【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6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】	三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）
【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】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）
以下「当ファンド」といいます。また、「＜2020＞」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
＊ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友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】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。
※「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。
基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「ＤＣ2020」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】

ありません。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2022年1月7日から2022年7月7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）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　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。
ニ　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、国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、西暦2020年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。
※以下、上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ　委託会社は、受託会社と合意の上、金１兆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、円短期金融資産）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、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年１回	目論見書または信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

（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 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、円短期金融資産）資産配分変更型）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり なし

（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】

2008年３月31日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年１月13日	「スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2020」から「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

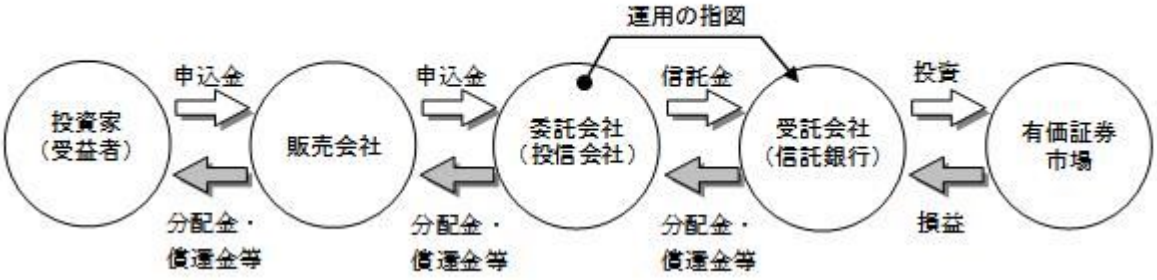
イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

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

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10月29日現在）

（ロ）会社の沿革

1985年７月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年２月20日	証券投資顧問業の登録
1987年６月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年１月１日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年２月５日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年１月27日	証券投資信託委託業の認可取得

2002年12月１日　住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年４月１日　トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年４月１日　大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更

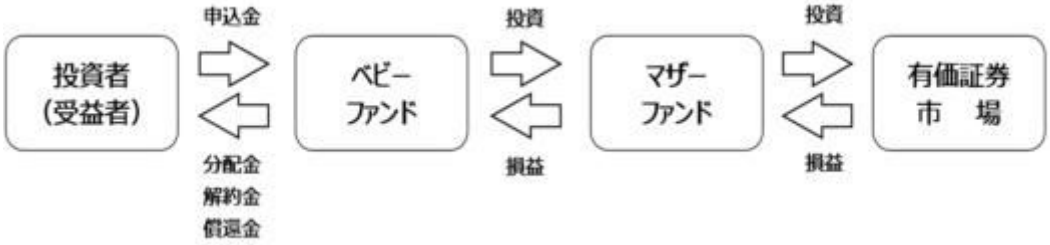
（ハ）大株主の状況

（2021年10月29日現在）

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

ハ　ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

（１）【投資方針】

「（１）投資方針」には、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率が異なる「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2025（４資産タイプ）（以下、「＜2025＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2030（４資産タイプ）（以下、「＜2030＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2035（４資産タイプ）（以下、「＜2035＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2040（４資産タイプ）（以下、「＜2040＞」ということがあります。）」および「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2045（４資産タイプ）（以下、「＜2045＞」ということがあります。）」の情報を合わせて説明している部分があります。

イ　基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

ロ　投資態度

（イ）国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とする５つのマザーファンドに分散投資を行います。

国内株式	**国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）**
国内債券	**国内債券パッシブ・マザーファンド**
外国株式	**外国株式インデックス・マザーファンド**
外国債券	**外国債券パッシブ・マザーファンド**
短期金融資産	**マネーインカム・マザーファンド**

（ロ）長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

（ハ）基本資産配分は、西暦2020年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年１回決算時に変更します。
なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

（ニ）組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要に応じて調整を行うものとします。

[2021年４月現在の基本資産配分（安定運用期間*）]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
8.0%	3.5%	7.0%	28.5%	53.0%

＊2020年4月にターゲットイヤーに到達し、安定運用期間に移行しました。

（ホ）実質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。

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

ファンドの特色

1 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。

□実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

□ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。

2 基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。
基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。

3 実質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。

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

ファンドのしくみ

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

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

各マザーファンドの運用プロセス

▶国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

■ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄*の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

*2022年4月4日以降は、TOPIX（東証株価指数）採用銘柄とする予定です。

▶国内債券パッシブ・マザーファンド

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

■ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター（債券種別）配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA－BPI（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。なお、事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA－BPI（総合）から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。

▶外国株式インデックス・マザーファンド

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

■ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

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

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

▶外国債券パッシブ・マザーファンド

■主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

■ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に近づけたポートフォリオを構築します。

▶マネーインカム・マザーファンド

■主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

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

・TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA－BPI（総合）、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
・指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券
２．デリバティブ取引にかかる権利
３．約束手形
４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

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

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

なお、第１号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第１号の証券ま

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

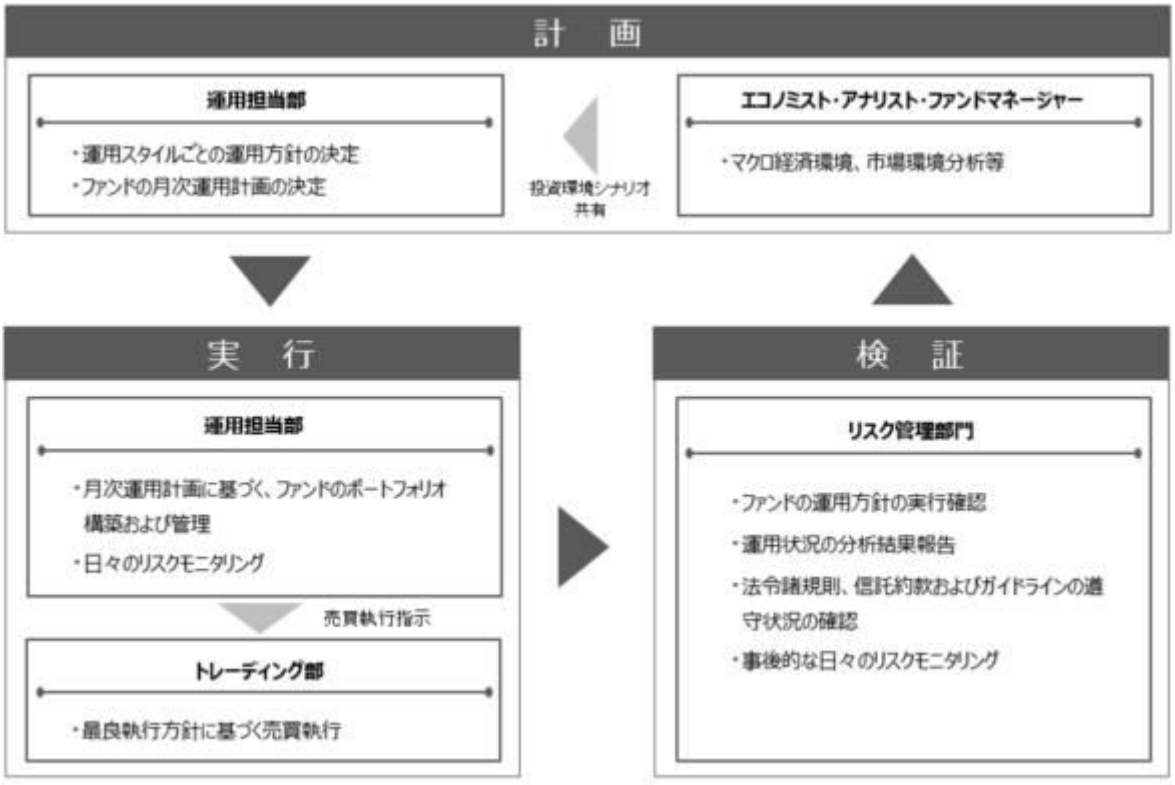
ハ　投資対象とする金融商品

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

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

（３）【運用体制】

イ　ファンドの運用体制



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

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎年１回（原則として４月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

イ　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

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、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益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、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ　株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

ロ　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ハ　マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

ニ　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

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

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

Ⅱ　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　投資する株式等の範囲

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

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

ロ　信用取引の指図

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

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

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

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

ハ　先物取引等の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

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

（ハ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ　スワップ取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

（ハ）スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

ホ　金利先渡取引および為替先渡取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

（ハ）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合に

は、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

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

ヘ　有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

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

ト　有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ　有価証券の借入れの指図

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

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ　外国為替予約取引の指図

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

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

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

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

ル　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。

（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。

ヲ　デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

III　法令に基づく投資制限

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をする

ことができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第３項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

＊2022年4月4日以降は、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式とする予定です。

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第10号、第13号、第18号および第19号に掲げるものならびに短期社債等に投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

（ヘ）デリバティブ取引（法人税法第61 条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクお

よび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第５号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

（外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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た運用を行います。

ロ　投資態度

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

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

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

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

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

（マネーインカム・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

円貨建の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指しま

す。

ロ　投資態度

（イ）主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

３【投資リスク】

イ　ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

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

（ヘ）市場流動性リスク

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

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

（チ）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生じた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。

