,613,219
元本等合計	6,366,694,472	14,557,368,776
純資産合計	6,366,694,472	14,557,368,776
負債純資産合計	6,402,675,158	14,591,657,342

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日
-----	--------------------------------

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

（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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,713,549,870口	8,325,755,557口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1143円 (10,000口当たりの純資産額 11,143円)	1口当たり純資産額 1.7485円 (10,000口当たりの純資産額 17,485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 4月28日 至 2021年 4月26日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,172,770,028	-	2,165,891,160	△6,878,868
	MSCIE 2006	2,172,770,028	-	2,165,891,160	△6,878,868
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,262,767,762	-	2,337,596,220	74,828,458
	米ドル	2,262,767,762	-	2,337,596,220	74,828,458
	売建	961,067,762	-	958,870,083	2,197,679
	米ドル	961,000,000	-	958,802,971	2,197,029
	ブラジルリアル	58,380	-	57,750	630
	香港ドル	9,382	-	9,362	20
合計		5,396,605,552	-	5,462,357,463	70,147,269

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,557,460,207	-	3,557,582,122	121,915
	MSCIE 2106	3,557,460,207	-	3,557,582,122	121,915
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,684,900,000	-	2,664,838,702	△20,061,298
	米ドル	2,684,900,000	-	2,664,838,702	△20,061,298
	売建	157,000,000	-	154,284,871	2,715,129
	米ドル	157,000,000	-	154,284,871	2,715,129
合計		6,399,360,207	-	6,376,705,695	△17,224,254

(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 4月28日

至 2021年 4月26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 4月27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	5,742,636,631円
同期中における追加設定元本額	3,557,523,267円
同期中における一部解約元本額	3,586,610,028円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	2,454,605,033円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,776,810,273円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	198,129,473円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	458,657,103円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	338,056,722円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,268,525円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	40,284,077円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	27,674,839円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	125,402,862円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	82,725,406円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	144,452,900円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	36,039,470円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,548,148円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	14,895,039円
合計	5,713,549,870円

（2021年 4月26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	5,713,549,870円
同期中における追加設定元本額	4,826,668,980円
同期中における一部解約元本額	2,214,463,293円
2021年 4月26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	4,212,467,456円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,168,457,848円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	423,316,544円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	466,719,046円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	305,570,265円
イオン・バランス戦略ファンド	36,830,971円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	19,428,099円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	51,180,927円

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	38,730,510円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	184,820,124円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	125,451,007円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	215,280,733円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	45,405,336円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,767,956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＞	29,328,735円
合計	8,325,755,557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	1,387	3.75	5,201.25	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	2,217	10.16	22,524.72	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	1,088	71.64	77,944.32	
	51JOB INC-ADR	358	62.56	22,396.48	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,027	32.28	162,271.56	
	LI AUTO INC - ADR	2,210	20.60	45,526.00	
	NIO INC-ADR	15,750	41.08	647,010.00	
	XPENG INC - ADR	2,088	33.30	69,530.40	
	GSX TECHEDU INC- ADR	949	27.07	25,689.43	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,969	59.00	116,171.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	18,810	16.10	302,841.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	4,662	61.06	284,661.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	4,894	59.13	289,382.22	
	AUTOHOME INC-ADR	775	93.67	72,594.25	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,311	220.94	731,532.34	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,015	116.66	235,069.90	
	DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,074	10.50	11,277.00	
	HUYA INC-ADR	1,153	18.50	21,330.50	
	IQIYI INC-ADR	3,643	15.60	56,830.80	
	JOYY INC	758	99.10	75,117.80	
	MOMO INC-SPON ADR	1,551	15.17	23,528.67	

	NETEASE.COM INC -ADR	5,098	112.62	574,136.76	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,731	18.97	89,747.07	
	WEIBO CORP-SPON ADR	626	51.67	32,345.42	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	23,266	232.08	5,399,573.28	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	643	37.01	23,797.43	
	JD.COM INC-ADR	10,617	76.75	814,854.75	
	PINDUODUO INC-ADR	4,831	138.61	669,624.91	
	TRIP.COM GROUP-ADR	6,219	38.54	239,680.26	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	5,480	31.75	173,990.00	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,300	12.12	15,756.00	
	BEIGENE LTD-ADR	559	317.85	177,678.15	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	1,066	29.92	31,894.72	
	ZAI LAB LTD-ADR	866	173.07	149,878.62	
	CREDICORP LTD	861	120.16	103,457.76	
	LUFAX HOLDING LTD	1,742	14.21	24,753.82	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	377	42.29	15,943.33	
	KE HOLDINGS INC-ADR	1,520	56.38	85,697.60	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	0.89	6,357.84	
	21VIANET GROUP INC-ADR	960	29.39	28,214.40	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	1,047	85.05	89,047.35	
	GLOBANT SA	443	231.59	102,594.37	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	608	48.32	29,378.56	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	892	4.46	3,978.32	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	640	89.51	57,286.40	
	米ドル 小計	157,161		12,238,098.48 (1,320,368,445)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	186,000	15.07	2,803,020.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	39,300	101.81	4,001,133.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,695	277.55	470,447.25	
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	11,700	55.85	653,445.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	62.14	223,704.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	2,655	356.25	945,843.75	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	4,300	217.66	935,938.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	3,050	162.87	496,753.50	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184	78.74	329,448.16	

	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	66,100	65.05	4,299,805.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	111.61	479,923.00	
	BECLE SAB DE CV	6,000	48.07	288,420.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	6,770	98.87	669,349.90	
	GRUMA S.A.B. -B	2,465	232.89	574,073.85	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	19,600	42.04	823,984.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	17,600	37.61	661,936.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	31,900	121.96	3,890,524.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	28,200	19.61	553,002.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	430,500	14.50	6,242,250.00	
	TELESITES SAB DE CV	14,700	20.00	294,000.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	7,100	84.67	601,157.00	
	メキシコペソ 小計	891,719		30,238,157.41 (164,507,671)	
ブラジルリアル	COSAN SA	3,172	91.02	288,715.44	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	46,900	23.27	1,091,363.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	58,900	23.69	1,395,341.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,500	20.97	157,275.00	
	BRADSPAR SA -PREF	2,900	72.78	211,062.00	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	8,500	49.03	416,755.00	
	GERDAU S.A.-PREF	13,400	33.52	449,168.00	
	SUZANO SA	9,215	70.05	645,510.75	
	VALE SA	45,700	107.99	4,935,143.00	
	WEG SA	10,630	75.21	799,482.30	
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	13,800	12.27	169,326.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	7,900	61.70	487,430.00	
	RUMO SA	15,600	21.06	328,536.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,100	38.51	80,871.00	
	B2W CIA DIGITAL	3,061	64.80	198,352.80	
	LOJAS AMERICANAS SA	9,900	22.80	225,720.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,880	40.82	362,481.60	
	MAGAZINE LUIZA SA	37,100	21.73	806,183.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,600	22.71	195,306.00	
	VIA VAREJO SA	14,000	13.12	183,680.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	3,100	22.59	70,029.00	

	RAIA DROGASIL SA	14,300	24.92	356,356.00	
	AMBEV SA	59,900	15.85	949,415.00	
	BRF-BRASIL FOODS SA	5,900	23.72	139,948.00	
	JBS SA	14,200	35.00	497,000.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	10,400	48.00	499,200.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	11,500	14.73	169,395.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,700	81.80	548,060.00	
	HYPERMARCAS SA	3,900	35.68	139,152.00	
	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	61,206	23.53	1,440,177.18	
	BANCO BRADESCO SA	17,938	20.67	370,778.46	
	BANCO DO BRASIL S.A.	10,600	30.07	318,742.00	
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	60,600	27.53	1,668,318.00	
	ITAUSA SA	54,280	10.32	560,169.60	
	BM&F BOVESPA SA	25,800	53.72	1,385,976.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	8,600	23.40	201,240.00	
	TOTVS SA	5,500	31.41	172,755.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	6,900	43.93	303,117.00	
	TIM SA	11,100	12.24	135,864.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	3,800	36.72	139,536.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	3,100	36.95	114,545.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	12,508	13.50	168,858.00	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	6.50	71,500.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	3,900	42.64	166,296.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,400	30.68	73,632.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	42.21	107,635.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,200	25.28	283,136.00	
	ブラジルリアル 小計	770,640		24,478,532.63 (482,205,062)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,447	8,749.00	38,906,803.00	
	EMPRESAS CMPC SA	13,085	2,244.00	29,362,740.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	1,496	38,101.00	56,999,096.00	
	FALABELLA SA	10,123	3,400.00	34,418,200.00	
	CENCOSUD SA	18,317	1,628.00	29,820,076.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	6,630.00	10,515,180.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	3,386	1,870.00	6,331,820.00	

	BANCO DE CHILE	504,308	82.57	41,640,711.56	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	640	36,800.00	23,552,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	735,822	43.33	31,883,167.26	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,523	1,420.00	7,842,660.00	
	COLBUN SA	124,112	131.50	16,320,728.00	
	ENEL AMERICAS SA	263,707	106.45	28,071,610.15	
	ENEL CHILE SA	364,877	54.85	20,013,503.45	
	チリペソ 小計	2,051,429		375,678,295.42 (56,917,891)	
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	61,693	2,228.00	137,452,004.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,843	28,800.00	81,878,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,554	28,800.00	159,955,200.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	20,620.00	61,571,320.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,621	22,300.00	125,348,300.00	
	コロンビアペソ 小計	78,697		566,205,224.00 (16,822,523)	
ユーロ	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40	
	OPAP SA	2,923	12.20	35,660.60	
	JUMBO S.A.	1,451	15.70	22,780.70	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,584	14.02	36,227.68	
	ユーロ 小計	7,081		95,259.38 (12,436,112)	
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,504	86.50	130,096.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	19,752	17.99	355,338.48	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	14.55	122,976.60	
	KOC HOLDING AS	9,107	17.21	156,731.47	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	14,096	7.25	102,196.00	
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	11.27	50,410.71	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	734	168.40	123,605.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,702	65.95	376,046.90	
	AKBANK T.A.S.	39,334	4.87	191,556.58	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	27,208	7.07	192,360.56	
	TURKIYE IS BANKASI-C	22,389	4.86	108,810.54	
	YAPI VE KREDI BANKASI	32,206	2.08	66,988.48	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	9,657	7.88	76,097.16	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	15,566	15.00	233,490.00	
トルコリラ 小計		210,180		2,286,705.08 (29,343,228)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	934	642.00	599,628.00	
	MONETA MONEY BANK AS	6,590	80.10	527,859.00	
	CEZ AS	1,994	592.00	1,180,448.00	
チェココルナ 小計		9,518		2,307,935.00 (11,665,226)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,501	2,024.00	7,086,024.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,803	8,685.00	15,659,055.00	
	OTP BANK PLC	2,606	13,200.00	34,399,200.00	
ハンガリーフォリント 小計		7,910		57,144,279.00 (20,531,539)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	3,661	66.50	243,456.50	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	21,226	6.80	144,421.70	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,813	200.90	364,231.70	
	LPP SA	15	8,890.00	133,350.00	
	CD PROJEKT SA	758	171.14	129,724.12	
	CYFROWY POLSAT SA	3,380	30.04	101,535.20	
	ALLEGRO.EU SA	4,403	56.50	248,769.50	
	DINO POLSKA SA	651	244.50	159,169.50	
	BANK PEKAO SA	2,279	75.98	173,158.42	
	PKO BANK POLSKI SA	10,697	32.70	349,791.90	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	360	210.90	75,924.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,381	32.50	239,882.50	
	ORANGE POLSKA SA	6,710	7.07	47,439.70	
	PGE SA	10,070	8.54	86,017.94	
ポーランドズロチ 小計		73,404		2,496,872.68 (71,598,822)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	26,000	7.65	198,900.00	
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	298,000	3.92	1,168,160.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	40,000	16.54	661,600.00	
	PETROCHINA CO LTD	248,000	2.72	674,560.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	16,000	9.89	158,240.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	40,000	3.96	158,400.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	14,500	47.70	691,650.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	19,000	12.00	228,000.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	36,000	5.40	194,400.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	48,000	12.24	587,520.00	
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	26,000	8.67	225,420.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	14,000	18.10	253,400.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	13,000	7.10	92,300.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	21,000	11.20	235,200.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	6,250	15.28	95,500.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	10,000	7.62	76,200.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	68,000	11.26	765,680.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	26,000	5.40	140,400.00	
BOC AVIATION LTD	1,900	70.85	134,615.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	3.49	69,800.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	21,000	36.95	775,950.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	12,000	19.88	238,560.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	45,000	3.95	177,750.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	18,000	5.57	100,260.00	
CITIC LIMITED	77,000	8.00	616,000.00	
FOSUN INTERNATIONAL	31,500	11.10	349,650.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	7,000	30.45	213,150.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	21.60	216,000.00	
WEICHAI POWER CO	24,000	19.42	466,080.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	14.30	94,637.40	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	6,600	34.45	227,370.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	11.48	149,240.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	7,000	34.20	239,400.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	53,000	5.00	265,000.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	18,000	76.75	1,381,500.00	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	10,000	18.64	186,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP	18,000	12.06	217,080.00	
AIR CHINA/HONG KONG	16,000	6.43	102,880.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	20,000	6.00	120,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	33,000	13.40	442,200.00	
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	16,140	12.46	201,104.40	