（リ）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。

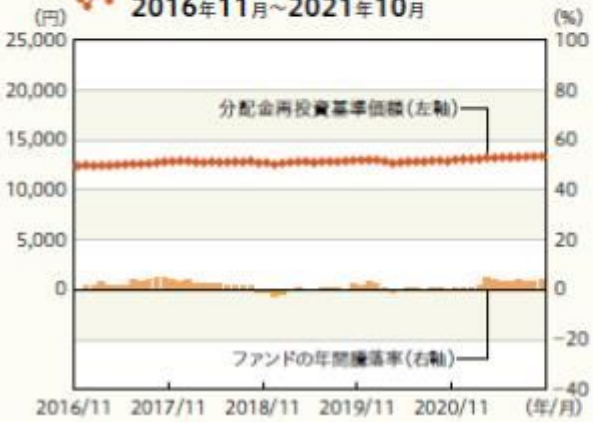
（参考情報）投資リスクの定量的比較

［ 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。

<2020>

年間騰落率：2016年11月～2021年10月
分配金再投資基準価額：2016年11月～2021年10月



※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：2016年11月～2021年10月
他の資産クラス：2016年11月～2021年10月

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
◆平均値	1.5%	10.1%	15.6%	13.7%	0.2%	3.0%	4.0%

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

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

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

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.08%	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0.1%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

（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0.0055%（税抜き0.005%）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、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

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

（５）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について

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

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

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

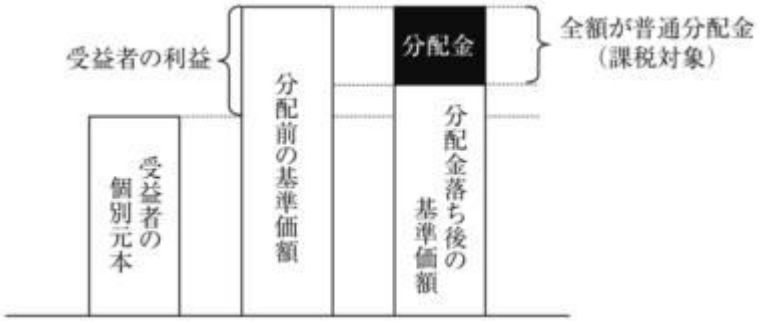
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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

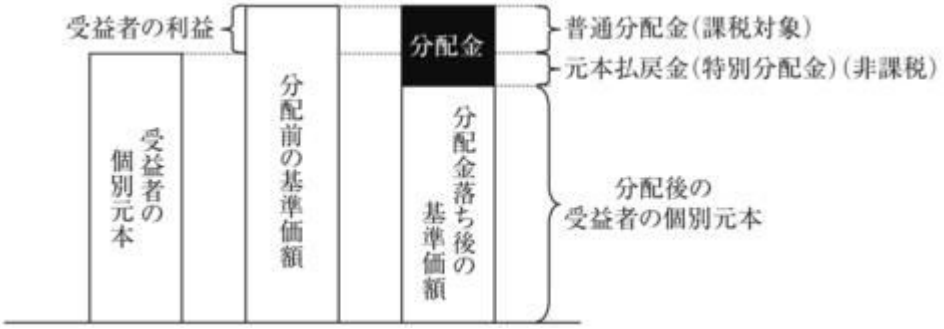
ハ　収益分配金の課税について

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

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



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



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

ニ　個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

ⅰ．収益分配時

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

ⅱ．一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ＥＴＦ）、上場不動産投資信託（ＲＥＩＴ）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。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。

※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10月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

2021年10月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	200,330,929	99.29
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,432,702	0.71
合計（純資産総額）		201,763,631	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

イ　主要投資銘柄

2021年10月29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	マネーインカム・マザーファンド	105,461,015	1.0081	106,315,574	1.0081	106,315,249	52.69
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	44,658,038	1.2766	57,009,347	1.2789	57,113,164	28.31
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）	4,679,600	3.2404	15,163,807	3.3427	15,642,498	7.75
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	7,016,735	1.9399	13,612,006	2.0063	14,077,675	6.98
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	1,226,514	5.0833	6,234,739	5.8559	7,182,343	3.56

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10月29日現在

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	99.29
合　計	99.29

②【投資不動産物件】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

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4期　（2012年 4月13日）	31,721,491	31,721,491	9,457	9,457
第5期　（2013年 4月15日）	42,888,261	42,888,261	10,830	10,830
第6期　（2014年 4月14日）	55,009,117	55,009,117	11,187	11,187
第7期　（2015年 4月13日）	104,467,637	104,467,637	12,311	12,311
第8期　（2016年 4月13日）	129,732,609	129,732,609	12,190	12,190
第9期　（2017年 4月13日）	161,985,897	161,985,897	12,318	12,318
第10期　（2018年 4月13日）	179,972,966	179,972,966	12,731	12,731
第11期　（2019年 4月15日）	199,373,347	199,373,347	12,797	12,797
第12期　（2020年 4月13日）	203,039,722	203,039,722	12,643	12,643
第13期　（2021年 4月13日）	193,602,897	193,602,897	13,188	13,188
2020年10月末日	201,596,801	-	12,820	-
11月末日	203,599,792	-	12,989	-
12月末日	194,562,524	-	13,037	-
2021年 1月末日	194,553,485	-	13,036	-
2月末日	189,936,220	-	13,043	-
3月末日	193,621,434	-	13,172	-
4月末日	194,973,372	-	13,168	-
5月末日	195,757,030	-	13,199	-
6月末日	201,468,281	-	13,221	-
7月末日	200,983,090	-	13,226	-
8月末日	198,967,042	-	13,264	-
9月末日	200,245,871	-	13,280	-
10月末日	201,763,631	-	13,310	-

②【分配の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第4期	2011年 4月14日～2012年 4月13日	-
第5期	2012年 4月14日～2013年 4月15日	-
第6期	2013年 4月16日～2014年 4月14日	-
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	-
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	-
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	-
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	-
第11期	2018年 4月14日～2019年 4月15日	-
第12期	2019年 4月16日～2020年 4月13日	-
第13期	2020年 4月14日～2021年 4月13日	-

③【収益率の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

	収益率（％）
第4期	1.1
第5期	14.5
第6期	3.3
第7期	10.0
第8期	△1.0
第9期	1.1
第10期	3.4
第11期	0.5
第12期	△1.2
第13期	4.3
第14期（中間期）	0.5

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第4期	7,500,149	2,033,603
第5期	10,218,010	4,161,181
第6期	11,527,812	1,957,719
第7期	41,478,096	5,788,485
第8期	28,443,083	6,879,463
第9期	31,933,933	6,850,483
第10期	27,997,450	18,134,365

第11期	21,566,244	7,137,639
第12期	21,524,938	16,735,328
第13期	16,974,194	30,759,392
第14期（中間期）	14,074,340	10,101,292

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2021年10月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	197,214,617,440	97.79
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,463,396,454	2.21
合計（純資産総額）		201,678,013,894	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	5,479,375,000	2.72
合計	買建	-	5,479,375,000	2.72

国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年10月29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	108,320,970,010	78.59
地方債証券	日本	10,504,985,600	7.62
特殊債券	日本	10,086,199,267	7.32
社債券	日本	5,343,105,100	3.88
	フランス	201,018,200	0.15
	小計	5,544,123,300	4.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,375,973,835	2.45
合計（純資産総額）		137,832,252,012	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年10月29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	232,381,352,006	66.66
	イギリス	13,976,690,802	4.01
	カナダ	12,259,101,369	3.52
	スイス	11,166,018,316	3.20
	フランス	10,706,274,031	3.07
	ドイツ	9,171,501,113	2.63

	オランダ	7,059,896,419	2.03
	アイルランド	6,405,247,808	1.84
	オーストラリア	6,321,835,714	1.81
	スウェーデン	3,689,963,240	1.06
	デンマーク	2,819,869,514	0.81
	スペイン	2,515,347,642	0.72
	香港	2,220,940,969	0.64
	イタリア	1,920,158,151	0.55
	ジャージィー	1,365,377,077	0.39
	フィンランド	1,293,951,227	0.37
	シンガポール	921,614,119	0.26
	ベルギー	856,185,168	0.25
	バミューダ	837,005,847	0.24
	ノルウェー	695,847,463	0.20
	イスラエル	648,989,321	0.19
	ケイマン諸島	645,981,416	0.19
	ニュージーランド	343,028,354	0.10
	ルクセンブルグ	331,761,302	0.10
	オランダ領キュラソー	278,001,036	0.08
	オーストリア	223,905,861	0.06
	ポルトガル	161,630,633	0.05
	リベリア	113,866,933	0.03
	パナマ	100,887,133	0.03
	マン島	93,190,998	0.03
	パプアニューギニア	39,684,917	0.01
	小計	331,565,105,899	95.11
投資証券	アメリカ	6,682,447,511	1.92
	オーストラリア	777,974,421	0.22
	イギリス	201,453,116	0.06
	香港	164,354,823	0.05
	フランス	155,239,677	0.04
	シンガポール	147,547,402	0.04
	カナダ	37,377,835	0.01
	小計	8,166,394,785	2.34
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,893,782,071	2.55
合計（純資産総額）		348,625,282,755	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	418,788,496	0.12
合計	買建	-	418,788,496	0.12
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,467,262,513	0.42

合計	買建	-	1,467,262,513	0.42
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,248,309,637	2.08
合計	買建	-	7,248,309,637	2.08
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	301,011,471	0.09
合計	買建	-	301,011,471	0.09

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	657,714,970	△0.19
為替予約取引	買建	日本	1,308,071,093	0.38

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年10月29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	74,194,629,623	45.81
	フランス	16,343,106,163	10.09
	イタリア	14,592,837,704	9.01
	ドイツ	11,952,257,518	7.38
	イギリス	9,937,705,836	6.14
	スペイン	9,619,702,311	5.94
	ベルギー	3,707,586,251	2.29
	カナダ	3,155,193,172	1.95
	オランダ	3,054,852,087	1.89
	オーストラリア	2,914,263,110	1.80
	オーストリア	2,385,960,744	1.47
	アイルランド	1,348,604,902	0.83
	メキシコ	1,111,291,831	0.69
	フィンランド	955,311,882	0.59
	ポーランド	851,491,523	0.53
	デンマーク	822,597,632	0.51
	マレーシア	759,497,684	0.47
	イスラエル	737,106,280	0.46
	シンガポール	678,533,214	0.42
	スウェーデン	481,076,928	0.30
	ノルウェー	410,696,172	0.25
	小計	160,014,302,567	98.80
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,950,111,652	1.20
合計（純資産総額）		161,964,414,219	100.00

マネーインカム・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
特殊債券	日本	1,573,747,942	76.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	481,398,794	23.42

合計（純資産総額）	2,055,146,736	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2021年10月29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	3,642,200	1,417.85	5,164,100,049	2,006.50	7,308,074,300	3.62
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	450,500	9,776.12	4,404,141,210	13,140.00	5,919,570,000	2.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	65,200	53,726.46	3,502,965,192	68,510.00	4,466,852,000	2.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	530,100	4,682.05	2,481,957,183	7,572.00	4,013,917,200	1.99
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	4,546,100	452.71	2,058,064,931	622.50	2,829,947,250	1.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	825,000	2,484.15	2,049,420,003	3,188.00	2,630,100,000	1.30
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	423,300	7,300.64	3,090,360,912	6,164.00	2,609,221,200	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	121,000	17,305.44	2,093,958,240	20,255.00	2,450,855,000	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	45,600	37,204.89	1,696,542,848	52,850.00	2,409,960,000	1.19
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	140,300	13,959.64	1,958,538,001	16,725.00	2,346,517,500	1.16
日本	株式	日本電産	電気機器	186,400	13,234.08	2,466,832,221	12,570.00	2,343,048,000	1.16
日本	株式	ダイキン工業	機械	91,600	23,621.70	2,163,747,750	24,890.00	2,279,924,000	1.13
日本	株式	日立製作所	電気機器	345,800	4,053.54	1,401,712,884	6,554.00	2,266,373,200	1.12
日本	株式	任天堂	その他製品	40,600	59,392.57	2,411,338,342	50,200.00	2,038,120,000	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	530,400	2,669.22	1,415,755,711	3,612.00	1,915,804,800	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	565,900	2,889.66	1,635,259,834	3,349.00	1,895,199,100	0.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	211,200	9,129.71	1,928,195,664	8,653.00	1,827,513,600	0.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	490,400	3,063.90	1,502,537,404	3,721.00	1,824,778,400	0.90
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	515,000	3,018.25	1,554,398,750	3,528.00	1,816,920,000	0.90
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	565,200	3,744.96	2,116,651,392	3,203.00	1,810,335,600	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,069,000	1,386.74	1,482,428,950	1,554.50	1,661,760,500	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	565,000	3,651.53	2,063,113,928	2,867.00	1,619,855,000	0.80
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	494,700	2,779.22	1,374,880,848	3,242.00	1,603,817,400	0.80
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	81,200	17,759.92	1,442,105,690	17,940.00	1,456,728,000	0.72
日本	株式	ＳＭＣ	機械	21,100	66,349.30	1,399,970,148	67,940.00	1,433,534,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	549,700	1,806.38	992,967,360	2,592.00	1,424,822,400	0.71
日本	株式	ファナック	電気機器	63,100	25,360.58	1,600,252,624	22,310.00	1,407,761,000	0.70

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	233,700	5,201.41	1,215,570,612	5,998.00	1,401,732,600	0.70
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	905,600	1,336.47	1,210,307,232	1,505.00	1,362,928,000	0.68
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	277,000	3,378.04	935,717,153	4,782.00	1,324,614,000	0.66

ロ　種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式（国内）	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.21
	建設業	2.25
	食料品	3.33
	繊維製品	0.47
	パルプ・紙	0.21
	化学	6.80
	医薬品	4.82
	石油・石炭製品	0.41
	ゴム製品	0.68
	ガラス・土石製品	0.77
	鉄鋼	0.79
	非鉄金属	0.69
	金属製品	0.61
	機械	5.31
	電気機器	18.31
	輸送用機器	7.81
	精密機器	2.80
	その他製品	2.12
	電気・ガス業	1.03
	陸運業	3.06
	海運業	0.45
	空運業	0.42
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.24
	卸売業	4.95
	小売業	4.26
	銀行業	4.56
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.92
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.95
	サービス業	6.45
合　計		97.79

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2021年10月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(％)	償還期限	投資比率(％)
日本	国債証券	４２７　２年国債	3,300,000,000	100.28	3,309,170,500	100.21	3,306,930,000	0.005	2023/08/01	2.40
日本	国債証券	１４７　５年国債	1,700,000,000	100.51	1,708,623,500	100.40	1,706,715,000	0.005	2026/03/20	1.24
日本	国債証券	３６３　１０年国債	1,340,000,000	100.76	1,350,183,600	100.19	1,342,559,400	0.100	2031/06/20	0.97
日本	国債証券	３３０　１０年国債	1,285,000,000	102.18	1,312,961,600	101.71	1,306,960,650	0.800	2023/09/20	0.95
日本	国債証券	１４６　５年国債	1,290,000,000	100.96	1,302,384,000	100.79	1,300,165,200	0.100	2025/12/20	0.94
日本	国債証券	３６０　１０年国債	1,240,000,000	100.51	1,246,324,000	100.58	1,247,130,000	0.100	2030/09/20	0.90
日本	国債証券	１４５　５年国債	1,170,000,000	100.95	1,181,115,000	100.76	1,178,892,000	0.100	2025/09/20	0.86
日本	国債証券	１４４　５年国債	1,150,000,000	100.89	1,160,235,000	100.71	1,158,165,000	0.100	2025/06/20	0.84
日本	国債証券	３５８　１０年国債	1,100,000,000	100.70	1,107,744,000	100.75	1,108,283,000	0.100	2030/03/20	0.80
日本	国債証券	４２５　２年国債	1,090,000,000	100.23	1,092,513,000	100.19	1,092,071,000	0.005	2023/06/01	0.79
日本	国債証券	３５７　１０年国債	1,070,000,000	100.89	1,079,483,500	100.77	1,078,260,400	0.100	2029/12/20	0.78
日本	国債証券	３５９　１０年国債	1,070,000,000	100.68	1,077,275,600	100.69	1,077,372,300	0.100	2030/06/20	0.78
日本	国債証券	１４８　５年国債	1,070,000,000	100.53	1,075,722,300	100.40	1,074,226,500	0.005	2026/06/20	0.78
日本	国債証券	６９　２０年国債	1,020,000,000	106.29	1,084,137,600	105.24	1,073,417,400	2.100	2024/03/20	0.78
日本	国債証券	６４　２０年国債	1,025,000,000	104.72	1,073,421,000	103.79	1,063,806,500	1.900	2023/09/20	0.77
日本	国債証券	６５　２０年国債	1,020,000,000	105.22	1,073,244,000	104.28	1,063,625,400	1.900	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	３５６　１０年国債	1,000,000,000	100.92	1,009,200,000	100.83	1,008,280,000	0.100	2029/09/20	0.73
日本	国債証券	３６１　１０年国債	990,000,000	100.38	993,762,000	100.45	994,494,600	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	３６２　１０年国債	930,000,000	100.25	932,280,800	100.33	933,031,800	0.100	2031/03/20	0.68
日本	国債証券	８４　２０年国債	850,000,000	109.69	932,373,500	108.67	923,712,000	2.000	2025/12/20	0.67
日本	国債証券	３２９　１０年国債	890,000,000	101.93	907,177,000	101.48	903,172,000	0.800	2023/06/20	0.66
日本	国債証券	１４　３０年国債	692,000,000	128.05	886,112,920	126.89	878,051,120	2.400	2034/03/20	0.64
日本	国債証券	７０　２０年国債	780,000,000	107.78	840,660,600	106.60	831,472,200	2.400	2024/06/20	0.60