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	5.52	132,480.00	
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	24,000	6.45	154,800.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	9.21	92,100.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	13,000	13.20	171,600.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	6.75	81,000.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	7.30	219,000.00	
BYD CO LTD-H	10,000	180.50	1,805,000.00	
DONGFENG MOTOR CORPORATION	32,000	7.11	227,520.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	6,800	46.15	313,820.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	74,000	22.20	1,642,800.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	40,000	21.90	876,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	33,200	6.88	228,416.00	
MINH GROUP LTD	10,000	31.10	311,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	14,000	17.06	238,840.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	14,000	137.60	1,926,400.00	
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	26,000	3.85	100,100.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	24,000	34.20	820,800.00	
LI NING COMPANY LIMITED	27,000	63.40	1,711,800.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	10,400	173.00	1,799,200.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	4,000	18.30	73,200.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	12,000	17.86	214,320.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.06	84,720.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	10,000	52.35	523,500.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9,000	31.05	279,450.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	15.62	39,050.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	1.14	125,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	84.60	355,320.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	2,600	256.80	667,680.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	70,700	632.00	44,682,400.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	6,000	35.30	211,800.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	99,000	1.31	129,690.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	3,800	112.60	427,880.00	
MEITUAN-B	44,400	306.40	13,604,160.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	19.98	167,832.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	11,000	10.86	119,460.00	

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	56.75	340,500.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	7.32	179,340.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	107.30	118,030.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	22.15	354,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	35,000	43.25	1,513,750.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	18,000	66.30	1,193,400.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.58	89,310.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	4,400	41.35	181,940.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	9,000	54.65	491,850.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	14.22	369,720.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	75.20	451,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	13,000	9.96	129,480.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	67,000	5.76	385,920.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	6,000	79.00	474,000.00	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	8,000	51.70	413,600.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	27.80	111,200.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	12.18	48,720.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	52,000	23.80	1,237,600.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	14,000	19.62	274,680.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	54.75	492,750.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,100	99.75	608,475.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	28,000	16.82	470,960.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	17.00	130,900.00	
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	18,800	23.85	448,380.00	
3SBIO INC	10,500	7.46	78,330.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	339.00	339,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	17,000	18.20	309,400.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	104,800	9.92	1,039,616.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	5.24	62,880.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	42,000	4.70	197,400.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	17.02	170,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,400	150.00	210,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	14,000	34.25	479,500.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	11,500	90.00	1,035,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	1,400	155.80	218,120.00	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	7,500	39.80	298,500.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	132,000	8.45	1,115,400.00	
SSY GROUP LIMITED	10,000	4.98	49,800.00	
WUXI APPTec CO LTD	3,676	173.20	636,683.20	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	40,500	115.00	4,657,500.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	340,000	3.10	1,054,000.00	
BANK OF CHINA LTD	976,000	3.14	3,064,640.00	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	108,000	5.09	549,720.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	27,500	3.50	96,250.00	
CHINA CITIC BANK	120,000	4.25	510,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,188,000	6.54	7,769,520.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	34,000	3.42	116,280.00	
CHINA MERCHANTS BANK- H	48,000	63.35	3,040,800.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	80,100	4.33	346,833.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	24,000	3.35	80,400.00	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	746,000	5.42	4,043,320.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	122,000	5.34	651,480.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	90,000	1.55	139,500.00	
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	9.71	77,680.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO	36,000	4.73	170,280.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	92,000	1.02	93,840.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	18,400	19.20	353,280.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	26,500	18.32	485,480.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.94	259,260.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	11.46	194,820.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	28,000	6.98	195,440.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	14,000	11.38	159,320.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO.	91,000	15.76	1,434,160.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,000	28.90	982,600.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	22,200	14.50	321,900.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	11,400	29.90	340,860.00	
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	85,000	2.58	219,300.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	92,000	7.09	652,280.00	
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	73,500	87.10	6,401,850.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,800	47.40	180,120.00	

AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	12,000	12.38	148,560.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	18,000	8.20	147,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	27,000	13.74	370,980.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	62,000	2.95	182,900.00	
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	49,000	19.92	976,080.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	7.51	112,650.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	40,000	36.90	1,476,000.00	
CHINA VANKE CO LTD -H	22,100	26.55	586,755.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	6.97	292,740.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	99,000	9.60	950,400.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	12,500	9.67	120,875.00	
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	17,200	10.04	172,688.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	10,000	26.70	267,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	3.41	71,610.00	
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	12,500	13.02	162,750.00	
LOGAN GROUP COMPANY LIMITED	16,000	12.34	197,440.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	23,000	49.55	1,139,650.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	1,200	52.20	62,640.00	
SEAZEN GROUP LTD	32,000	9.19	294,080.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	42,000	2.94	123,480.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	13,500	23.05	311,175.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	33,000	31.55	1,041,150.00	
WHARF HOLDINGS LTD	17,000	23.40	397,800.00	
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	88,000	1.84	161,920.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	5.33	74,620.00	
CHINA YOUZAN LTD	172,000	2.76	474,720.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	30,000	26.45	793,500.00	
KINGSOFT CORPORATION LTD.	10,000	56.50	565,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	5,000	36.25	181,250.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	12,000	17.76	213,120.00	
WEIMOB INC	21,000	17.96	377,160.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	9,000	44.55	400,950.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	8,500	45.60	387,600.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	7,000	43.05	301,350.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	12,000	18.54	222,480.00	

	LENOVO GROUP LTD	88,000	11.16	982,080.00	
	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,800	197.10	1,734,480.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	175,800	27.05	4,755,390.00	
	ZTE CORPORATION	7,800	20.10	156,780.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	578,000	1.13	653,140.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	6,000	26.00	156,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	60,000	3.10	186,000.00	
	CGN POWER CO LTD-H	93,000	1.83	170,190.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	33,400	29.45	983,630.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	40,000	11.98	479,200.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.78	65,860.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	12,000	42.25	507,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	22,000	10.28	226,160.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,000	125.90	1,259,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	40,000	12.10	484,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	44,000	2.72	119,680.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	44,000	8.57	377,080.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	6,000	48.10	288,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	14.12	734,240.00	
	香港ドル 小計	10,089,584		171,620,525.00 (2,385,525,297)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	48,600	3.12	151,632.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,000	19.94	59,820.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	27,000	7.87	212,490.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	39,200	5.30	207,760.00	
	GAMUDA BHD	24,200	3.54	85,668.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	8.00	64,800.00	
	SIME DARBY BERHAD	23,500	2.30	54,050.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	5.97	87,759.00	
	MISC BHD	19,600	6.80	133,280.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	4.11	41,100.00	
	GENTING BHD	25,800	4.96	127,968.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	43,800	2.89	126,582.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	30.00	36,000.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	2,500	8.83	22,075.00	

	IOI CORPORATION BERHAD	31,800	4.04	128,472.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	5,000	21.74	108,700.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	900	135.00	121,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	9,040	18.68	168,867.20	
	QL RESOURCES BHD	13,050	6.05	78,952.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,900	4.41	105,399.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,100	10.78	249,018.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	27,500	5.48	150,700.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	15,000	4.35	65,250.00	
	SUPERMAX CORP BHD	16,968	5.95	100,959.60	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	64,400	5.73	369,012.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	17,000	3.04	51,680.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	76,400	4.19	320,116.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,600	17.90	118,140.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.82	31,958.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	51,000	8.26	421,260.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	183,900	4.17	766,863.00	
	RHB BANK BHD	16,400	5.26	86,264.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,600	3.82	124,532.00	
	DIGI.COM BHD	38,800	4.19	162,572.00	
	MAXIS BERHAD	26,800	4.68	125,424.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	5.80	92,800.00	
	PETRONAS GAS BHD	8,900	16.20	144,180.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	28,000	10.00	280,000.00	
	マレーシアリングット 小計	1,026,158		5,783,603.30 (152,048,617)	
タイパーツ	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	18,400	113.00	2,079,200.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	144,300	38.75	5,591,625.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	15,000	53.50	802,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	24,700	43.75	1,080,625.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	25,200	61.75	1,556,100.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	10,000	428.00	4,280,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	55,000	63.00	3,465,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	72,400	8.05	582,820.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	90,600	9.00	815,400.00	

ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	69,600	4.68	325,728.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	36,600	28.75	1,052,250.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,891	35.00	731,185.00	
HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	74,400	13.80	1,026,720.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	36,300	30.00	1,089,000.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	19,000	36.00	684,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	74,400	62.25	4,631,400.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	53,100	29.00	1,539,900.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	7,000	35.25	246,750.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	31,900	14.80	472,120.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	112,000	21.90	2,452,800.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	5,400	137.00	739,800.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,000	44.00	572,000.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	5,900	121.50	716,850.00	
KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	15,400	132.00	2,032,800.00	
KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	8,400	132.00	1,108,800.00	
KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	11.30	329,960.00	
SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	8,700	104.50	909,150.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,000	20.40	367,200.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,500	75.25	639,625.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	66.75	507,300.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	82.00	967,600.00	
CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	25,200	52.25	1,316,700.00	
LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	108,900	8.35	909,315.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	3,500	380.00	1,330,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	14,000	174.00	2,436,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	24,900	64.00	1,593,600.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	32.00	147,200.00	
TRUE CORPORATION PCL-NVDR	150,000	3.30	495,000.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	42.75	290,700.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	3,800	175.00	665,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	20,800	59.75	1,242,800.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	9,600	72.50	696,000.00	
GULF ENERGY DEVEROPMENT-NVDR	40,800	33.75	1,377,000.00	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	7,900	50.00	395,000.00	

タイパーツ 小計		1,543,491		56,290,523.00 (193,076,493)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	26,650	34.80	927,420.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	754.50	2,859,555.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	542.00	710,020.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	33,442	53.90	1,802,523.80	
	SM INVESTMENTS CORP	3,205	952.00	3,051,160.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,770	129.40	1,523,038.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	4,110	176.00	723,360.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	11,300	37.00	418,100.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,180	132.00	1,343,760.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	22,527	81.50	1,835,950.50	
	BDO UNIBANK INC	22,020	105.00	2,312,100.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	24,240	44.45	1,077,468.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	4.01	444,709.00	
	AYALA LAND INC	99,500	32.20	3,203,900.00	
	MEGAWORLD CORP	206,000	3.12	642,720.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	131,400	35.00	4,599,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	335	1,870.00	626,450.00	
	PLDT INC	1,255	1,272.00	1,596,360.00	
	ABOITIZ POWER CORP	12,000	22.75	273,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,340	275.00	643,500.00	
フィリピンペソ 小計		738,274		30,614,094.30 (68,263,307)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	1,200.00	139,080,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	19,300	21,600.00	416,880,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	128,000	2,320.00	296,960,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	364,200	930.00	338,706,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	29,700	9,175.00	272,497,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	12,800.00	168,960,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	109,900	2,270.00	249,473,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	43,500	10,400.00	452,400,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	255,600	5,625.00	1,437,750,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	83,400	7,575.00	631,755,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	21,200	8,875.00	188,150,000.00	

	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	36,050.00	144,200,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	51,300	6,750.00	346,275,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	104,500	6,075.00	634,837,500.00	
	KALBE FARMA PT	246,100	1,500.00	369,150,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	103,700	5,775.00	598,867,500.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	121,100	31,950.00	3,869,145,000.00	
	PT BANK MANDIRI	217,100	6,150.00	1,335,165,000.00	
	PT BANK RAKYAT	697,300	4,250.00	2,963,525,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	283,900	1,115.00	316,548,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	629,400	3,310.00	2,083,314,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	162,300	1,230.00	199,629,000.00	
	インドネシアルピア 小計	3,804,600		17,453,268,000.00 (130,899,510)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	628	42,250.00	26,533,000.00	
	S-OIL CORPORATION	553	78,000.00	43,134,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	682	270,000.00	184,140,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,476	49,700.00	73,357,200.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	1,044	51,500.00	53,766,000.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	97	439,000.00	42,583,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	227	278,000.00	63,106,000.00	
	LG CHEM LTD	570	874,000.00	498,180,000.00	
	LG CHEM LTD	89	392,000.00	34,888,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	207	293,500.00	60,754,500.00	
	POSCO	931	355,500.00	330,970,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	360	162,000.00	58,320,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	96	287,000.00	27,552,000.00	
	CJ CORP	168	95,900.00	16,111,200.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	415	29,050.00	12,055,750.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	664	44,300.00	29,415,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION	2,420	13,800.00	33,396,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	891	46,250.00	41,208,750.00	
	HANWHA CORPORATION	575	31,900.00	18,342,500.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	921	49,800.00	45,865,800.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	570	58,700.00	33,459,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	1,063	34,200.00	36,354,600.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	478	141,000.00	67,398,000.00	
LG CORP	1,226	114,500.00	140,377,000.00	
LOTTE CORPORATION	301	34,650.00	10,429,650.00	
SAMSUNG C&T CORPORATION	1,079	135,500.00	146,204,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,075	15,650.00	32,473,750.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	6,668	7,120.00	47,476,160.00	
SK HOLDINGS CO LTD	453	296,000.00	134,088,000.00	
S1 CORPORATION	219	81,500.00	17,848,500.00	
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	176,000.00	13,024,000.00	
GLOVIS CO LTD	234	187,000.00	43,758,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,845	26,200.00	48,339,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	2,212	7,000.00	15,484,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	963	51,600.00	49,690,800.00	
HANON SYSTEMS	2,380	17,100.00	40,698,000.00	
HYUNDAI MOBIS	836	290,500.00	242,858,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,861	221,000.00	411,281,000.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	419	105,000.00	43,995,000.00	
HYUNDAI MOTOR COMPANY	313	107,500.00	33,647,500.00	
KIA CORP	3,312	81,300.00	269,265,600.00	
COWAY CO LTD	538	67,000.00	36,046,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	620	45,950.00	28,489,000.00	
HLB INC	998	34,250.00	34,181,500.00	
LG ELECTRONICS INC	1,344	163,500.00	219,744,000.00	
KANGWON LAND INC	1,392	24,500.00	34,104,000.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	21,650.00	11,539,450.00	
KAKAO CORP	3,585	117,500.00	421,237,500.00	
NAVER CORPORATION	1,529	378,000.00	577,962,000.00	
NCSOFT CORP	208	849,000.00	176,592,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	211	140,000.00	29,540,000.00	
PEARLABYSS CORP	270	61,600.00	16,632,000.00	
CJ ENM CO LTD	144	145,300.00	20,923,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	83,500.00	33,984,500.00	
LOTTE SHOPPING CO LTD	172	122,000.00	20,984,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	63	275,000.00	17,325,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	61	156,500.00	9,546,500.00	