日本	国債証券	３３３　１０年国債	815,000,000	102.08	831,927,550	101.67	828,610,500	0.600	2024/03/20	0.60
日本	国債証券	８８　２０年国債	742,000,000	112.20	832,501,740	111.09	824,310,060	2.300	2026/06/20	0.60
日本	国債証券	３３８　１０年国債	805,000,000	102.01	821,204,650	101.68	818,507,900	0.400	2025/03/20	0.59
日本	国債証券	３４４　１０年国債	811,000,000	101.02	819,231,650	100.88	818,153,020	0.100	2026/09/20	0.59
日本	国債証券	３５５　１０年国債	810,000,000	100.88	817,128,000	100.88	817,111,800	0.100	2029/06/20	0.59
日本	国債証券	３３２　１０年国債	793,000,000	101.88	807,924,260	101.51	804,958,440	0.600	2023/12/20	0.58
日本	国債証券	７２　２０年国債	753,000,000	107.40	808,729,530	106.35	800,807,970	2.100	2024/09/20	0.58

ロ　種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.59
地方債証券	7.62
特殊債券	7.32
社債券	4.02
合　計	97.55

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10月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	871,554	13,302.80	11,594,108,638	17,342.63	15,115,040,202	4.34
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	373,728	24,586.82	9,188,783,438	36,868.86	13,778,926,991	3.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	23,690	365,357.83	8,655,327,089	391,771.61	9,281,069,485	2.66
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	42,736	68,291.23	2,918,494,035	122,427.14	5,232,046,118	1.50
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,714	204,816.71	3,218,489,746	331,573.12	5,210,339,954	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,230	205,284.61	3,126,484,608	332,209.67	5,059,553,252	1.45
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	125,292	31,676.42	3,968,801,876	36,024.30	4,513,556,144	1.29
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	130,062	15,216.89	1,979,139,513	28,350.43	3,687,314,237	1.06

アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	157,992	13,914.34	2,198,355,147	19,364.82	3,059,486,831	0.88
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,467	38,502.42	1,904,598,980	51,769.86	2,560,899,902	0.73
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,048	16,450.38	2,254,491,422	18,511.16	2,536,917,387	0.73
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	55,494	31,443.40	1,744,919,784	42,236.36	2,343,864,667	0.67
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	69,189	26,427.14	1,828,467,271	32,932.47	2,278,564,832	0.65
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	150,863	12,791.33	1,929,738,607	14,957.62	2,256,551,667	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	402,525	3,327.12	1,339,249,340	5,431.15	2,186,174,700	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	88,428	24,005.69	2,122,775,105	23,852.51	2,109,230,001	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	128,383	15,740.40	2,020,799,581	16,218.44	2,082,171,417	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	21,953	49,187.47	1,079,812,511	92,726.57	2,035,626,347	0.58
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	94,639	16,814.92	1,591,347,594	19,287.53	1,825,352,135	0.52
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	25,076	54,368.36	1,363,341,020	72,666.96	1,822,196,628	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	23,263	55,947.39	1,301,504,211	76,619.26	1,782,393,926	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	46,455	38,555.82	1,791,110,480	37,855.52	1,758,578,186	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	50,706	27,827.95	1,411,043,838	33,916.85	1,719,788,029	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	36,777	37,869.00	1,392,708,044	44,503.66	1,636,711,250	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	220,715	4,630.91	1,022,112,342	7,310.12	1,613,452,628	0.46

アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	58,324	24,235.82	1,413,529,991	26,920.47	1,570,109,264	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	20,664	51,630.05	1,066,883,367	70,483.36	1,456,468,086	0.42
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	290,792	4,237.65	1,232,275,277	4,908.27	1,427,285,824	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	221,654	4,892.48	1,084,438,601	6,392.80	1,416,989,868	0.41
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	239,809	5,901.00	1,415,113,496	5,899.47	1,414,746,720	0.41

ロ　種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式（外国）	エネルギー	3.39
	素材	3.96
	資本財	5.99
	商業・専門サービス	1.23
	運輸	1.89
	自動車・自動車部品	2.45
	耐久消費財・アパレル	1.87
	消費者サービス	1.79
	小売	5.54
	食品・生活必需品小売り	1.36
	食品・飲料・タバコ	3.58
	家庭用品・パーソナル用品	1.61
	ヘルスケア機器・サービス	5.01
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.22
	銀行	6.12
	各種金融	4.69
	保険	2.96
	不動産	0.35
	ソフトウェア・サービス	12.34
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.82
	半導体・半導体製造装置	4.68
	電気通信サービス	1.43

	公益事業	2.74
	メディア・娯楽	7.09
投資証券	―	2.34
合　計		97.45

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10月29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	11,911.70	1,780,799,688	11,615.14	1,736,463,670	1.625	2026/05/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,202.66	1,622,953,175	11,929.55	1,586,630,526	2.250	2026/03/31	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,933.34	1,164,000,905	12,423.22	1,118,089,947	2.875	2028/05/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,304.10	1,045,848,855	12,055.16	1,024,688,445	2.500	2026/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	10,820.35	919,729,545	10,958.47	931,469,951	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	11,071.46	974,288,304	10,534.82	927,064,329	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,357.23	908,578,523	11,303.46	904,276,677	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,392.75	877,242,012	11,339.83	873,167,130	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,304.14	870,418,817	11,249.24	866,191,316	0.125	2024/02/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,800,000	11,176.03	871,730,683	10,761.25	839,377,700	0.375	2027/09/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	11,715.09	831,771,060	11,485.90	815,498,816	1.375	2026/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	11,103.25	832,743,760	10,561.88	792,140,654	0.625	2030/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	10,973.20	790,070,416	10,871.85	782,773,450	0.625	2027/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	12,085.43	785,552,948	11,773.26	765,261,677	2.125	2024/03/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,932.05	765,243,200	10,737.27	751,608,774	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	14,896.10	804,389,307	13,835.23	747,102,440	3.000	2048/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	10,895.27	729,983,056	10,942.90	733,174,114	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	11,978.54	742,669,765	11,683.57	724,381,398	1.750	2024/06/30	0.45
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000	16,968.01	746,592,264	16,189.31	712,329,637	3.500	2030/03/01	0.44

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,255.05	698,537,671	11,893.97	677,956,524	2.500	2024/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,255.05	686,282,625	11,890.00	665,839,757	2.375	2024/08/15	0.41
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000	13,698.40	657,523,103	13,549.44	650,373,313	0.000	2030/08/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,570.22	651,370,682	13,458.63	646,014,209	0.000	2024/03/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,677.02	619,267,339	11,125.79	645,295,951	1.875	2051/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,351.90	647,058,485	11,285.27	643,260,462	0.125	2023/10/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,287.90	626,683,137	11,924.67	608,157,916	2.750	2024/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,249.65	624,732,025	11,870.44	605,392,665	2.250	2024/11/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	3,850,000	16,347.20	629,367,108	15,665.40	603,117,881	2.750	2027/10/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,500,000	13,760.28	619,212,726	13,267.71	597,046,774	0.000	2029/11/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,031.20	625,497,592	12,319.33	591,327,708	2.750	2028/02/15	0.37

ロ　種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.80
合　計	98.80

マネーインカム・マザーファンド

イ　主要投資銘柄

2021年10月29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	特殊債券	１４　政保政策投資Ｃ	200,000,000	100.84	201,678,000	100.34	200,674,600	0.900	2022/03/14	9.76
日本	特殊債券	４２　政保日本政策	200,000,000	100.08	200,150,000	100.03	200,067,200	0.001	2022/09/26	9.73
日本	特殊債券	１７０　政保道路機構	100,000,000	100.93	100,926,000	100.70	100,701,900	0.801	2022/08/31	4.90
日本	特殊債券	１６６　政保道路機構	100,000,000	101.01	101,013,000	100.62	100,620,400	0.895	2022/06/30	4.90
日本	特殊債券	１６３　政保道路機構	100,000,000	101.02	101,019,000	100.54	100,539,300	0.901	2022/05/31	4.89
日本	特殊債券	３４政保地方公共団	100,000,000	100.73	100,731,000	100.34	100,337,300	0.900	2022/03/14	4.88
日本	特殊債券	１５７　政保道路機構	100,000,000	100.69	100,693,000	100.30	100,298,100	0.900	2022/02/28	4.88
日本	特殊債券	１５　政保政策投資Ｂ	100,000,000	101.40	101,396,000	100.30	100,295,200	2.000	2021/12/22	4.88

日本	特殊債券	１５５　政保道路機構	100,000,000	100.57	100,574,000	100.23	100,228,300	0.900	2022/01/31	4.88
日本	特殊債券	１５２　政保道路機構	100,000,000	100.79	100,790,000	100.18	100,177,900	1.100	2021/12/28	4.87
日本	特殊債券	１９　政保日本政策	100,000,000	100.76	100,757,000	100.15	100,147,800	1.100	2021/12/17	4.87
日本	特殊債券	２２９　政保預金保険	100,000,000	100.20	100,199,000	100.10	100,103,200	0.100	2022/07/29	4.87
日本	特殊債券	３０政保地方公共団	100,000,000	100.60	100,600,000	100.04	100,038,000	1.000	2021/11/15	4.87
日本	特殊債券	４０政保地方公共団	69,000,000	100.92	69,636,870	100.75	69,518,742	0.819	2022/09/16	3.38

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10月29日現在

種類	投資比率(%)
特殊債券	76.58
合　計	76.58

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2021年10月29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	275	日本・円	5,509,177,500	5,479,375,000	2.72

（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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年10月29日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価(円)	評価額	時価(円)	投資比率(%)

株価指数先物取引	イギリス	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ　１００　ＩＤＸ　ＦＵＴ　ＤＥＣ２１　2021年12月	買建	37	イギリス・ポンド	2,616,179.00	410,216,867	2,670,845.00	418,788,496	0.12
	ドイツ	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯ　ＳＴＯＸＸ　５０　ＤＥＣ２１　2021年12月	買建	262	ユーロ	10,852,634.00	1,440,904,216	11,051,160.00	1,467,262,513	0.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＤＥＣ２１　2021年12月	買建	278	アメリカ・ドル	61,634,564.00	7,006,000,889	63,766,250.00	7,248,309,637	2.08
	オーストラリア	シドニー先物取引所	ＳＰＩ２００ＦＵＴＵＲＥＳ　ＤＥＣ２１　2021年12月	買建	19	オーストラリア・ドル	3,488,010.50	298,538,818	3,516,900.00	301,011,471	0.09

（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10月29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	3,860,000.00	439,499,600	438,755,006	△0.13
	ユーロ	売建	870,000.00	115,132,120	115,512,833	△0.03
	イギリス・ポンド	売建	170,000.00	26,570,150	26,655,184	△0.01
	カナダ・ドル	売建	240,000.00	22,092,480	22,067,544	△0.01
	スイス・フラン	売建	150,000.00	18,588,300	18,710,370	△0.01
	オーストラリア・ドル	売建	170,000.00	14,507,460	14,550,130	△0.00
	スウェーデン・クローナ	売建	540,000.00	7,155,000	7,209,000	△0.00
	香港・ドル	売建	360,000.00	5,269,680	5,262,840	△0.00
	デンマーク・クローネ	売建	280,000.00	4,966,920	4,998,000	△0.00

	シンガポール・ドル	売建	20,000.00	1,687,180	1,690,522	△0.00
	ノルウェー・クローネ	売建	90,000.00	1,214,190	1,225,800	△0.00
	イスラエル・シュケル	売建	30,000.00	1,071,210	1,077,741	△0.00
	アメリカ・ドル	買建	8,830,000.00	1,005,404,817	1,003,666,254	0.29
	ユーロ	買建	500,000.00	66,186,000	66,386,450	0.02
	イギリス・ポンド	買建	390,000.00	61,201,608	61,149,099	0.02
	スイス・フラン	買建	360,000.00	44,778,686	44,905,874	0.01
	カナダ・ドル	買建	430,000.00	39,571,786	39,537,323	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	360,000.00	30,852,309	30,811,851	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	1,910,000.00	25,369,312	25,498,500	0.01
	香港・ドル	買建	860,000.00	12,592,356	12,571,944	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	700,000.00	12,472,268	12,495,000	0.00
	シンガポール・ドル	買建	50,000.00	4,231,044	4,226,279	0.00
	ノルウェー・クローネ	買建	230,000.00	3,134,923	3,132,600	0.00
	イスラエル・シュケル	買建	80,000.00	2,861,078	2,873,967	0.00
	ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	816,606	815,952	0.00

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・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10月29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

<2020>

※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。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

<2020>

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.71
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	マネーインカム・マザーファンド	52.69
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	28.31
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(旧号)	7.75
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	6.98
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	3.56

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

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.21
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　2.72%

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	3.62
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.99
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.40
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.30
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.19
日本	株式	HOYA	精密機器	1.16

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	78.59
地方債証券	日本	7.62
特殊債券	日本	7.32
社債券	日本	3.88
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.45
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	427　2年国債	0.005	2023/08/01	2.40
日本	国債証券	147　5年国債	0.005	2026/03/20	1.24
日本	国債証券	363　10年国債	0.100	2031/06/20	0.97
日本	国債証券	330　10年国債	0.800	2023/09/20	0.95
日本	国債証券	146　5年国債	0.100	2025/12/20	0.94
日本	国債証券	360　10年国債	0.100	2030/09/20	0.90
日本	国債証券	145　5年国債	0.100	2025/09/20	0.86
日本	国債証券	144　5年国債	0.100	2025/06/20	0.84
日本	国債証券	358　10年国債	0.100	2030/03/20	0.80
日本	国債証券	425　2年国債	0.005	2023/06/01	0.79

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	66.66
	イギリス	4.01
	カナダ	3.52
	スイス	3.20
	フランス	3.07
	ドイツ	2.63
	その他	12.02
投資証券	アメリカ・その他	2.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.55
合計(純資産総額)		100.00

※指数先物取引の買建て　2.71%

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	4.34
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.95
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.66
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.50
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.45
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.29
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.88
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.73

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	45.81
	フランス	10.09
	イタリア	9.01
	ドイツ	7.38
	イギリス	6.14
	スペイン	5.94
	ベルギー	2.29
	その他	12.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.20
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	0.52

■マネーインカム・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	76.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23.42
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	14　政保政策投資C	0.900	2022/03/14	9.76
日本	特殊債券	42　政保日本政策	0.001	2022/09/26	9.73
日本	特殊債券	170　政保道路機構	0.801	2022/08/31	4.90
日本	特殊債券	166　政保道路機構	0.895	2022/06/30	4.90
日本	特殊債券	163　政保道路機構	0.901	2022/05/31	4.89
日本	特殊債券	34政保地方公共団	0.900	2022/03/14	4.88
日本	特殊債券	157　政保道路機構	0.900	2022/02/28	4.88
日本	特殊債券	15　政保政策投資B	2.000	2021/12/22	4.88
日本	特殊債券	155　政保道路機構	0.900	2022/01/31	4.88
日本	特殊債券	152　政保道路機構	1.100	2021/12/28	4.87

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■<2020>

※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。
※2021年のファンドの収益率は、年初から2021年10月29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に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の２つの申込方法が

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

（ロ）原則として午後３時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。
なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

ロ　申込価額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ　申込手数料
ありません。

ニ　申込単位
お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先
手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所
販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日
取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。
お買付けの販売会社にお申し出ください。
解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。
なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。
解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかか

るファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
一部解約金は、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。
一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。
解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。
委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ　基準価額の算出方法

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

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「ＤＣ2020」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】

2008年３月31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14日から翌年４月13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１億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

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

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

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

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

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

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

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

（ロ）償還金

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

ハ　信託約款の変更等

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

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

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

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

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

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

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト　公告

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

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

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

チ　運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

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

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

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権

利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

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

ホ　帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期（2020年 4月14日から2021年 4月13日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2020年 4月13日現在）	第13期 （2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,031,051	894,163
コール・ローン	716,735	463,407
親投資信託受益証券	201,771,738	192,391,161
未収入金	-	2,410,000
流動資産合計	203,519,524	196,158,731
資産合計	203,519,524	196,158,731
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,324,116
未払受託者報酬	33,867	32,348
未払委託者報酬	440,239	194,038
未払利息	1	1
その他未払費用	5,695	5,331
流動負債合計	479,802	2,555,834
負債合計	479,802	2,555,834
純資産の部		
元本等		
元本	160,588,854	146,803,656
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	42,450,868	46,799,241
元本等合計	203,039,722	193,602,897
純資産合計	203,039,722	193,602,897
負債純資産合計	203,519,524	196,158,731

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 自　2019年 4月16日 至　2020年 4月13日	第13期 自　2020年 4月14日 至　2021年 4月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,761,878	8,962,423
営業収益合計	△1,761,878	8,962,423
営業費用		
支払利息	752	867
受託者報酬	66,240	66,427
委託者報酬	861,001	398,443
その他費用	11,348	11,187
営業費用合計	939,341	476,924
営業利益又は営業損失（△）	△2,701,219	8,485,499
経常利益又は経常損失（△）	△2,701,219	8,485,499
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,701,219	8,485,499
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（△）	△154,722	962,164
期首剰余金又は期首欠損金（△）	43,574,103	42,450,868
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,107,987	4,991,088
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,107,987	4,991,088
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,684,725	8,166,050
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,684,725	8,166,050
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	42,450,868	46,799,241

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第13期 自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 　金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 　金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 　直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第12期 （2020年 4月13日現在）	第13期 （2021年 4月13日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	160,588,854口	146,803,656口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2643円 (10,000口当たりの純資産額　12,643円)	1口当たり純資産額　1.3188円 (10,000口当たりの純資産額　13,188円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第12期 自 2019年 4月16日 至 2020年 4月13日	第13期 自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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（1,489,088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（47,041,313円）、および分配準備積立金（15,382,396円）より、分配対象収益は63,912,797円（1万口当たり3,979.88円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,826,181円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,960,495円）、収益調整金（44,611,966円）、および分配準備積立金（13,823,976円）より、分配対象収益は62,222,618円（1万口当たり4,238.46円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第13期 自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。

項　目	第13期 自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13日
3 .金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
4 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第13期 （2021年 4月13日現在）
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第12期（自 2019年 4月16日　至 2020年 4月13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	△1,725,816円
合計	△1,725,816円