E-MART INC	237	168,000.00	39,816,000.00	
GS RETAIL CO LTD	290	36,500.00	10,585,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	85	410,500.00	34,892,500.00	
KT&G CORPORATION	1,356	82,900.00	112,412,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	243	119,500.00	29,038,500.00	
OTTOGI CORPORATION	25	561,000.00	14,025,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	419	263,500.00	110,406,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	240	67,600.00	16,224,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	119	1,598,000.00	190,162,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	704,000.00	11,968,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	817	123,100.00	100,572,700.00	
ALTEOGEN INC	312	88,100.00	27,487,200.00	
CELLTRION INC	1,203	288,000.00	346,464,000.00	
CELLTRION PHARM INC	173	147,500.00	25,517,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	367,500.00	31,972,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	211	812,000.00	171,332,000.00	
SEEGENE INC	408	107,500.00	43,860,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	334	99,900.00	33,366,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	383	118,500.00	45,385,500.00	
YUHAN CORPORATION	502	67,200.00	33,734,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP INC.	3,688	42,900.00	158,215,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,644	9,300.00	24,589,200.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,853	54,300.00	263,517,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	5,393	37,450.00	201,967,850.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,654	10,500.00	69,867,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	576	108,000.00	62,208,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	4,705.00	7,433,900.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	2,873	9,970.00	28,643,810.00	
SAMSUNG CARD CO LTD	310	34,400.00	10,664,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	639	42,350.00	27,061,650.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	12,250.00	9,163,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	507	47,650.00	24,158,550.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	648	25,150.00	16,297,200.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	378	196,000.00	74,088,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	781	82,400.00	64,354,400.00	

	DUZONBIZON CO LTD	190	87,100.00	16,549,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	428	193,000.00	82,604,000.00	
	KMW CO LTD	241	61,000.00	14,701,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,101	27,050.00	83,882,050.00	
	LG INNOTEK CO LTD	158	212,500.00	33,575,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	688	193,000.00	132,784,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	58,680	82,800.00	4,858,704,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,187	75,200.00	766,062,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	684	670,000.00	458,280,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,103	13,250.00	41,114,750.00	
	SK TELECOM CO LTD	461	314,500.00	144,984,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	3,402	24,050.00	81,818,100.00	
	KOREA GAS CORPORATION	265	33,100.00	8,771,500.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	6,746	132,500.00	893,845,000.00	
	韓国ウォン 小計	181,737		15,349,787,370.00 (1,487,394,396)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	102.50	1,435,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	22,000	50.20	1,104,400.00	
	CHINA STEEL CORP	151,000	38.10	5,753,100.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	41,000	92.80	3,804,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	47,000	107.00	5,029,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	63,000	90.00	5,670,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	60,077	53.00	3,184,081.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	1,080.00	2,160,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	35,000	32.55	1,139,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,121	416.50	1,299,896.50	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	33,740	69.90	2,358,426.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	29,000	31.20	904,800.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	21,000	56.30	1,182,300.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	2,000	545.00	1,090,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,640	205.00	951,200.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	3,000	360.00	1,080,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	447.50	895,000.00	
	POU CHEN	26,000	35.00	910,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	594.00	2,376,000.00	

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	273.50	2,188,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	61,000	75.60	4,611,600.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	218.50	655,500.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	65,103	18.00	1,171,854.00	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	216,000	22.80	4,924,800.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	130,860	26.80	3,507,048.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	120,408	22.75	2,739,282.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	103,133	19.45	2,005,936.85	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	134,000	32.25	4,321,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	124,760	13.30	1,659,308.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	120,485	13.95	1,680,765.75	
TAIWAN BUSINESS BANK	68,502	10.05	688,445.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	114,594	21.40	2,452,311.60	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	41,299	43.00	1,775,857.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	14,632	204.00	2,984,928.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	114,160	25.90	2,956,744.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	97,000	50.90	4,937,300.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	156,000	12.30	1,918,800.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,832	25.80	589,065.60	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	82,000	61.30	5,026,600.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	113,432	10.00	1,134,320.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	45.35	299,310.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,700	53.20	462,840.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	291.50	1,749,000.00	
ACER INC	34,000	34.50	1,173,000.00	
ADVANTECH CO LTD	4,299	351.00	1,508,949.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	378.00	3,024,000.00	
AU OPTRONICS CORP	107,000	28.85	3,086,950.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	201.50	1,813,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	7,010	85.80	601,458.00	
COMPAL ELECTRONICS	53,000	24.80	1,314,400.00	
DELTA ELECTRONICS INC	24,000	297.00	7,128,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	11,000	69.60	765,600.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	154,800	119.00	18,421,200.00	
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	95,000	27.75	2,636,250.00	

INVENTEC CORPORATION	24,000	27.10	650,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,080	3,100.00	3,348,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	24,000	64.10	1,538,400.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	8,000	175.00	1,400,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	3,000	324.50	973,500.00	
PEGATRON CORP	22,000	73.90	1,625,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	97.60	3,611,200.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	16,000	55.30	884,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	13,000	94.20	1,224,600.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	4,000	244.00	976,000.00	
WISTRON CORPORATION	35,293	32.45	1,145,257.85	
WIWYNN CORP	1,000	890.00	890,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	15,520	49.50	768,240.00	
YAGEO CORPORATION	5,198	554.00	2,879,692.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	7,000	104.00	728,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	48,000	114.00	5,472,000.00	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	22,000	66.60	1,465,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	22,000	101.00	2,222,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	111.00	4,551,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,090.00	545,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	840.00	2,520,000.00	
MEDIATEK INCORPORATION	19,000	1,035.00	19,665,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	14,000	94.40	1,321,600.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	7,000	614.00	4,298,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	561.00	1,122,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	111.50	1,115,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	519.00	3,114,000.00	
SILERGY CORP	1,000	2,785.00	2,785,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	303,000	602.00	182,406,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	148,000	57.00	8,436,000.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	10,000	116.50	1,165,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	372.00	1,488,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	33,000	35.65	1,176,450.00	
新台湾ドル 小計	3,912,778		407,752,816.25 (1,565,444,612)	

インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,256	423.05	3,069,650.80	
	COAL INDIA LTD	12,603	126.15	1,589,868.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,413	233.70	1,732,418.10	
	INDIAN OIL CORP LTD	19,253	88.05	1,695,226.65	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	34,064	102.40	3,488,153.60	
	PETRONET LNG LTD	8,894	235.20	2,091,868.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	35,220	1,904.35	67,071,207.00	
	ACC LIMITED	1,019	1,812.90	1,847,345.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	6,833	295.20	2,017,101.60	
	ASIAN PAINTS LTD	4,713	2,517.95	11,867,098.35	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,709	709.70	1,922,577.30	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,391	1,278.10	4,334,037.10	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	18,891	349.50	6,602,404.50	
	JSW STEEL LTD	9,521	635.40	6,049,643.40	
	PI INDUSTRIES LTD	1,067	2,522.55	2,691,560.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,701	1,783.90	3,034,413.90	
	SHREE CEMENT LTD	121	28,106.30	3,400,862.30	
	TATA STEEL LTD	8,303	925.60	7,685,256.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,418	6,067.90	8,604,282.20	
	UPL LTD	5,579	585.40	3,265,946.60	
	VEDANTA LTD	20,944	228.00	4,775,232.00	
	HAVELLS INDIA LTD	3,011	1,005.50	3,027,560.50	
	LARSEN & TOUBRO LTD	8,702	1,322.90	11,511,875.80	
	SIEMENS LTD	617	1,799.95	1,110,569.15	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	5,667	725.35	4,110,558.45	
	CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	3,801	549.45	2,088,459.45	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	1,271	1,541.85	1,959,691.35	
	BAJAJ AUTO LTD	949	3,672.50	3,485,202.50	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	971	1,694.85	1,645,699.35	
	BHARAT FORGE LTD	3,465	582.35	2,017,842.75	
	EICHER MOTORS LTD	1,826	2,317.30	4,231,389.80	
	HERO MOTOCORP LTD	1,337	2,864.05	3,829,234.85	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,365	777.90	8,062,933.50	
	MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	1,724	6,676.10	11,509,596.40	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	14,091	213.60	3,009,837.60	

MRF LTD	21	78,214.15	1,642,497.15	
TATA MOTORS LTD	21,998	294.00	6,467,412.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	82	29,127.40	2,388,446.80	
TITAN CO LTD	4,625	1,461.45	6,759,206.25	
JUBILANT FOODWORKS LTD	883	2,844.65	2,511,825.95	
INFO EDGE INDIA LTD	789	4,876.30	3,847,400.70	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	8,839	188.00	1,661,732.00	
TRENT LTD	2,023	770.30	1,558,316.90	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,936	2,713.70	5,253,723.20	
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	1,293	3,650.30	4,719,837.90	
ITC LIMITED	34,508	205.35	7,086,217.80	
NESTLE INDIA LTD	394	16,625.70	6,550,525.80	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	6,683	664.60	4,441,521.80	
UNITED SPIRITS LTD	2,972	522.15	1,551,829.80	
COLGATE PALMOLIVE INDIA	1,365	1,514.10	2,066,746.50	
DABUR INDIA LIMITED	7,252	559.95	4,060,757.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,564	698.70	3,887,566.80	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	10,276	2,307.75	23,714,439.00	
MARICO LTD	6,577	411.60	2,707,093.20	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,138	3,200.05	3,641,656.90	
AUROBINDO PHARMA LIMITED	3,611	993.35	3,586,986.85	
BIOCON LTD	4,686	397.60	1,863,153.60	
CIPLA LTD	4,948	935.60	4,629,348.80	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,566	3,779.75	5,919,088.50	
DR.REDDY'S LABORATORIES	1,514	5,066.70	7,670,983.80	
IPCA LABORATORIES LTD	918	2,101.35	1,929,039.30	
LUPIN LTD	3,151	1,076.25	3,391,263.75	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	10,932	637.95	6,974,069.40	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	502	2,531.95	1,271,038.90	
AXIS BANK LIMITED	27,821	671.35	18,677,628.35	
BANDHAN BANK LTD	10,002	313.45	3,135,126.90	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	20,992	2,497.35	52,424,371.20	
ICICI BANK LIMITED	62,721	569.95	35,747,833.95	
KOTAK MAHINDRA BANK LIMITED	7,008	1,734.20	12,153,273.60	
STATE BANK OF INDIA	22,850	336.45	7,687,882.50	

	YES BANK LTD	111,806	14.00	1,565,284.00	
	BAJAJ FINANCE LIMITED	3,331	4,667.80	15,548,441.80	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	522	2,822.40	1,473,292.80	
	MUTHOOT FINANCE LTD	1,343	1,200.85	1,612,741.55	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,440	1,647.25	2,372,040.00	
	REC LTD	9,915	126.35	1,252,760.25	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,117	1,380.65	2,922,836.05	
	BAJAJ FINSERV LTD	469	9,916.65	4,650,908.85	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	9,928	686.35	6,814,082.80	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	2,989	1,381.20	4,128,406.80	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,524	512.40	1,805,697.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	5,346	922.85	4,933,556.10	
	DLF LIMITED	8,519	241.95	2,061,172.05	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	13,334	955.65	12,742,637.10	
	INFOSYS LIMITED	42,028	1,333.80	56,056,946.40	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	584	3,901.05	2,278,213.20	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	11,524	3,109.50	35,833,878.00	
	TECH MAHINDRA LTD	8,114	950.20	7,709,922.80	
	WIPRO LTD	14,042	475.70	6,679,779.40	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	30,807	522.60	16,099,738.20	
	INDUS TOWERS LIMITED	9,651	252.25	2,434,464.75	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,136	1,052.40	5,405,126.40	
	GAIL INDIA LIMITED	20,678	129.40	2,675,733.20	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,121	509.90	2,101,297.90	
	NTPC LTD	58,180	102.55	5,966,359.00	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	24,700	211.15	5,215,405.00	
	インドルピー 小計	975,298		686,357,172.10 (995,217,899)	
エジプトポンド	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	7.99	43,585.45	
	EASTERN TOBACCO	17,997	11.60	208,765.20	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	16,612	58.51	971,968.12	
	エジプトポンド 小計	40,064		1,224,318.77 (8,415,599)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	3,530	174.04	614,361.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,503	280.42	421,471.26	

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	652	2,072.74	1,351,426.48
ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	4,675	308.86	1,443,920.50
GOLD FIELDS LIMITED	11,457	141.87	1,625,404.59
HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,114	68.73	420,215.22
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	9,909	285.56	2,829,614.04
KUMBA IRON ORE LTD	836	665.44	556,307.84
NORTHAM PLATINUM LTD	4,014	269.02	1,079,846.28
SASOL LTD.	7,312	239.30	1,749,761.60
SIBANYE STILLWATER LTD	35,175	69.28	2,436,924.00
BIDVEST GROUP LTD	3,606	168.44	607,394.64
MULTICHOICE GROUP LTD	6,059	123.85	750,407.15
MR PRICE GROUP LTD	3,242	186.33	604,081.86
NASPERS LIMITED-N SHS	5,371	3,422.17	18,380,475.07
WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	12,822	51.25	657,127.50
BID CORP LTD	4,394	293.66	1,290,342.04
CLICKS GROUP LTD	2,773	239.77	664,882.21
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	6,090	145.92	888,652.80
SPAR GROUP LIMITED	1,720	187.46	322,431.20
TIGER BRANDS LTD	1,629	199.90	325,637.10
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	4,363	147.71	644,458.73
ABSA GROUP LTD	8,051	123.50	994,298.50
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	822	1,399.06	1,150,027.32
NEDBANK GROUP LTD	4,692	145.54	682,873.68
STANDARD BANK GROUP LIMITED	16,484	116.87	1,926,485.08
FIRSTRAND LIMITED	60,088	50.50	3,034,444.00
REINET INVESTMENTS SCA	1,681	275.76	463,552.56
REMGRO LTD	6,563	109.88	721,142.44
DISCOVERY LTD	4,482	130.75	586,021.50
OLD MUTUAL LTD	52,788	12.94	683,076.72
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	9,457	29.30	277,090.10
SANLAM LTD	20,975	54.96	1,152,786.00
NEPI ROCKCASTLE PLC	5,844	98.34	574,698.96
MTN GROUP LIMITED	21,887	91.79	2,009,007.73
VODACOM GROUP LIMITED	6,997	124.97	874,415.09
	358,057		54,795,062.99

南アフリカランド 小計			(414,250,676)	
合 計	26,927,780		9,586,932,925 (9,586,932,925)	

（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 45銘柄	9.1%	13.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	1.1%	1.7%
ブラジルレアル	株式 47銘柄	3.3%	5.0%
チリペソ	株式 14銘柄	0.4%	0.6%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	0.1%	0.1%
トルコリラ	株式 14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	0.1%	0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	0.5%	0.7%
香港ドル	株式 200銘柄	16.4%	24.9%
マレーシアリングット	株式 38銘柄	1.0%	1.6%
タイバーツ	株式 44銘柄	1.3%	2.0%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	0.5%	0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	0.9%	1.4%
韓国ウォン	株式 106銘柄	10.2%	15.5%
新台湾ドル	株式 87銘柄	10.8%	16.3%
インドルピー	株式 96銘柄	6.8%	10.4%
エジプトポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
南アフリカランド	株式 36銘柄	2.8%	4.3%

(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	571,200	29,919,456.00	
	中国元（オフショア） 小計		571,200	29,919,456.00 (497,674,247)	
				497,674,247	

投資信託受益証券合計				(497,674,247)		
投資証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	554	16,536.90		
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	17,866	544,618.21		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	36,826	721,053.08		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	78,188	3,150,194.52		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	76,985	2,847,675.15		
		ISHARES MSCI UAE ETF	44,583	603,600.32		
	米ドル 小計		255,002	7,883,678.18	(850,570,038)	
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	36,300	907,137.00		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	24,600	3,950,022.00		
		GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	27,300	1,385,748.00		
	メキシコペソ 小計		88,200	6,242,907.00	(33,963,911)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,200	318,720.00		
		BANCO INTER SA-UNITS	1,400	281,540.00		
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,200	160,860.00		
		ENERGISA SA-UNITS	1,800	79,182.00		
		KLABIN SA-UNIT	8,800	255,728.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	3,240	107,794.80		
	ブラジルリアル 小計		22,640	1,203,824.80	(23,714,265)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,751	606,209.18		
	南アフリカランド 小計		42,751	606,209.18	(4,582,941)	
	投資証券合計				912,831,155	(912,831,155)
	合計				1,410,505,402	(1,410,505,402)

（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	—	5.8%	60.3%

メキシコペソ	投資証券	3銘柄	—	0.2%	2.4%
ブラジルリアル	投資証券	6銘柄	—	0.2%	1.7%
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	3.4%	—	35.3%

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	29,223,710	29,114,056
コール・ローン	29,959,559	66,809,626
投資証券	3,952,989,000	8,029,616,750
派生商品評価勘定	-	4,736,400
未収入金	102,225	2,631,744
未収配当金	45,102,963	58,652,103
前払金	14,135,500	-
差入委託証拠金	15,120,000	3,330,000
流動資産合計	4,086,632,957	8,194,890,679
資産合計	4,086,632,957	8,194,890,679
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,148,700	-
前受金	-	4,743,000
未払解約金	2,285,580	68,058,794
未払利息	86	193
その他未払費用	10,403	2,229
流動負債合計	16,444,769	72,804,216
負債合計	16,444,769	72,804,216
純資産の部		
元本等		
元本	2,079,734,759	3,071,522,148
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,990,453,429	5,050,564,315
元本等合計	4,070,188,188	8,122,086,463
純資産合計	4,070,188,188	8,122,086,463
負債純資産合計	4,086,632,957	8,194,890,679

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,079,734,759口	3,071,522,148口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9571円 (10,000口当たりの純資産額 19,571円)	1口当たり純資産額 2.6443円 (10,000口当たりの純資産額 26,443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 4月28日 至 2021年 4月26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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	108,768,700	-	94,620,000	△14,148,700
	東証ＲＥＩＴ指数 先物	108,768,700	-	94,620,000	△14,148,700
合計		108,768,700	-	94,620,000	△14,148,700

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	56,628,600	-	61,365,000	4,736,400
	東証ＲＥＩＴ指数 先物	56,628,600	-	61,365,000	4,736,400
合計		56,628,600	-	61,365,000	4,736,400

(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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27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	5,748,282,368円
同期中における追加設定元本額	2,292,676,609円
同期中における一部解約元本額	5,961,224,218円
2020年 4月27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）	152,382,989円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	310,073,497円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	261,721,272円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,177,332,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	5,392,698円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	25,359,901円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	17,271,591円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	48,367,096円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	24,397,339円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	20,133,135円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	10,128,064円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,159,286円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	383,164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＞	5,389,396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＞	4,214,611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＞	6,211,193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＞	9,816,906円
合計	2,079,734,759円

(2021年 4月26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	2,079,734,759円
同期中における追加設定元本額	2,566,048,223円
同期中における一部解約元本額	1,574,260,834円
2021年 4月26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）	316,132,317円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	348,559,330円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	238,816,451円
イオン・バランス戦略ファンド	84,560,850円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,588,375,824円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	9,834,653円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	35,461,155円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	25,278,674円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	80,153,697円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	41,281,247円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	33,683,493円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,113,869円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,448,736円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	20,024,548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＞	50,433,479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＞	31,132,085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＞	82,301,805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＞	68,929,935円
合計	3,071,522,148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	118	15,163,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	179	20,996,700	
	S O S i L A物流リート投資法人	191	27,408,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	251	163,401,000	
	森ヒルズリート投資法人	852	134,616,000	
	産業ファンド投資法人	1,024	202,547,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	689	239,083,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	495	109,791,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	363	179,685,000	
	G L P投資法人	2,264	412,727,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	325	112,612,500	
	日本プロロジスリート投資法人	1,146	400,527,000	
	星野リゾート・リート投資法人	111	71,817,000	
	O n e リート投資法人	113	34,691,000	
	イオンリート投資法人	737	110,697,400	
	ヒューリックリート投資法人	599	103,327,500	
	日本リート投資法人	236	100,300,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,672	96,944,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,130	197,664,000	
	トーセイ・リート投資法人	160	22,256,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	288	78,710,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	154	21,098,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	137	15,987,900	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,343	401,121,600	
	いちごホテルリート投資法人	125	10,525,000	
	ラサールロジポート投資法人	835	147,461,000	
	スターアジア不動産投資法人	745	41,422,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	69	8,887,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	254	143,764,000	
	大江戸温泉リート投資法人	115	9,315,000	
	投資法人みらい	779	38,911,050	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	157	20,912,400	
	三菱地所物流リート投資法人	182	81,172,000	
	C R Eロジスティクスファンド投資法人	231	41,441,400	
	ザイマックス・リート投資法人	110	12,496,000	

タカラレーベン不動産投資法人	219	25,228,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	281	38,974,700	
日本ビルファンド投資法人	816	580,176,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	725	490,825,000	
日本都市ファンド投資法人	3,609	382,914,900	
オリックス不動産投資法人	1,444	274,504,400	
日本プライムリアルティ投資法人	451	197,087,000	
N T T都市開発リート投資法人	654	110,002,800	
東急リアル・エステート投資法人	488	89,548,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	506	63,806,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,550	252,030,000	
森トラスト総合リート投資法人	520	80,392,000	
インヴィンシブル投資法人	3,037	120,872,600	
フロンティア不動産投資法人	241	112,788,000	
平和不動産リート投資法人	443	70,569,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	474	151,680,000	
福岡リート投資法人	376	66,213,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	225	182,925,000	
いちごオフィスリート投資法人	601	58,717,700	
大和証券オフィス投資法人	155	122,295,000	
阪急阪神リート投資法人	326	49,715,000	
スターツプロシード投資法人	113	26,035,200	
大和ハウスリート投資法人	1,034	302,341,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,331	144,755,100	
大和証券リビング投資法人	945	104,233,500	
ジャパンエクセレント投資法人	674	101,504,400	
合計	45,417	8,029,616,750	

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	51,118,215	44,482,747
金銭信託	3,963,979	28,588,674
コール・ローン	4,063,792	65,604,005
投資証券	5,478,909,884	11,519,480,828
派生商品評価勘定	5,199	17,814
未収入金	2,163	57,714,478
未収配当金	5,165,802	11,685,275
流動資産合計	5,543,229,034	11,727,573,821
資産合計	5,543,229,034	11,727,573,821
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,197	49,052
未払金	5,641,591	-
未払解約金	-	142,622,000
未払利息	11	189
その他未払費用	1,101	547
流動負債合計	5,647,900	142,671,788
負債合計	5,647,900	142,671,788
純資産の部		
元本等		
元本	3,351,152,062	4,897,225,610
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,186,429,072	6,687,676,423
元本等合計	5,537,581,134	11,584,902,033
純資産合計	5,537,581,134	11,584,902,033
負債純資産合計	5,543,229,034	11,727,573,821

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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

法	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 4月27日現在）	（2021年 4月26日現在）
１． 当計算期間の末日における受益権の総数	3,351,152,062口	4,897,225,610口
２． １単位当たり純資産の額	１口当たり純資産額 1.6524円 (10,000口当たりの純資産額 16,524円)	１口当たり純資産額 2.3656円 (10,000口当たりの純資産額 23,656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 4月28日 至 2021年 4月26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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち１年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	5,500,000	-	5,500,602	602
	米ドル	4,500,000	-	4,495,403	△4,597
	ユーロ	500,000	-	501,768	1,768
	オーストラリアドル	500,000	-	503,431	3,431
	売建	2,430,180	-	2,430,780	△600
	カナダドル	610,080	-	610,080	-
	英ポンド	1,064,400	-	1,064,800	△400
	シンガポールドル	755,700	-	755,900	△200
合計		7,930,180	-	7,931,382	2

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち１年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	4,300,000	-	4,299,779	△221
	米ドル	2,500,000	-	2,499,953	△47
	ユーロ	500,000	-	499,985	△15
	英ポンド	500,000	-	499,947	△53
	オーストラリアドル	800,000	-	799,894	△106
	売建	51,623,281	-	51,654,298	△31,017
	米ドル	37,991,360	-	37,976,928	14,432
	カナダドル	949,850	-	952,152	△2,302
	ユーロ	2,205,070	-	2,219,378	△14,308
	英ポンド	2,839,151	-	2,846,004	△6,853

オーストラリアドル	3,410,872	-	3,431,290	△20,418
ニュージーランドドル	1,245,808	-	1,243,028	2,780
香港ドル	1,196,002	-	1,195,400	602
シンガポールドル	1,785,168	-	1,790,118	△4,950
合計	55,923,281	-	55,954,077	△31,238

（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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27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	2,475,122,234円
同期中における追加設定元本額	2,273,912,402円
同期中における一部解約元本額	1,397,882,574円
2020年 4月27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）	37,376,988円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	37,514,775円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	28,930,639円

三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,048,076,760円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	2,560,043円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	27,304,661円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	18,240,993円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	55,898,575円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	27,687,998円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	22,576,318円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	35,818,994円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	450,246円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	449,158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＞	2,818,172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＞	5,447,742円
合計	3,351,152,062円

(2021年 4月26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	3,351,152,062円
同期中における追加設定元本額	2,408,226,049円
同期中における一部解約元本額	862,152,501円
2021年 4月26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）	36,052,341円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	44,692,972円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	29,319,643円
イオン・バランス戦略ファンド	44,687,417円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	4,353,843,871円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	3,924,728円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	40,667,543円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	28,606,664円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	90,223,455円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	46,713,633円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	37,645,676円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	51,093,218円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	583,824円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	17,098,546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＞	46,391,095円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	25,680,984円
合計	4,897,225,610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	6,133	128,363.69	
		AGREE REALTY CORP	4,936	350,998.96	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	5,532	98,303.64	
		ALEXANDER'S INC	136	37,991.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	9,574	1,717,096.90	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,856	132,415.04	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	10,006	457,474.32	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,155	99,214.35	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	19,922	710,418.52	
		AMERICOLD REALTY TRUST	19,430	762,821.80	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	11,143	511,575.13	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	9,715	64,799.05	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,879	227,202.33	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,848	65,884.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,587	2,052,607.56	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	5,778.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,768	1,141,946.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	13,383	176,923.26	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,772	472,452.40	
		BROADSTONE NET LEASE INC	2,372	46,396.32	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	3,309	59,231.10	
		BRT APARTMENTS CORP	500	8,995.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,318	868,719.78	
		CARETRUST REIT INC	6,670	162,681.30	

CENTERSPACE	1,026	73,543.68	
CHATHAM LODGING TRUST	4,019	54,296.69	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	50,863.15	
CLIPPER REALTY INC	800	6,568.00	
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	36,813	254,377.83	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	8,351	150,150.98	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,483	76,448.65	
COREPOINT LODGING INC	4,226	40,865.42	
CORESITE REALTY CORPORATION	3,078	386,227.44	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	8,127	227,149.65	
COUSINS PROPERTIES INC	11,001	398,016.18	
CTO REALTY GROWTH INC	310	16,141.70	
CUBESMART	14,994	630,197.82	
CYRUSONE INC	8,925	663,038.25	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	16,010	161,701.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	21,113	3,146,681.52	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	16,755	74,057.10	
DOUGLAS EMMETT INC	12,552	414,592.56	
DUKE REALTY CORP	28,151	1,277,210.87	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	7,057	151,796.07	
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,002	465,099.86	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	10,409	114,499.00	
EPR PROPERTIES	6,064	289,131.52	
EQUINIX INC	6,723	4,827,853.53	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	8,994	255,069.84	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	12,788	876,873.16	
EQUITY RESIDENTIAL	25,464	1,899,105.12	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	8,801	229,530.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,885	1,452,505.90	
EXTRA SPACE STORAGE INC	9,964	1,470,088.56	
FARMLAND PARTNERS INC	1,217	16,405.16	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	5,233	574,740.39	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	9,994	487,107.56	