第13期（自 2020年 4月14日　至 2021年 4月13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	6,860,063円
合計	6,860,063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13期 自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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12期 （2020年 4月13日現在）	第13期 （2021年 4月13日現在）
期首元本額	155,799,244円	160,588,854円
期中追加設定元本額	21,524,938円	16,974,194円
期中一部解約元本額	16,735,328円	30,759,392円

（４）【附属明細表】

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）	4,731,866	15,320,362	
	外国株式インデックス・マザーファンド	1,307,216	6,637,519	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	6,940,706	13,454,558	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	43,319,205	55,292,633	
	マネーインカム・マザーファンド	100,839,042	101,686,089	
合計		157,138,035	192,391,161	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 4月13日現在）	（2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		

金銭信託	1,569,931,879	1,169,715,889
コール・ローン	1,091,338,581	605,779,870
株式	148,206,257,960	191,803,100,950
派生商品評価勘定	70,320,500	5,553,800
未収入金	12,960,400	1,085,600
未収配当金	1,992,318,344	1,738,508,396
前払金	-	7,000,000
差入委託証拠金	-	3,460,000
流動資産合計	152,943,127,664	195,334,204,505
資産合計	152,943,127,664	195,334,204,505
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,468,900	12,745,200
前受金	53,010,000	-
未払金	45,670,200	-
未払解約金	298,597,444	62,155,249
未払利息	2,960	1,659
その他未払費用	383,203	15,207
流動負債合計	415,132,707	74,917,315
負債合計	415,132,707	74,917,315
純資産の部		
元本等		
元本	66,999,567,497	60,307,285,983
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	85,528,427,460	134,952,001,207
元本等合計	152,527,994,957	195,259,287,190
純資産合計	152,527,994,957	195,259,287,190
負債純資産合計	152,943,127,664	195,334,204,505

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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	先物取引

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、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13日現在）	（2021年 4月13日現在）
1．　担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式　2,610,000,000円	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式　3,402,800,000円
2．　当計算期間の末日における受益権の総数	66,999,567,497口	60,307,285,983口
3．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.2766円 (10,000口当たりの純資産額　22,766円)	1口当たり純資産額　3.2377円 (10,000口当たりの純資産額　32,377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14日 至 2021年 4月13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、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 4月13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13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	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
	東証株価指数先物	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
合計		3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600

（2021年 4月13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	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
	東証株価指数先物	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
合計		3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400

（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14日 至 2021年 4月13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13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	69,243,723,709円
同期中における追加設定元本額	16,941,213,035円
同期中における一部解約元本額	19,185,369,247円
2020年 4月13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	9,964,536,945円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	1,007,154,836円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,682,046,360円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,203,157,146円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	84,286,777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）	7,771,247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）	27,830,753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）	77,317,486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）	127,394,223円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	86,046,135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）	181,252,174円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,814,911,783円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	12,839,183,881円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	547,577,365円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	561,168,497円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	411,929,217円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	14,698,817円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	88,807,681円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	72,638,725円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	212,846,574円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	102,613,725円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	126,077,209円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	16,579,634円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	10,439,245円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	155,573円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,105,768円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	827,282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）	3,948,100,879円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,926,442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＞	3,234,260,231円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	2,428,994,643円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	9,037,107,599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＞	880,814,914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＞	939,572,269円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	2,905,693,174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＞	81,792,352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＞	119,019,653円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	56,952,405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＞	72,366,784円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	989,295,905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）	188,003,249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＞	937,750,878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＞	148,815,098円
合計	66,999,567,497円

（2021年 4月13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	66,999,567,497円
同期中における追加設定元本額	10,234,596,277円
同期中における一部解約元本額	16,926,877,791円
2021年 4月13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	9,403,817,844円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	874,307,630円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,236,443,718円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,147,333,103円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	140,818,938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）	4,731,866円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	21,315,752円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	62,804,297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）	128,333,283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）	101,569,258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）	197,544,642円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,143,235,519円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	15,940,892,855円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	453,355,694円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	484,073,352円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	312,771,346円
イオン・バランス戦略ファンド	55,063,082円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	22,865,709円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	126,712,529円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	108,999,096円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	355,046,751円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	180,069,347円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	206,194,976円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	23,499,186円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	215,426,585円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,380,243円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	50,121,313円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	46,060,070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）	3,060,853,074円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,670,796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＞	2,117,411,933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＞	783,916,156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＞	882,228,687円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	687,469,840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＞	367,759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＞	35,682,955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＞	134,126,377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＞	72,459,636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＞	291,264,191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＞	735,634,579円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	74,013,645円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	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＞	429,758,704円
合計	60,307,285,983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	3,020.00	10,570,000	
日本水産	89,900	522.00	46,927,800	
マルハニチロ	15,000	2,601.00	39,015,000	
雪国まいたけ	6,100	1,938.00	11,821,800	
カネコ種苗	4,700	1,650.00	7,755,000	
サカタのタネ	11,500	3,860.00	44,390,000	
ホクト	8,100	2,039.00	16,515,900	
日鉄鉱業	2,300	6,700.00	15,410,000	
ＩＮＰＥＸ	356,900	733.00	261,607,700	
石油資源開発	12,600	2,021.00	25,464,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,800	1,438.00	8,340,400	
ヒノキヤグループ	3,300	2,607.00	8,603,100	
ショーボンドホールディングス	13,900	4,930.00	68,527,000	
ミライト・ホールディングス	32,000	1,863.00	59,616,000	
タマホーム	6,300	2,437.00	15,353,100	
ベステラ	3,200	1,700.00	5,440,000	
スペースバリューホールディングス	14,200	807.00	11,459,400	
安藤・間	61,900	871.00	53,914,900	
東急建設	30,800	581.00	17,894,800	

コムシスホールディングス	34,200	3,530.00	120,726,000	
ビーアールホールディングス	13,600	590.00	8,024,000	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,239.00	14,105,700	
東建コーポレーション	2,900	10,810.00	31,349,000	
オリエンタル白石	39,700	303.00	12,029,100	
大成建設	69,400	4,275.00	296,685,000	
大林組	222,000	1,040.00	230,880,000	
清水建設	208,200	909.00	189,253,800	
飛島建設	9,400	1,168.00	10,979,200	
長谷工コーポレーション	72,500	1,605.00	116,362,500	
松井建設	11,800	744.00	8,779,200	
錢高組	1,700	4,845.00	8,236,500	
鹿島建設	163,000	1,555.00	253,465,000	
不動テトラ	6,900	1,986.00	13,703,400	
大末建設	7,100	935.00	6,638,500	
鉄建建設	6,500	1,898.00	12,337,000	
西松建設	16,600	2,850.00	47,310,000	
三井住友建設	54,500	493.00	26,868,500	
大豊建設	5,200	3,950.00	20,540,000	
前田建設工業	58,300	983.00	57,308,900	
奥村組	12,400	2,846.00	35,290,400	
東鉄工業	8,800	2,629.00	23,135,200	
淺沼組	3,200	4,705.00	15,056,000	
戸田建設	94,900	837.00	79,431,300	
熊谷組	10,200	3,010.00	30,702,000	
北野建設	2,400	2,519.00	6,045,600	
矢作建設工業	12,100	833.00	10,079,300	
ピーエス三菱	10,400	668.00	6,947,200	
日本ハウスホールディングス	22,100	343.00	7,580,300	
大東建託	24,500	12,740.00	312,130,000	
新日本建設	10,500	873.00	9,166,500	
ＮＩＰＰＯ	17,500	3,075.00	53,812,500	
東亜道路工業	1,900	4,325.00	8,217,500	
前田道路	14,500	2,210.00	32,045,000	
日本道路	2,300	8,210.00	18,883,000	
東亜建設工業	6,800	2,474.00	16,823,200	

日本国土開発	22,200	619.00	13,741,800	
若築建設	6,500	1,356.00	8,814,000	
東洋建設	26,200	573.00	15,012,600	
五洋建設	96,800	897.00	86,829,600	
世紀東急工業	13,300	898.00	11,943,400	
福田組	2,800	5,160.00	14,448,000	
住友林業	53,000	2,519.00	133,507,000	
巴コーポレーション	15,200	398.00	6,049,600	
大和ハウス工業	207,100	3,333.00	690,264,300	
ライト工業	12,200	1,856.00	22,643,200	
積水ハウス	243,300	2,377.00	578,324,100	
ユアテック	13,900	806.00	11,203,400	
日本リーテック	5,400	1,885.00	10,179,000	
中電工	7,900	2,443.00	19,299,700	
関電工	32,600	1,003.00	32,697,800	
きんでん	47,100	1,908.00	89,866,800	
東京エネシス	8,900	912.00	8,116,800	
トーエネック	2,900	3,880.00	11,252,000	
住友電設	6,400	2,515.00	16,096,000	
日本電設工業	11,200	1,987.00	22,254,400	
協和エクシオ	33,200	3,005.00	99,766,000	
新日本空調	6,400	2,365.00	15,136,000	
九電工	15,900	4,175.00	66,382,500	
三機工業	15,400	1,435.00	22,099,000	
日揮ホールディングス	75,500	1,316.00	99,358,000	
中外炉工業	4,300	2,087.00	8,974,100	
ヤマト	9,400	664.00	6,241,600	
太平電業	5,400	2,728.00	14,731,200	
高砂熱学工業	19,300	1,723.00	33,253,900	
朝日工業社	2,500	2,990.00	7,475,000	
明星工業	15,900	784.00	12,465,600	
大氣社	10,600	3,140.00	33,284,000	
ダイダン	5,000	2,928.00	14,640,000	
日比谷総合設備	7,800	1,969.00	15,358,200	
レイズネクスト	12,500	1,192.00	14,900,000	
ニップン	18,800	1,620.00	30,456,000	