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,235	153,699.60	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	6,015	33,082.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	16,465	756,402.10	
GEO GROUP INC	9,546	56,416.86	
GETTY REALTY CORPORATION	3,220	99,465.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,102	64,304.46	
GLADSTONE LAND CORP	1,730	36,572.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,403	63,623.35	
GLOBAL NET LEASE INC	6,857	130,351.57	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	10,873	349,023.30	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	16,198	467,312.30	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,238	1,367,689.62	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876	30,111.72	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,786	334,798.00	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	53,394	923,182.26	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	11,456	314,008.96	
INDEPENDENCE REALTY TRUST	7,584	126,652.80	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	4,808	117,988.32	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,827	332,440.92	
INVITATION HOMES INC	42,748	1,450,867.12	
IRON MOUNTAIN INC	21,490	866,476.80	
JBG SMITH PROPERTIES	8,057	259,193.69	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	54,000	39,690.00	
KILROY REALTY CORP	7,752	519,616.56	
KIMCO REALTY CORPORATION	32,263	657,197.31	
KITE REALTY GROUP TRUST	7,036	144,519.44	
LEXINGTON REALTY TRUST	19,964	238,969.08	
LIFE STORAGE INC	5,527	524,235.95	
LTC PROPERTIES INC	2,847	122,250.18	
MACERICH COMPANY/THE	9,580	124,348.40	
MACK-CALI REALTY CORPORATION	5,757	92,630.13	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	121,700	88,841.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	42,948	972,342.72	

MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	8,652	1,342,703.88	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	7,136	130,731.52	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	3,379	245,619.51	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,181	622,011.39	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,465	200,657.10	
NETSTREIT CORP	2,801	58,512.89	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,922	39,262.86	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	1,760	88,827.20	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	3,872	106,751.04	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	17,778	673,608.42	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,014	24,863.28	
PARAMOUNT GROUP INC	11,445	116,281.20	
PARK HOTELS AND RESORTS INC	17,591	385,594.72	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10,153	249,256.15	
PHYSICIANS REALTY TRUST	16,350	307,543.50	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	9,036	163,461.24	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,781	31,666.18	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	30,334.00	
PRIME US REIT	54,200	45,528.00	
PROLOGIS INC	55,672	6,395,042.64	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,568	256,901.12	
PUBLIC STORAGE	11,470	3,174,551.90	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,755	315,827.10	
REALTY INCOME CORPORATION	27,973	1,941,326.20	
REGENCY CENTERS CORP	11,708	727,300.96	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	9,864	173,409.12	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	17,002	197,223.20	
RETAIL VALUE INC	655	12,883.85	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	9,544	527,115.12	
RLJ LODGING TRUST	12,486	196,404.78	
RPT REALTY	6,346	80,149.98	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,011	304,595.34	

SABRA HEALTH CARE REIT	15,826	282,968.88	
SAFEHOLD INC	1,242	83,201.58	
SAUL CENTERS INC	703	29,097.17	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468	63,325.68	
SERVICE PROPERTIES TRUST	12,534	150,784.02	
SIMON PROPERTY GROUP INC	24,472	2,861,266.24	
SITE CENTERS CORP	12,194	182,544.18	
SL GREEN REALTY CORP	5,137	366,011.25	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	8,476	389,811.24	
STAG INDUSTRIAL INC	12,052	437,126.04	
STORE CAPITAL CORP	18,293	653,608.89	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	6,976	69,550.72	
SUN COMMUNITIES INC	8,397	1,353,092.58	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	15,464	195,774.24	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS,INC	5,911	100,368.78	
TERRENO REALTY CORP	4,856	307,627.60	
UDR INC	22,389	1,047,357.42	
UMH PROPERTIES INC	2,728	58,542.88	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	775	53,475.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	8,922	163,272.60	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	52,978.70	
VENTAS INC	28,379	1,554,317.83	
VEREIT INC	16,997	712,344.27	
VICI PROPERTIES INC	39,957	1,230,675.60	
VORNADO REALTY TRUST	11,474	514,264.68	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	682	1,452.66	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,882	134,286.06	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	9,693	303,778.62	
WELLTOWER INC	31,480	2,374,851.20	
WHITESTONE REIT	4,511	44,027.36	
WP CAREY INC	13,151	965,020.38	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	8,231	153,261.22	

米ドル 小計		1,876,407	79,489,280.99 (8,576,098,526)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	4,531	185,997.55	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337	57,639.60	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	869	10,071.71	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,000	74,380.00	
	CAN APARTMENT PROP	6,660	368,298.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	12,026	170,528.68	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	6,216	60,543.84	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,613	42,670.29	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	52,864.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	5,837	79,499.94	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,905	61,295.50	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	7,380	128,781.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,243	176,591.39	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,212	166,273.96	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,450	69,420.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,469	66,708.87	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	914	20,245.10	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	24,304.77	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,085	92,742.65	
	PLAZA RETAIL REIT	3,747	14,725.71	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,532	236,636.64	
	SLATE GROCERY REIT	500	6,080.00	
	SLATE OFFICE REIT	3,663	16,080.57	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	5,277	148,178.16	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,456	103,877.04	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	6,603	46,551.15	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	3,417	71,962.02	
		131,699	2,552,948.14	

カナダドル 小計			(220,983,190)	
ユーロ	AEDIFICA	2,494	256,632.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	13,175	190,774.00	
	ALTAREA	280	46,424.00	
	BEFIMMO SCA	2,074	73,212.20	
	CARE PROPERTY INVEST	2,315	58,453.75	
	CARMILA	3,073	41,731.34	
	COFINIMMO	2,117	270,976.00	
	COVIVIO	3,674	278,489.20	
	CROMWELL EUROPEAN REIT	76,600	36,385.00	
	EUROCOMMERCIAL	2,557	52,418.50	
	GECINA SA	4,115	495,240.25	
	HAMBORNER REIT AG	5,713	53,188.03	
	HIBERNIA REIT PLC	40,242	47,324.59	
	ICADE	2,374	152,292.10	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	13,223.04	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	18,812	155,857.42	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	2,057	45,254.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432	63,105.34	
	KLEPIERRE	15,135	313,899.90	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	4,421	23,387.09	
	MERCIALYS	2,280	23,552.40	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	24,871	223,988.22	
	MONTEA	842	77,548.20	
	NSI NV	1,336	45,758.00	
	RETAIL ESTATES	638	38,662.80	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	10,486	698,472.46	
	VASTNED RETAIL	1,421	34,672.40	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,853	294,407.64	
	WERELDHAVE NV	3,304	46,751.60	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,187	54,958.10	
ユーロ 小計		299,286	4,207,040.17	
			(549,229,094)	
英ポンド	AEW UK REIT PLC	9,000	8,361.00	

ASSURA PLC	192,407	142,188.77
BIG YELLOW GROUP PLC	12,633	152,732.97
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210	50,188.74
BRITISH LAND CO PLC	70,201	358,025.10
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	64,631	116,012.64
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	42,625	48,251.50
CUSTODIAN REIT PLC	27,002	26,353.95
DERWENT LONDON PLC	8,287	279,769.12
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	49,102	42,669.63
GCP STUDENT LIVING PLC	31,176	52,625.08
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	19,544	135,928.52
HAMMERSON PLC	301,207	114,368.29
HOME REIT PLC	17,550	20,007.00
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	23,000	26,220.00
INTU PROPERTIES PLC	28,500	285.00
LAND SECURITIES GROUP PLC	56,546	402,381.33
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	65,725	148,801.40
LXI REIT PLC	36,635	48,138.39
NEWRIVER REIT PLC	17,642	17,924.27
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141	51,884.02
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	99,269	149,102.03
RDI REIT PLC	32,563	39,401.23
REGIONAL REIT LTD	45,664	37,672.80
SAFESTORE HOLDINGS PLC	15,455	131,212.95
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	6,337.50
SEGRO PLC	89,084	887,276.64
SHAFTESBURY PLC	23,307	146,367.96
STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280	35,004.96
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	53,099	60,532.86
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770	35,882.64
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121,677	229,482.82
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	58,562	44,741.36
UNITE GROUP PLC	30,847	353,198.15
WORKSPACE GROUP PLC	9,219	73,613.71
	1,875,560	4,472,944.33

英ポンド 小計			(670,002,331)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	23,209	68,002.37	
	APN INDUSTRIA REIT	13,221	40,324.05	
	ARENA REIT	28,622	91,304.18	
	AVENTUS GROUP	25,000	70,750.00	
	BWP TRUST	34,253	140,437.30	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	46,643	127,335.39	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,528	139,011.04	
	CENTURIA OFFICE REIT	24,034	50,231.06	
	CHARTER HALL GROUP	34,432	481,359.36	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	36,546	179,440.86	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	42,995	161,661.20	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	33,955	107,976.90	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718	138,878.25	
	DEXUS	79,907	800,668.14	
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	19,170.00	
	GOODMAN GROUP	126,807	2,444,838.96	
	GPT GROUP	145,221	672,373.23	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	15,930	56,710.80	
	HOME CONSORTIUM	10,000	48,700.00	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	40,492	52,234.68	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	15,921	49,036.68	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	21,419	113,092.32	
	IRONGATE GROUP	42,404	57,033.38	
	MIRVAC GROUP	299,202	774,933.18	
	NATIONAL STORAGE REIT	80,507	165,039.35	
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	23,800.00	
	SCENTRE GROUP	388,778	1,053,588.38	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	73,925	185,551.75	
	STOCKLAND	183,438	845,649.18	
	VICINITY CENTRES	302,292	479,132.82	
	WAYPOINT REIT LTD	50,503	125,752.47	
オーストラリアドル 小計		2,446,902	9,764,017.28	(817,150,606)

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	54,280	81,148.60	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	83,533	190,455.24	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	114,444	143,055.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	80,117	132,193.05	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	35,571	103,511.61	
ニュージーランドドル 小計		367,945	650,363.50 (50,526,740)	
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	127,000	580,390.00	
	FORTUNE REIT	114,000	904,020.00	
	LINK REIT	157,400	11,789,260.00	
	PROSPERITY REIT	60,000	154,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	81,000	343,440.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	124,000	483,600.00	
香港ドル 小計		663,400	14,255,510.00 (198,151,589)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	32,195.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300	87,975.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	236,600	735,826.00	
	ASCOTT TRUST	156,755	163,025.20	
	CAPITALAND CHINA TRUST	61,000	84,790.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	344,308	747,148.36	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	69,050	86,312.50	
	ESR REIT	217,952	89,360.32	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	29,210.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	7,280.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	92,500	226,625.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	54,600	31,668.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	191,538	279,645.48	
	IREIT GLOBAL	57,600	37,152.00	
	KEPPEL DC REIT	99,300	270,096.00	
	KEPPEL REIT	143,100	173,151.00	

		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	57,600	45,504.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	321,700	22,519.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	162,500	344,500.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	127,800	357,840.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	219,750	432,907.50	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	167,200	180,576.00	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200	97,280.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	29,800	123,968.00	
		SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	13,175.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	20,000	18,200.00	
		SPH REIT	74,600	65,648.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	138,200	77,392.00	
		SUNTEC REIT	147,500	228,625.00	
	シンガポールドル 小計		3,679,953	5,089,594.36 (414,140,293)	
	韓国ウォン	JR REIT XXVII	8,500	43,945,000.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	2,600	14,664,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	9,703	52,396,200.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	5,000	24,725,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	3,100	24,459,000.00	
	韓国ウォン 小計		28,903	160,189,200.00 (15,522,333)	
	イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	13,478	231,282.48	
	イスラエルシェケル 小計		13,478	231,282.48 (7,676,126)	
	合計			11,519,480,828 (11,519,480,828)	

（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 155銘柄	74.0%	74.4%
カナダドル	投資証券 27銘柄	1.9%	1.9%

ユーロ	投資証券	30銘柄	4.7%	4.8%
英ポンド	投資証券	35銘柄	5.8%	5.8%
オーストラリアドル	投資証券	31銘柄	7.1%	7.1%
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	1.7%	1.7%
シンガポールドル	投資証券	29銘柄	3.6%	3.6%
韓国ウォン	投資証券	5銘柄	0.1%	0.1%
イスラエルシェケル	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。

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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	360,106,290	101,589,326
金銭信託	541,173,851	105,268,890
コール・ローン	554,800,539	241,566,316
国債証券	151,493,147,031	161,434,643,407
派生商品評価勘定	-	1,325,008
未収入金	603,699,765	653,000,000
未収利息	1,214,583,803	1,174,280,811
前払費用	24,133,730	20,257,638
流動資産合計	154,791,645,009	163,731,931,396
資産合計	154,791,645,009	163,731,931,396
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	489,197
未払金	-	647,205,081
未払解約金	24,888,000	265,826,302
未払利息	1,600	699
その他未払費用	96,959	9,108
流動負債合計	24,986,559	913,530,387
負債合計	24,986,559	913,530,387
純資産の部		
元本等		
元本	84,222,011,513	84,390,597,281
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	70,544,646,937	78,427,803,728
元本等合計	154,766,658,450	162,818,401,009
純資産合計	154,766,658,450	162,818,401,009
負債純資産合計	154,791,645,009	163,731,931,396

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	(2021年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	84,222,011,513口	84,390,597,281口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8376円 (10,000口当たりの純資産額 18,376円)	1口当たり純資産額 1.9293円 (10,000口当たりの純資産額 19,293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 4月28日 至 2021年 4月26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、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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 4月26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 4月27日現在）

該当事項はありません。

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	650,042,394	-	650,878,205	835,811
	米ドル	309,432,427	-	309,153,111	△279,316
	ユーロ	264,273,378	-	265,536,384	1,263,006
	英ポンド	49,432,655	-	49,222,779	△209,876
	スウェーデンクローナ	26,903,934	-	26,965,931	61,997
合計		650,042,394	-	650,878,205	835,811

（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 4月28日 至 2021年 4月26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 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,111,667,202円
同期中における追加設定元本額	19,462,297,871円
同期中における一部解約元本額	27,351,953,560円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	21,729,513,907円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	624,392,248円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,639,945,488円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	795,329,382円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	129,517,808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）	7,529,832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）	28,214,262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）	86,193,258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）	124,470,791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）	70,383,469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）	145,145,162円

三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	22,380,605円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	71,914,897円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	92,768,309円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	72,967,241円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	5,928,646円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	62,281,421円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	62,871,730円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	127,695,973円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	45,528,590円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	20,498,377円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	42,824,955円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	3,298,976円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	392,647円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,011,591円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	493,390円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,121,849円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,998,553,072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＞	65,167,979円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	9,424,682,581円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,879,897,341円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	10,719,433,443円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	35,972,335円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	89,375,303円
世界６資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	383,602円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	618,347,209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＞	107,986,579円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,121,811,212円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,345,145,307円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,698,058,269円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,414,915,975円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,474,614円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	9,204,968,865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）	362,540,257円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	155,841,347円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	99,751,871円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	35,912,561円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	12,525,068円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	128,196,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	486,454,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	144,536,692円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	41,239,972円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	5,161,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,191,024,810円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	18,574,156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＞	1,842,966,759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＞	1,211,426,201円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	4,904,594,450円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	517,849,138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＞	39,007,369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＞	40,310,514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＞	34,933,875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＞	43,080,625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＞	165,294,757円
合計	84,222,011,513円

(2021年 4月26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	84,222,011,513円
同期中における追加設定元本額	11,191,601,392円
同期中における一部解約元本額	11,023,015,624円
2021年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	23,534,936,984円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	729,649,813円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,025,052,215円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,054,240,718円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,217,912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）	6,940,706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）	28,769,951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）	94,042,578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）	178,438,989円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	114,062,243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）	213,016,075円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	24,082,222円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	139,530,302円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	165,360,909円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	88,010,634円
イオン・バランス戦略ファンド	82,884,377円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,098,149円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	70,276,236円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	46,159,136円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	110,380,542円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	33,794,045円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	22,772,725円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	82,278,579円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	123,896,191円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	9,281,514円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	24,027,031円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	15,516,979円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,832,778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＞	2,338,391,074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＞	53,057,364円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	8,328,869,926円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,860,208,256円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	11,174,840,543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＞	97,373,210円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	740,287,615円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	121,217,577円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,100,173,191円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,455,394,432円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,680,280,937円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,267,062,313円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	619,895円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	8,780,087,672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）	345,222,445円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	154,703,653円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	90,561,097円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	35,408,120円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	11,874,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	108,523,473円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	453,166,105円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	119,259,614円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	42,530,817円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	5,288,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,117,376,981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＞	715,810,156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＞	1,078,469,323円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	3,029,032,100円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	474,627,289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＞	47,517,572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＞	64,301,287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＞	177,723,755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＞	149,075,586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＞	956,808,220円
合計	84,390,597,281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	1,800,070.30	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,292,441.41	
		US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,983,437.52	
		US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,683,746.10	
		US TREASURY N/B 0.125	7,700,000.00	7,664,207.01	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,007,812.50	
		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,709,625.00	
		US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	2,999,765.64	
		US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,361,093.74	
		US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,241,992.20	
		US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,960,234.38	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,973,515.64	
		US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,966,171.88	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,945,742.18	
		US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,483,175.79	
		US TREASURY N/B 0.375	7,800,000.00	7,413,656.25	
		US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,495,488.28	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,898,867.18	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,893,828.14	
		US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,238,093.77	
		US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,462,968.75	
		US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	963,320.31	
		US TREASURY N/B 0.625	3,200,000.00	3,078,875.00	
		US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	6,931,933.57	
		US TREASURY N/B 0.625	8,800,000.00	8,102,531.27	
		US TREASURY N/B 0.75	6,700,000.00	6,491,148.47	
		US TREASURY N/B 0.875	7,000,000.00	6,578,632.82	
		US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,532,402.34	
		US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,010,703.12	
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,359,726.58	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,070,078.14	

US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	3,996,128.91	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,073,750.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,066,914.07	
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	512,734.37	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,567,578.12	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,083,085.93	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,031,367.19	
US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,661,648.44	
US TREASURY N/B 1.375	4,900,000.00	3,967,277.35	
US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,567,402.33	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,074,765.64	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,077,343.75	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,071,718.76	
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,545,234.37	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,027,304.69	
US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,506,855.48	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,040,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,469,593.75	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,581,484.37	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,097,968.76	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,087,070.32	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,089,765.64	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,103,710.93	
US TREASURY N/B 1.625	4,700,000.00	4,884,144.53	
US TREASURY N/B 1.625	4,550,000.00	4,726,490.22	
US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,041,679.70	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,105,820.32	
US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,522,486.31	
US TREASURY N/B 1.625	3,200,000.00	2,763,624.98	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,827,773.44	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,440,218.74	
US TREASURY N/B 1.75	1,600,000.00	1,628,000.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,054,140.64	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,058,242.18	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,070,312.50	

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,085,078.14	
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,786,273.45	
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,307,953.18	
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	887,386.72	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,500,781.25	
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,101,562.52	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,033,125.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,054,023.43	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,058,242.18	
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,738,250.00	
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,914,562.51	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,079,921.89	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,886,835.94	
US TREASURY N/B 1.875	1,400,000.00	1,470,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,360,375.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,100,000.00	1,010,109.37	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,072,070.32	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,599,394.54	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,149,609.40	
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,926,617.17	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,099,218.76	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,465,773.45	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,627,734.37	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,693,593.75	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,545,066.41	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,278,320.30	
US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,651,250.00	
US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,553,417.97	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,071,953.14	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,133,750.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,250,035.16	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,102,968.76	
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,840,996.11	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,695,917.96	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,227,343.76	

US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,905,609.38	
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,201,082.01	
US TREASURY N/B 2.125	900,000.00	956,882.81	
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,390,199.20	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,158,085.93	
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,319,109.38	
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,016,421.89	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,593,046.87	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,694,980.45	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,297,867.20	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,273,906.24	
US TREASURY N/B 2.25	5,800,000.00	6,201,921.89	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,704,390.63	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,486,289.05	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,697,000.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,858,126.94	
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,502,324.21	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,247,343.75	
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,916,507.83	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,963,562.52	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,274,964.85	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,265,011.73	
US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	1,953,363.28	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,261,914.05	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,072,726.59	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,651,546.89	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,158,226.58	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,321,175.77	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,051,796.87	
US TREASURY N/B 2.5	3,600,000.00	3,788,156.26	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,182,500.00	
US TREASURY N/B 2.625	1,900,000.00	2,019,195.32	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,484,449.21	
US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,777,609.36	
US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,933,929.70	

US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,138,421.87	
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,049,304.70	
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,053,515.63	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,114,218.76	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,024,585.92	
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,467,093.75	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,449,628.91	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,168,203.12	
US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	5,001,242.17	
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,285,062.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,280,375.02	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,208,437.50	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	331,031.25	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,193,210.92	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,655,859.37	
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,065,820.31	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,135,312.50	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,399,718.75	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,201,449.21	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,740,234.37	
US TREASURY N/B 2.875	5,000,000.00	5,546,289.05	
US TREASURY N/B 2.875	3,800,000.00	4,218,445.32	
US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,700,750.00	
US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,164,667.97	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,058,156.26	
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,587,140.63	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,400,625.00	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,415,933.58	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	918,750.00	
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,020,351.58	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,448,359.39	
US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,108,269.53	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,883,593.75	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,538,851.56	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,585,585.95	

US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,253,875.00	
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,409,632.82	
US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,742,882.80	
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,287,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,171,406.25	
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,690,820.32	
US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	3,869,250.00	
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,840,812.51	
US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,655,312.50	
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,840,125.00	
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	981,125.00	
US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,027,937.51	
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,551,609.38	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,914,257.82	
US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	900,019.53	
US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	646,406.25	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,343,593.75	
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	813,140.62	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	675,507.81	
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	956,703.12	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,921,062.50	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	414,210.93	
US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,010,859.37	
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	274,187.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,385,546.88	
US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	846,328.12	
US TREASURY N/B 4.75	900,000.00	1,297,757.81	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	715,820.31	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	642,226.56	
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	433,250.00	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	647,695.31	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,247,109.38	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,315,234.38	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	911,312.50	
米ドル 小計	630,570,000.00	661,053,049.20	

			(71,321,013,478)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	1,700,000.00	1,704,199.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	591,624.00	
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,030,420.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,293,045.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	3,400,000.00	3,339,140.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,049,800.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,030,930.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	2,978,590.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,129,315.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,245,732.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,900,000.00	2,001,517.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,050,760.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,486,786.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,178,573.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,229,108.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,850,400.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,266,265.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	594,160.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,675,986.00	
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,017,635.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,093,684.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	334,615.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	720,020.00	
カナダドル 小計		34,100,000.00	36,892,304.00	
			(3,193,397,834)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,623,680.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	19,913,000.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	28,000,000.00	28,547,596.00	
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	26,742,490.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,073,967.20	
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	19,119,654.00	
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	28,870,020.00	
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,170,500.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	25,923,900.30	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	44,067,172.00	

メキシコペソ 小計		219,000,000.00	236,051,979.50 (1,284,217,189)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	716,660.00	
	BELGIAN 0.1	700,000.00	711,830.00	
	BELGIAN 0.4	300,000.00	292,128.00	
	BELGIAN 0.8	800,000.00	845,808.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,073,410.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,078,780.00	
	BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,551,528.00	
	BELGIAN 0304 5	1,400,000.00	2,311,148.00	
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,039,868.00	
	BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	875,056.00	
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,820,122.00	
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,595,265.00	
	BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,536,762.00	
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	954,037.00	
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,038,970.00	
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	712,850.00	
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	465,464.00	
	BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,416,038.00	
	BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	616,295.00	
	BELGIAN 0353 0.65	400,000.00	342,260.00	
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,507,786.00	
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,101,470.00	
	BELGIAN 1.25	400,000.00	454,012.00	
	BELGIAN 1.6	850,000.00	1,020,986.00	
	BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,241,160.00	
	BELGIAN 2.15	500,000.00	716,855.00	
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,348,144.00	
	BTPS 0.35	2,700,000.00	2,741,634.00	
	BTPS 0.5	1,000,000.00	1,019,280.00	
	BTPS 0.65	2,000,000.00	2,045,760.00	
	BTPS 0.85	1,700,000.00	1,758,565.00	
	BTPS 0.9	2,250,000.00	2,286,112.50	
	BTPS 0.9	1,200,000.00	1,213,872.00	

BTPS 0.95	2,000,000.00	2,047,240.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,048,060.00	
BTPS 0.95	800,000.00	830,376.00	
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,839,402.00	
BTPS 1	1,000,000.00	1,017,010.00	
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,015,110.00	
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,692,160.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,034,300.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,050,420.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,899,324.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,059,190.00	
BTPS 1.45	600,000.00	619,428.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,867,751.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,288,956.00	
BTPS 1.65	1,200,000.00	1,300,452.00	
BTPS 1.65	1,800,000.00	1,944,234.00	
BTPS 1.7	500,000.00	487,190.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,061,990.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,076,670.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,415,999.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,770,448.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,660,545.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,100,730.00	
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,565,650.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,369,764.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,280,598.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,034,694.00	
BTPS 2.5	600,000.00	655,866.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,333,646.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,867,827.50	
BTPS 2.8	300,000.00	351,282.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,076,994.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,617,187.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,179,315.00	
BTPS 3.1	900,000.00	1,142,802.00	

BTPS 3.25	1,500,000.00	1,978,725.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,088,705.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,915,130.00	
BTPS 3.5	4,400,000.00	5,475,096.00	
BTPS 3.75	1,500,000.00	1,694,910.00	
BTPS 3.85	900,000.00	1,317,807.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,603,496.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,524,457.00	
BTPS 4.5	1,000,000.00	1,133,900.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,183,778.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,788,150.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,614,220.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,569,472.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,194,630.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,064,966.20	
BTPS 5	1,800,000.00	2,844,918.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,708,610.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,294,656.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,176,640.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,605,046.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,307,260.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,370,480.00	
BTPS 7.25	400,000.00	554,744.00	
BTPS 9	300,000.00	369,936.00	
BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,594,255.00	
BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,020,200.00	
BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,927,132.00	
BUNDESOBL-178 0	1,600,000.00	1,628,624.00	
BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,327,326.00	
BUNDESOBL-180 0	1,100,000.00	1,126,752.00	
BUNDESOBL-182 0	1,800,000.00	1,852,560.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,477,952.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,612,980.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,340,118.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,500,000.00	1,542,780.00	

DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	301,251.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,300,000.00	2,114,873.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	3,984,072.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,054,628.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,002,087.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,614,750.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,900,000.00	2,005,146.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,626,610.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,100,000.00	2,245,824.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,374,490.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,198,912.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,086,408.50	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,184,651.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,359,813.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,136,760.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,264,614.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,354,572.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,126,780.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,388,110.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,500,000.00	3,927,450.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	1,998,060.00	
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	2,947,410.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,682,526.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,217,040.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,000,000.00	3,312,200.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,141,501.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,418,634.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,420,720.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,428,108.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	795,340.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,446,910.00	
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	402,560.00	
FINNISH GOV'T 0.125	300,000.00	295,434.00	
FINNISH GOV'T 0.25	300,000.00	293,835.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	424,064.00	

FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	847,528.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	541,340.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	225,906.00	
FINNISH GOV'T 1.375	300,000.00	370,140.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,043,470.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,032,320.00	
FINNISH GOV'T 2	600,000.00	648,060.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	733,670.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	735,534.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,195,430.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,215,576.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,025,460.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,073,360.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,226,400.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,100,000.00	2,147,838.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,540,140.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,900,000.00	2,902,610.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,900,000.00	3,008,431.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	724,653.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,024,903.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,672,725.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,949,828.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,680,825.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,200,000.00	3,435,264.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,800,000.00	1,756,944.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,193,479.50	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,709,725.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,700,000.00	3,052,539.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,718,216.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,850,000.00	4,427,769.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,842,128.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,411,722.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,820,038.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,400,000.00	2,948,472.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,039,040.00	

FRANCE 0.A.T. 2	2,200,000.00	2,883,408.00	
FRANCE 0.A.T. 2.25	1,900,000.00	1,983,296.00	
FRANCE 0.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,703,654.00	
FRANCE 0.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,324,705.00	
FRANCE 0.A.T. 2.75	3,850,000.00	4,633,013.00	
FRANCE 0.A.T. 3	4,000,000.00	4,145,560.00	
FRANCE 0.A.T. 3.25	1,700,000.00	2,690,777.00	
FRANCE 0.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,003,775.00	
FRANCE 0.A.T. 4	2,000,000.00	3,213,880.00	
FRANCE 0.A.T. 4	1,370,000.00	2,652,237.80	
FRANCE 0.A.T. 4	1,400,000.00	2,836,834.00	
FRANCE 0.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,495,480.00	
FRANCE 0.A.T. 4.5	2,600,000.00	4,579,510.00	
FRANCE 0.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,568,400.00	
FRANCE 0.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,016,980.00	
FRANCE 0.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,466,974.00	
FRANCE 0.A.T. 6	3,000,000.00	3,894,810.00	
FRANCE 0.A.T. 8.5	600,000.00	710,670.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	403,632.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	757,064.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,073,640.00	
IRISH GOVT 1.1	1,600,000.00	1,759,360.00	
IRISH GOVT 1.3	600,000.00	679,944.00	
IRISH GOVT 1.35	500,000.00	565,905.00	
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	474,660.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	360,849.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,303,380.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	733,968.00	
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	558,055.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	543,180.00	
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	986,024.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,019,250.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,900,000.00	1,936,632.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,900,000.00	1,970,110.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	500,000.00	522,325.00	

NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,793,143.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	800,000.00	847,112.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,300,000.00	1,398,163.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,082,180.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,688,320.00	
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,087,330.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,553,910.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,302,960.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	1,945,464.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	754,243.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,244,034.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,600,000.00	2,585,184.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	982,576.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,225.00	
REP OF AUSTRIA 0	900,000.00	910,179.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	845,536.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	550,000.00	582,021.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	961,236.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	752,640.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	800,000.00	841,056.00	
REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	143,887.50	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,079,640.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	271,146.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	871,500.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,188,264.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,060,300.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,167,192.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	966,258.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,170,873.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,042,370.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,485,792.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,000,000.00	1,616,690.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	633,835.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,420,090.00	
SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,012,950.00	

SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,021,400.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,018,940.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	507,495.00	
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,020,410.00	
SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	421,256.00	
SPANISH GOV'T 1	300,000.00	276,741.00	
SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	514,390.00	
SPANISH GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,171,360.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,920,590.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,500,000.00	1,643,610.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,755,984.00	
SPANISH GOV'T 1.45	400,000.00	364,408.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,849,574.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,198,236.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,316,100.00	
SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,833,263.00	
SPANISH GOV'T 1.85	2,400,000.00	2,763,216.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,886,130.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,958,230.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,666,496.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,300,000.00	1,572,467.00	
SPANISH GOV'T 2.7	1,550,000.00	2,069,234.50	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,332,974.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,921,178.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,738,143.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,579,844.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,484,009.00	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,247,900.00	
SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,184,210.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,509,725.00	
SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,439,020.00	
SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,541,060.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,068,155.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,197,428.00	
SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,486,070.00	

	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,371,455.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	661,155.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,200,120.00	
ユーロ 小計		429,990,000.00	508,948,783.00 (66,443,263,620)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	701,176.00	
	UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,487,265.00	
	UK TSY GILT 0.375	1,000,000.00	963,370.00	
	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,811,124.00	
	UK TSY GILT 0.625	1,700,000.00	1,729,155.00	
	UK TSY GILT 0.625	500,000.00	468,900.00	
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,692,373.50	
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,015,880.00	
	UK TSY GILT 1	1,600,000.00	1,642,720.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,200,000.00	1,259,088.00	
	UK TSY GILT 1.25	700,000.00	702,338.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,060,720.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,786,598.00	
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	666,363.50	
	UK TSY GILT 1.625	1,900,000.00	2,048,523.00	
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	551,140.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,228,512.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,900,000.00	2,073,090.00	
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	834,360.00	
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,185,052.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,841,075.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,343,760.00	
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,414,257.00	
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,233,216.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,411,227.50	
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,702,669.50	
	UK TSY GILT 3.75	1,200,000.00	1,975,656.00	
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,192,362.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,371,205.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,221,381.00	

	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,510,824.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,450,000.00	2,195,314.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,998,074.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,478,450.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,546,722.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,157,274.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,583,560.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,189,605.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,576,960.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,897,836.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,541,410.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	911,410.50	
英ポンド 小計		54,800,000.00	70,201,998.00 (10,515,557,280)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,174,000.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	6,000,000.00	6,248,040.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	6,400,000.00	6,761,600.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,320,530.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,542,950.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,337,440.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,757,768.00	
スウェーデンクローナ 小計		41,000,000.00	45,142,328.00 (580,981,761)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,004,860.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,591,385.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,107,130.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,800,602.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,190,980.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,501,660.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,269,240.00	
ノルウェークローネ 小計		30,200,000.00	31,465,857.00 (409,685,458)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,219,920.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	11,100,000.00	11,669,430.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,216,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,255,000.00	

	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,600,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	18,625,950.00	
デンマーククローネ 小計		37,900,000.00	47,586,300.00 (835,615,428)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	6,000,000.00	6,000,539.70	
	POLAND GOVT BOND 1.25	1,800,000.00	1,752,012.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,900,000.00	5,105,212.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	1,065,760.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,257,130.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,269,310.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	5,900,000.00	6,523,217.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,654,032.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,594,040.00	
ポーランドズロチ 小計		34,900,000.00	37,221,252.70 (1,067,334,309)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	900,000.00	884,431.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	3,300,000.00	3,241,590.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	600,000.00	488,196.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,550,970.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,210,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,459,215.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,698,242.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,767,040.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,991,779.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,300,000.00	3,640,890.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	868,480.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,511,832.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,106,340.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,401,140.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	2,890,425.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,456,044.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,108,450.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,803,760.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,600,000.00	1,952,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	1,400,000.00	1,550,066.00	
		1,500,000.00	1,603,800.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 5.75			
オーストラリアドル 小計		38,350,000.00	42,186,091.50 (3,530,553,997)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,042,470.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	435,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,259,160.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	454,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	801,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	445,308.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	755,720.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	829,590.64	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	762,775.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,701,600.00	
シンガポールドル 小計		7,750,000.00	8,487,523.64 (690,629,798)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,132,183.10	
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,199,562.47	
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,602,500.15	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,502,402.50	
	MALAYSIA GOVT 4.736	4,500,000.00	4,776,418.35	
マレーシアリングgit 小計		29,700,000.00	31,213,066.57 (820,579,034)	
イスラエルシェケル	ISRAEL FIXED 0.75	6,200,000.00	6,254,994.00	
	ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	2,997,875.00	
	ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,658,355.00	
	ISRAEL FIXED 3.75	3,700,000.00	4,881,114.00	
	ISRAEL FIXED 6.25	5,000,000.00	6,558,600.00	
イスラエルシェケル 小計		19,300,000.00	22,350,938.00 (741,814,221)	
合計			161,434,643,407 (161,434,643,407)	

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 205銘柄	43.8%	44.2%

カナダドル	国債証券	23銘柄	2.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	10銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券	281銘柄	40.8%	41.2%
英ポンド	国債証券	42銘柄	6.5%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	9銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	2.2%	2.2%
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%
イスラエルシェケル	国債証券	5銘柄	0.5%	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。

【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間（2021年 4月27日から2021年10月26日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【イオン・バランス戦略ファンド】

（１）【中間貸借対照表】

	(単位：円)	
	第5期 (2021年 4月26日現在)	第6期中間計算期間 (2021年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,363,526	701,535
金銭信託	14,421,157	1,315,805
コール・ローン	33,093,022	38,971,655
投資証券	108,019,311	-
親投資信託受益証券	2,583,282,312	2,711,267,144
未収入金	165,500,000	-
流動資産合計	2,905,679,328	2,752,256,139
資産合計	2,905,679,328	2,752,256,139
負債の部		
流動負債		
未払金	160,000,000	-
未払解約金	2,199,845	835,952
未払受託者報酬	431,454	455,202
未払委託者報酬	12,224,580	12,897,548
未払利息	95	-
その他未払費用	87,549	91,053
流動負債合計	174,943,523	14,279,755
負債合計	174,943,523	14,279,755
純資産の部		
元本等		
元本	2,679,512,252	2,666,796,687
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	51,223,553	71,179,697
（分配準備積立金）	70,824,272	61,704,857
元本等合計	2,730,735,805	2,737,976,384
純資産合計	2,730,735,805	2,737,976,384
負債純資産合計	2,905,679,328	2,752,256,139

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日	第6期中間計算期間 自 2021年 4月27日 至 2021年10月26日
営業収益		
受取配当金	1,577,917	828,796
受取利息	-	19
有価証券売買等損益	8,534,983	31,539,416
為替差損益	△1,076,773	2,188,148
営業収益合計	9,036,127	34,556,379
営業費用		
支払利息	13,473	16,553
受託者報酬	410,642	455,202
委託者報酬	11,634,821	12,897,548
その他費用	108,741	116,161
営業費用合計	12,167,677	13,485,464
営業利益又は営業損失（△）	△3,131,550	21,070,915
経常利益又は経常損失（△）	△3,131,550	21,070,915
中間純利益又は中間純損失（△）	△3,131,550	21,070,915
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	154,045	6,614,012
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△32,578,486	51,223,553
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,331,318	12,830,735
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,331,318	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	12,830,735
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,220,918	7,331,494
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	7,331,494
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,220,918	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△37,753,681	71,179,697

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第6期中間計算期間 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第5期 (2021年4月26日現在)	第6期中間計算期間 (2021年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,679,512,252口	2,666,796,687口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0191円 (1万口当たりの純資産額10,191円)	1口当たり純資産額 1.0267円 (1万口当たりの純資産額10,267円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第6期中間計算期間 (2021年10月26日現在)
-----	------------------------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第5期 (2021年4月26日現在)	第6期中間計算期間 (2021年10月26日現在)
期首元本額	2,422,786,770円	2,679,512,252円
期中追加設定元本額	586,168,237円	353,379,442円
期中一部解約元本額	329,442,755円	366,095,007円

（参考）

イオン・バランス戦略ファンドは、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

	(2021年4月26日現在)	(2021年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	68,082,064	167,923,380
金銭信託	80,177,155	7,450,459
コール・ローン	183,986,932	220,668,571
国債証券	18,913,583,233	26,894,931,832
派生商品評価勘定	232,914,277	574,553
未収入金	214,000,000	-
未収利息	119,105,342	136,255,292
前払費用	15,533,861	15,402,520
流動資産合計	19,827,382,864	27,443,206,607

資産合計	19,827,382,864	27,443,206,607
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	52,791,964	694,059,592
未払金	316,453,295	139,057,045
未払解約金	23,100,000	34,000,000
未払利息	532	-
その他未払費用	6,007	635
流動負債合計	392,351,798	867,117,272
負債合計	392,351,798	867,117,272
純資産の部		
元本等		
元本	13,008,296,854	17,828,241,331
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	6,426,734,212	8,747,848,004
元本等合計	19,435,031,066	26,576,089,335
純資産合計	19,435,031,066	26,576,089,335
負債純資産合計	19,827,382,864	27,443,206,607

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年4月27日 至 2021年10月26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。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2021年4月26日現在）	（2021年10月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	13,008,296,854口	17,828,241,331口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4940円 （1万口当たりの純資産額14,940円）	1口当たり純資産額 1.4907円 （1万口当たりの純資産額14,907円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項 目	（2021年10月26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）

（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	139,702,883	-	139,576,890	△125,993
	イギリス・ポンド	20,781,467	-	20,693,234	△88,233
	イスラエル・シェケル	2,242,494	-	2,251,402	8,908
	オーストラリア・ドル	7,091,000	-	7,098,552	7,552
	カナダ・ドル	6,426,246	-	6,440,953	14,707
	シンガポール・ドル	1,735,015	-	1,735,732	717
	スウェーデン・クローナ	1,310,073	-	1,313,093	3,020
	デンマーク・クローネ	2,221,625	-	2,232,963	11,338
	メキシコ・ペソ	2,393,749	-	2,400,916	7,167
	ユーロ	133,044,305	-	133,680,122	635,817
	小計	316,948,857	-	317,423,857	475,000
	売建				