日清製粉グループ本社	80,600	1,825.00	147,095,000	
昭和産業	5,400	3,035.00	16,389,000	
鳥越製粉	8,500	823.00	6,995,500	
中部飼料	8,700	1,443.00	12,554,100	
フィード・ワン	10,500	901.00	9,460,500	
日本甜菜製糖	5,100	1,647.00	8,399,700	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	5,300	1,878.00	9,953,400	
日新製糖	4,200	1,816.00	7,627,200	
森永製菓	16,900	3,850.00	65,065,000	
中村屋	2,700	3,855.00	10,408,500	
江崎グリコ	19,600	4,320.00	84,672,000	
名糖産業	5,800	1,502.00	8,711,600	
井村屋グループ	4,500	2,500.00	11,250,000	
不二家	5,100	2,203.00	11,235,300	
山崎製パン	53,600	1,722.00	92,299,200	
モロゾフ	1,700	5,710.00	9,707,000	
亀田製菓	3,900	4,735.00	18,466,500	
寿スピリッツ	6,900	7,160.00	49,404,000	
カルビー	32,800	2,770.00	90,856,000	
森永乳業	13,200	5,830.00	76,956,000	
六甲バター	5,900	1,706.00	10,065,400	
ヤクルト本社	49,200	5,450.00	268,140,000	
明治ホールディングス	46,900	7,010.00	328,769,000	
雪印メグミルク	17,100	2,279.00	38,970,900	
プリマハム	9,400	3,560.00	33,464,000	
日本ハム	27,200	4,980.00	135,456,000	
丸大食品	6,700	1,702.00	11,403,400	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,200	3,715.00	23,033,000	
柿安本店	3,000	2,577.00	7,731,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	40,200	730.00	29,346,000	
サッポロホールディングス	24,800	2,241.00	55,576,800	
アサヒグループホールディングス	156,800	4,727.00	741,193,600	
キリンホールディングス	304,100	2,030.00	617,323,000	
宝ホールディングス	53,000	1,491.00	79,023,000	
オエノンホールディングス	24,500	401.00	9,824,500	
養命酒製造	3,700	1,855.00	6,863,500	

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	55,400	1,777.00	98,445,800	
サントリー食品インターナショナル	47,500	3,920.00	186,200,000	
ダイドーグループホールディングス	3,900	5,330.00	20,787,000	
伊藤園	21,700	6,250.00	135,625,000	
キーコーヒー	7,000	2,100.00	14,700,000	
日清オイリオグループ	8,700	3,185.00	27,709,500	
不二製油グループ本社	17,600	2,896.00	50,969,600	
かどや製油	1,400	4,030.00	5,642,000	
Ｊ－オイルミルズ	6,400	1,922.00	12,300,800	
キッコーマン	51,500	6,530.00	336,295,000	
味の素	171,400	2,220.50	380,593,700	
キユーピー	39,800	2,606.00	103,718,800	
ハウス食品グループ本社	26,700	3,555.00	94,918,500	
カゴメ	29,300	3,350.00	98,155,000	
焼津水産化学工業	4,800	989.00	4,747,200	
アリアケジャパン	6,700	6,670.00	44,689,000	
ニチレイ	34,000	2,775.00	94,350,000	
東洋水産	36,700	4,580.00	168,086,000	
イートアンドホールディングス	4,300	1,957.00	8,415,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	1,001.00	5,305,300	
日清食品ホールディングス	28,000	7,930.00	222,040,000	
永谷園ホールディングス	4,300	2,300.00	9,890,000	
一正蒲鉾	4,000	1,316.00	5,264,000	
フジッコ	7,400	1,947.00	14,407,800	
ロック・フィールド	7,500	1,651.00	12,382,500	
日本たばこ産業	384,200	2,081.00	799,520,200	
ケンコーマヨネーズ	5,400	1,820.00	9,828,000	
わらべや日洋ホールディングス	5,600	1,944.00	10,886,400	
なとり	5,500	1,948.00	10,714,000	
ピックルスコーポレーション	2,000	3,210.00	6,420,000	
北の達人コーポレーション	24,800	668.00	16,566,400	
ユーグレナ	31,000	1,051.00	32,581,000	
ミヨシ油脂	4,700	1,260.00	5,922,000	
理研ビタミン	8,100	1,373.00	11,121,300	
片倉工業	10,600	1,513.00	16,037,800	

グンゼ	5,100	4,145.00	21,139,500	
東洋紡	29,100	1,415.00	41,176,500	
ユニチカ	24,200	411.00	9,946,200	
富士紡ホールディングス	3,700	4,375.00	16,187,500	
倉敷紡績	6,900	1,860.00	12,834,000	
シキボウ	6,300	972.00	6,123,600	
日本毛織	22,500	1,020.00	22,950,000	
帝国繊維	8,300	2,252.00	18,691,600	
帝人	65,500	1,833.00	120,061,500	
東レ	508,300	704.30	357,995,690	
住江織物	2,700	2,246.00	6,064,200	
アツギ	11,300	560.00	6,328,000	
ダイニック	6,000	786.00	4,716,000	
セーレン	17,400	1,988.00	34,591,200	
小松マテーレ	12,300	988.00	12,152,400	
ワコールホールディングス	18,300	2,509.00	45,914,700	
ホギメディカル	9,400	3,260.00	30,644,000	
ＴＳＩホールディングス	28,900	360.00	10,404,000	
マツオカコーポレーション	2,900	1,929.00	5,594,100	
ワールド	10,200	1,469.00	14,983,800	
オンワードホールディングス	46,900	306.00	14,351,400	
ゴールドウイン	11,600	6,930.00	80,388,000	
デサント	12,400	1,993.00	24,713,200	
特種東海製紙	4,500	4,670.00	21,015,000	
王子ホールディングス	313,200	719.00	225,190,800	
日本製紙	31,600	1,309.00	41,364,400	
北越コーポレーション	50,800	580.00	29,464,000	
中越パルプ工業	5,400	1,239.00	6,690,600	
大王製紙	33,200	1,888.00	62,681,600	
レンゴー	72,800	922.00	67,121,600	
トーモク	5,400	1,920.00	10,368,000	
ザ・パック	5,800	3,000.00	17,400,000	
クラレ	109,600	1,227.00	134,479,200	
旭化成	463,300	1,235.00	572,175,500	
昭和電工	53,000	3,340.00	177,020,000	
住友化学	547,500	568.00	310,980,000	

住友精化	3,600	4,100.00	14,760,000	
日産化学	38,500	5,930.00	228,305,000	
ラサ工業	2,800	2,328.00	6,518,400	
クレハ	5,900	8,050.00	47,495,000	
多木化学	2,900	6,020.00	17,458,000	
テイカ	6,000	1,492.00	8,952,000	
石原産業	14,800	926.00	13,704,800	
日本曹達	9,800	3,425.00	33,565,000	
東ソー	107,500	2,126.00	228,545,000	
トクヤマ	20,700	2,793.00	57,815,100	
セントラル硝子	14,100	2,374.00	33,473,400	
東亞合成	43,400	1,323.00	57,418,200	
大阪ソーダ	6,900	2,685.00	18,526,500	
関東電化工業	17,900	919.00	16,450,100	
デンカ	25,500	4,470.00	113,985,000	
信越化学工業	129,200	19,010.00	2,456,092,000	
堺化学工業	5,500	2,101.00	11,555,500	
第一稀元素化学工業	8,600	1,356.00	11,661,600	
エア・ウォーター	71,000	1,845.00	130,995,000	
日本酸素ホールディングス	57,500	2,107.00	121,152,500	
日本化学工業	2,500	3,005.00	7,512,500	
日本パーカライジング	36,600	1,145.00	41,907,000	
高圧ガス工業	13,000	730.00	9,490,000	
四国化成工業	9,800	1,351.00	13,239,800	
ステラ　ケミファ	4,000	3,300.00	13,200,000	
保土谷化学工業	2,200	4,750.00	10,450,000	
日本触媒	12,800	6,140.00	78,592,000	
大日精化工業	5,700	2,454.00	13,987,800	
カネカ	18,000	4,565.00	82,170,000	
三菱瓦斯化学	69,700	2,663.00	185,611,100	
三井化学	59,900	3,555.00	212,944,500	
ＪＳＲ	70,200	3,510.00	246,402,000	
東京応化工業	12,100	7,320.00	88,572,000	
大阪有機化学工業	6,400	4,355.00	27,872,000	
三菱ケミカルホールディングス	468,100	827.90	387,539,990	
ＫＨネオケム	11,800	2,706.00	31,930,800	