市場取引以 外の取引	アメリカ・ドル	8,523,839,369	-	8,320,321,620	203,517,749
	イギリス・ポンド	1,241,773,238	-	1,220,745,305	21,027,933
	イスラエル・シェケ ル	87,079,739	-	87,314,367	△234,628
	オーストラリア・ド ル	415,566,659	-	415,102,400	464,259
	カナダ・ドル	383,679,312	-	378,220,441	5,458,871
	シンガポール・ドル	174,180,624	-	172,470,480	1,710,144
	スウェーデン・ク ローナ	68,046,060	-	69,111,900	△1,065,840
	デンマーク・クロー ネ	98,247,095	-	98,862,800	△615,705
	ノルウェー・クロー ネ	47,194,021	-	47,523,000	△328,979
	ポーランド・ズロチ	124,661,162	-	127,601,080	△2,939,918
	メキシコ・ペソ	152,850,854	-	154,069,344	△1,218,490
	ユーロ	7,849,844,966	-	7,895,973,049	△ 46,128,083
	小計	19,166,963,099	-	18,987,315,786	179,647,313
	合 計	19,483,911,956	-	19,304,739,643	180,122,313

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	12,381,768,341	-	12,658,033,410	△276,265,069
	カナダ・ドル	515,131,280	-	540,436,680	△25,305,400
	オーストラリア・ド ル	481,050,422	-	510,213,600	△29,163,178
	シンガポール・ドル	242,365,704	-	250,096,024	△7,730,320
	イギリス・ポンド	1,565,669,905	-	1,636,537,925	△70,868,020
	イスラエル・シェケ ル	119,393,669	-	123,053,862	△3,660,193
	デンマーク・クロー ネ	134,867,477	-	138,130,010	△3,262,533
	ノルウェー・クロー ネ	64,259,925	-	68,945,030	△4,685,105
	スウェーデン・ク ローナ	79,652,157	-	82,952,100	△3,299,943
	メキシコ・ペソ	185,906,790	-	195,249,960	△9,343,170
	ポーランド・ズロチ	144,717,032	-	148,245,384	△3,528,352
	ユーロ	10,603,005,406	-	10,859,379,162	△256,373,756
	小計	26,517,788,108	-	27,211,273,147	△693,485,039

合 計	26,517,788,108	-	27,211,273,147	△693,485,039
-----	----------------	---	----------------	--------------

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

・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おります。

・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おります。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2021年4月26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	17,571,381,562円
同期中における追加設定元本額	8,582,179,054円
同期中における一部解約元本額	13,145,263,762円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,096,603,813円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	634,468,070円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,763,790円
イオン・バランス戦略ファンド	536,817,606円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,158,343,666円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	418,497,151円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	681,787,045円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	146,325,380円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	29,424,709円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,193,219円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,362,970,381円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	810,193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＞	5,187,705,209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＞	129,547,354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＞	319,879,049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＞	267,160,219円
合 計	13,008,296,854円

(2021年10月26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	13,008,296,854円
同期中における追加設定元本額	5,613,277,401円
同期中における一部解約元本額	793,332,924円
2021年10月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	3,178,173,736円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,982,915,914円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	824,127,483円
イオン・バランス戦略ファンド	904,218,797円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,597,812,445円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	595,970,006円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	993,202,423円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	232,998,653円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	60,999,060円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	34,575,385円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	47,286,423円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,330,757,256円
SMAM・バランスVA株4 0 T＜適格機関投資家限定＞	826,919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＞	5,344,546,095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＞	143,609,096円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4＜適格機関投資家限定＞	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	17,828,241,331円

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年4月26日現在)	(2021年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	832,397,711	116,330,251
コール・ローン	1,910,148,847	3,445,483,163
国債証券	8,709,913,925	8,593,041,166
未収入金	95,000,000	-
未収利息	8,369,486	8,553,201
前払費用	2,159,898	1,630,478
流動資産合計	11,557,989,867	12,165,038,259
資産合計	11,557,989,867	12,165,038,259
負債の部		
流動負債		
未払金	141,754,200	79,335,900
未払利息	5,528	-
その他未払費用	68,640	6,707
流動負債合計	141,828,368	79,342,607
負債合計	141,828,368	79,342,607

純資産の部

元本等		
元本	9,636,327,340	10,224,933,538
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,779,834,159	1,860,762,114
元本等合計	11,416,161,499	12,085,695,652
純資産合計	11,416,161,499	12,085,695,652
負債純資産合計	11,557,989,867	12,165,038,259

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年4月27日 至 2021年10月26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。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2021年4月26日現在)	(2021年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,636,327,340口	10,224,933,538口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1847円 (1万口当たりの純資産額11,847円)	1口当たり純資産額 1.1820円 (1万口当たりの純資産額11,820円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2021年10月26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。

(その他の注記)

(2021年4月26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	10,376,629,913円
同期中における追加設定元本額	1,606,344,773円
同期中における一部解約元本額	2,346,647,346円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	679,027,252円
SMAM・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,456,022,763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＞	501,277,325円
合 計	9,636,327,340円

(2021年10月26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	9,636,327,340円
同期中における追加設定元本額	1,217,271,713円
同期中における一部解約元本額	628,665,515円
2021年10月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	1,153,424,860円
SMAM・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,245,464,718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＞	826,043,960円
合 計	10,224,933,538円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

イオン・バランス戦略ファンド

2021年11月30日現在

I 資産総額	2,774,675,961円
II 負債総額	6,645,262円
III 純資産総額（I－II）	2,768,030,699円
IV 発行済口数	2,688,115,767口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0297円
（1万口当たり純資産額）	（10,297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

- 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。
- 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。
- 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。

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2021年11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。

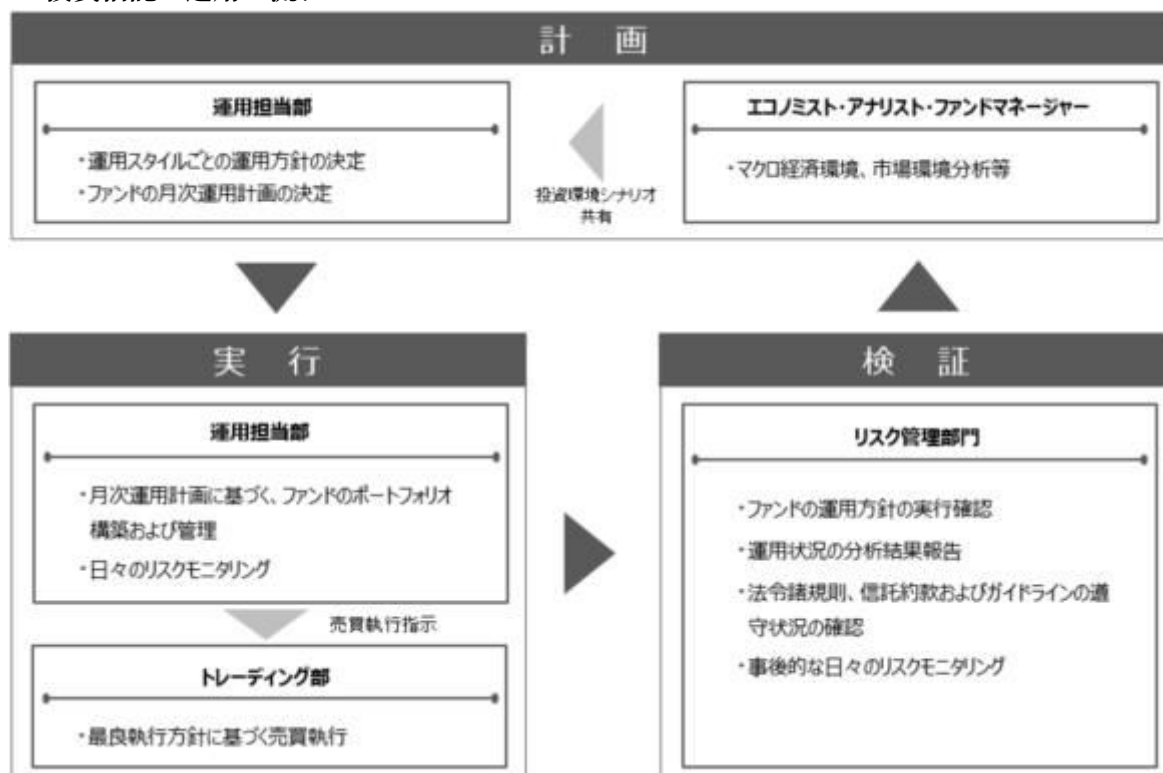
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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11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	735	9,493,408
単位型株式投資信託	102	551,354
追加型公社債投資信託	1	28,433
単位型公社債投資信託	190	428,557
合 計	1,028	10,501,754

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第36期（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、第37期中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)		
	前事業年度 (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		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
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。

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

	前事業年度 (2020年 3 月31日)	当事業年度 (2021年 3 月31日)
(単位：千円)		
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	(株)三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% —	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% —	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

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

２. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

１. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

２. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２. 親会社に関する注記

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

(１株当たり情報)

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

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後１株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

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いません。

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		38,529,337
顧客分別金信託		300,038
前払費用		518,490
未収委託者報酬		10,909,133
未収運用受託報酬		2,723,571
未収投資助言報酬		399,072
未収収益		39,947
その他		224,189
流動資産合計		53,643,782
固定資産		
有形固定資産	※ 1	2,218,463
無形固定資産		
のれん		3,502,221
顧客関連資産		14,615,253
その他		2,778,211
無形固定資産合計		20,895,685
投資その他の資産		
投資有価証券		22,000,657
関係会社株式		11,246,398
その他		1,595,579
貸倒引当金		△ 20,750
投資その他の資産合計		34,821,886
固定資産合計		57,936,035
資産合計		111,579,818
負債の部		
流動負債		
リース債務		3,567
顧客からの預り金		12,736
その他の預り金		100,610
未払金		5,104,509
未払費用		7,204,066
未払法人税等		1,493,440
前受収益		32,829
賞与引当金		1,725,017

その他	※ 2	695,069
流動負債合計		16,371,848
固定負債		
リース債務		6,309
繰延税金負債		2,389,323
退職給付引当金		5,414,560
その他		40,950
固定負債合計		7,851,143
負債合計		24,222,992
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,761,706
利益剰余金合計		2,045,951
株主資本合計		86,141,897
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,214,928
評価・換算差額等合計		1,214,928
純資産合計		87,356,826
負債純資産合計		111,579,818

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	32,740,035
運用受託報酬	4,392,826
投資助言報酬	633,982
その他の営業収益	117,708
営業収益計	37,884,552
営業費用	25,219,811
一般管理費	※ 1 9,605,282
営業利益	3,059,458
営業外収益	※ 2 198,028
営業外費用	※ 3 26,126
経常利益	3,231,360
特別損失	※ 4 146,753
税引前中間純利益	3,084,607
法人税、住民税及び事業税	1,373,478
法人税等調整額	△ 334,822
法人税等合計	1,038,655
中間純利益	2,045,951

(3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
						配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	△10,281,242
当中間期変動額								
欠損填補			△8,460,037	△8,460,037				8,460,037
中間純利益								2,045,951
任意積立金の取崩						△60,000	△1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計	—	—	△8,460,037	△8,460,037	—	△60,000	△1,476,959	12,042,949
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	—	—	1,761,706

	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	△8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当中間期変動額					
欠損填補	8,460,037	—			—
中間純利益	2,045,951	2,045,951			2,045,951
任意積立金の取崩					
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			265,562	265,562	265,562
当中間期変動額合計	10,505,989	2,045,951	265,562	265,562	2,311,514
当中間期末残高	2,045,951	86,141,897	1,214,928	1,214,928	87,356,826

注記事項

（重要な会計方針）

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

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

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は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中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

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. 収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。）等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

（会計方針の変更）

「収益認識会計基準」等を当中間会計期間の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当該会計基準等の適用が中間財務諸表に及ぼす影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
※1.有形固定資産の減価償却累計額	1,320,556千円
※2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
※3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	—
差引額	10,000,000千円
※4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額73,437千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
※1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	191,604千円
無形固定資産	1,304,363千円
※2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	6,622千円
受取配当金	4,755千円
投資有価証券償還益	90,952千円
投資有価証券売却益	48,142千円
※3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	15,001千円
投資有価証券売却損	8,258千円
※4.特別損失のうち主要なもの	
システム統合関連費用	145,261千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

発行済株式数に関する事項

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

(リース取引関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	1,179,776千円
1年超	2,903,862千円
合 計	4,083,639千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第37期中間会計期間（2021年9月30日）

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	38,529,337	38,529,337	—
(2)顧客分別金信託	300,038	300,038	—
(3)未収委託者報酬	10,909,133	10,909,133	—
(4)未収運用受託報酬	2,723,571	2,723,571	—
(5)未収投資助言報酬	399,072	399,072	—
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	21,960,848	21,960,848	—
(7)投資その他の資産			
①長期差入保証金	1,408,170	1,408,170	—
資産計	76,230,173	76,230,173	—
(1)顧客からの預り金	12,736	12,736	—
(2)未払金			
①未払手数料	4,996,181	4,996,181	—
負債計	5,008,917	5,008,917	—

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6) 投資有価証券

①その他有価証券

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

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

(7) 投資その他の資産

①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おります。

負 債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金①未払手数料

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

（注２）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6)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。

また時価をもって中間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。

（有価証券関係）

第37期中間会計期間（2021年9月30日）

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,269,607	14,102,355	2,167,252
小計	16,269,607	14,102,355	2,167,252
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,691,240	6,001,639	△310,398
小計	5,691,240	6,001,639	△310,398
合計	21,960,848	20,103,994	1,856,853

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 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。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	32,740,035	4,392,826	633,982	117,708	37,884,552

(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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,579円18銭
1株当たり中間純利益	60円41銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

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
株式会社イオン銀行	51,250百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	

※資本金の額は、2021年3月末現在。

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。）

該当ありません。

第3 【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 羽 太 典 明 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 菅 野 雅 子 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 佐 藤 栄 裕 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財

務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年6月8日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松 井 貴 志 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの2020年4月28日から2021年4月26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、イオン・バランス戦略ファンドの2021年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに

対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月22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
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅 野 雅 子
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐 藤 栄 裕
--------------------	-------	---------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月30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

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松 井 貴 志

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの2021年4月27日から2021年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、イオン・バランス戦略ファンドの2021年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年4月27日から2021年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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