ダイセル	94,200	887.00	83,555,400	
住友ベークライト	11,200	4,495.00	50,344,000	
積水化学工業	146,400	2,148.00	314,467,200	
日本ゼオン	63,200	1,701.00	107,503,200	
アイカ工業	19,500	4,045.00	78,877,500	
宇部興産	35,000	2,275.00	79,625,000	
積水樹脂	11,500	2,169.00	24,943,500	
タキロンシーアイ	16,500	691.00	11,401,500	
旭有機材	5,100	1,477.00	7,532,700	
ニチバン	4,800	1,880.00	9,024,000	
リケンテクノス	19,800	529.00	10,474,200	
大倉工業	3,800	2,083.00	7,915,400	
積水化成品工業	12,000	595.00	7,140,000	
群栄化学工業	2,600	2,448.00	6,364,800	
ダイキョーニシカワ	15,400	774.00	11,919,600	
森六ホールディングス	4,600	2,211.00	10,170,600	
日本化薬	44,600	1,050.00	46,830,000	
カーリットホールディングス	8,700	723.00	6,290,100	
日本精化	5,900	1,510.00	8,909,000	
扶桑化学工業	5,300	4,255.00	22,551,500	
トリケミカル研究所	6,200	3,865.00	23,963,000	
ＡＤＥＫＡ	32,400	2,227.00	72,154,800	
日油	26,100	5,950.00	155,295,000	
新日本理化	15,000	297.00	4,455,000	
ハリマ化成グループ	6,700	953.00	6,385,100	
花王	171,000	7,306.00	1,249,326,000	
第一工業製薬	2,700	3,905.00	10,543,500	
ニイタカ	2,000	2,730.00	5,460,000	
三洋化成工業	4,100	5,480.00	22,468,000	
大日本塗料	10,100	900.00	9,090,000	
日本ペイントホールディングス	288,500	1,547.00	446,309,500	
関西ペイント	78,500	2,929.00	229,926,500	
中国塗料	18,000	995.00	17,910,000	
日本特殊塗料	6,500	1,061.00	6,896,500	
藤倉化成	12,600	565.00	7,119,000	
太陽ホールディングス	5,100	6,010.00	30,651,000	

ＤＩＣ	29,400	2,888.00	84,907,200	
サカタインクス	15,700	1,041.00	16,343,700	
東洋インキＳＣホールディングス	13,500	2,096.00	28,296,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,200	829.00	6,797,800	
富士フイルムホールディングス	125,500	6,722.00	843,611,000	
資生堂	142,000	7,843.00	1,113,706,000	
ライオン	92,700	2,176.00	201,715,200	
高砂香料工業	4,900	2,693.00	13,195,700	
マンダム	15,400	2,127.00	32,755,800	
ミルボン	9,700	6,120.00	59,364,000	
ファンケル	26,000	3,745.00	97,370,000	
コーセー	13,400	16,110.00	215,874,000	
コタ	6,050	1,566.00	9,474,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,700	2,656.00	81,539,200	
ノエビアホールディングス	6,000	5,000.00	30,000,000	
新日本製薬	2,000	2,226.00	4,452,000	
エステー	5,400	1,944.00	10,497,600	
アグロ　カネショウ	3,600	1,530.00	5,508,000	
コニシ	11,800	1,793.00	21,157,400	
長谷川香料	12,200	2,194.00	26,766,800	
小林製薬	19,900	10,080.00	200,592,000	
荒川化学工業	7,000	1,300.00	9,100,000	
メック	5,200	2,368.00	12,313,600	
タカラバイオ	18,600	2,869.00	53,363,400	
ＪＣＵ	8,000	4,170.00	33,360,000	
デクセリアルズ	20,300	1,970.00	39,991,000	
アース製薬	5,300	6,460.00	34,238,000	
北興化学工業	7,400	1,068.00	7,903,200	
大成ラミック	3,200	2,889.00	9,244,800	
クミアイ化学工業	30,500	995.00	30,347,500	
日本農薬	16,800	583.00	9,794,400	
アキレス	6,100	1,460.00	8,906,000	
有沢製作所	11,500	987.00	11,350,500	
日東電工	45,600	9,330.00	425,448,000	
レック	9,200	1,266.00	11,647,200	
三光合成	9,800	451.00	4,419,800	

藤森工業	6,000	4,415.00	26,490,000	
未来工業	3,600	1,875.00	6,750,000	
ＪＳＰ	5,200	1,861.00	9,677,200	
エフピコ	13,300	4,475.00	59,517,500	
天馬	6,000	2,260.00	13,560,000	
信越ポリマー	11,200	1,024.00	11,468,800	
東リ	26,000	252.00	6,552,000	
ニフコ	26,300	4,045.00	106,383,500	
バルカー	6,100	2,161.00	13,182,100	
ユニ・チャーム	151,500	4,542.00	688,113,000	
協和キリン	71,400	3,310.00	236,334,000	
武田薬品工業	594,100	3,716.00	2,207,675,600	
アステラス製薬	618,700	1,661.50	1,027,970,050	
大日本住友製薬	53,400	1,920.00	102,528,000	
塩野義製薬	89,800	5,766.00	517,786,800	
日本新薬	20,300	7,780.00	157,934,000	
中外製薬	223,000	4,333.00	966,259,000	
科研製薬	12,400	4,340.00	53,816,000	
エーザイ	79,200	7,229.00	572,536,800	
ロート製薬	34,300	2,915.00	99,984,500	
小野薬品工業	164,300	2,811.00	461,847,300	
久光製薬	20,700	6,770.00	140,139,000	
持田製薬	10,200	4,135.00	42,177,000	
参天製薬	124,200	1,451.00	180,214,200	
扶桑薬品工業	3,300	2,529.00	8,345,700	
日本ケミファ	2,500	2,448.00	6,120,000	
ツムラ	24,000	3,930.00	94,320,000	
日医工	20,800	963.00	20,030,400	
キッセイ薬品工業	13,400	2,351.00	31,503,400	
生化学工業	12,400	1,020.00	12,648,000	
栄研化学	12,700	2,067.00	26,250,900	
鳥居薬品	4,600	2,884.00	13,266,400	
ＪＣＲファーマ	20,400	3,220.00	65,688,000	
東和薬品	10,000	2,342.00	23,420,000	
富士製薬工業	6,500	1,251.00	8,131,500	
ゼリア新薬工業	12,800	2,042.00	26,137,600	

第一三共	612,900	2,986.50	1,830,425,850	
キョーリン製薬ホールディングス	15,500	1,910.00	29,605,000	
大幸薬品	9,200	1,232.00	11,334,400	
ダイト	4,600	3,570.00	16,422,000	
大塚ホールディングス	148,200	4,570.00	677,274,000	
大正製薬ホールディングス	16,900	6,660.00	112,554,000	
ペプチドリーム	36,400	4,815.00	175,266,000	
あすか製薬ホールディングス	8,000	1,374.00	10,992,000	
サワイグループホールディングス	15,600	5,190.00	80,964,000	
日本コークス工業	75,400	108.00	8,143,200	
ニチレキ	8,800	1,596.00	14,044,800	
ユシロ化学工業	7,200	1,149.00	8,272,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,800	1,157.00	6,710,600	
出光興産	79,100	2,677.00	211,750,700	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,075,700	472.70	508,483,390	
コスモエネルギーホールディングス	22,700	2,370.00	53,799,000	
横浜ゴム	41,200	2,077.00	85,572,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	38,000	2,046.00	77,748,000	
ブリヂストン	189,900	4,377.00	831,192,300	
住友ゴム工業	63,200	1,348.00	85,193,600	
オカモト	4,400	4,065.00	17,886,000	
ニッタ	7,200	2,719.00	19,576,800	
住友理工	15,300	737.00	11,276,100	
三ツ星ベルト	9,000	1,825.00	16,425,000	
バンドー化学	14,700	768.00	11,289,600	
日東紡績	10,800	3,920.00	42,336,000	
ＡＧＣ	65,500	4,985.00	326,517,500	
日本板硝子	17,700	678.00	12,000,600	
日本電気硝子	27,100	2,700.00	73,170,000	
オハラ	3,600	1,704.00	6,134,400	
住友大阪セメント	13,400	3,690.00	49,446,000	
太平洋セメント	42,600	2,830.00	120,558,000	
日本ヒューム	11,000	743.00	8,173,000	
日本コンクリート工業	24,200	418.00	10,115,600	
三谷セキサン	3,400	4,095.00	13,923,000	
アジアパイルホールディングス	16,100	528.00	8,500,800	

東海カーボン	70,100	1,783.00	124,988,300	
日本カーボン	4,200	4,650.00	19,530,000	
東洋炭素	5,100	2,091.00	10,664,100	
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	3,510.00	15,093,000	
ＴＯＴＯ	51,000	6,430.00	327,930,000	
日本碍子	78,700	1,997.00	157,163,900	
日本特殊陶業	54,600	1,878.00	102,538,800	
ＭＡＲＵＷＡ	2,500	11,410.00	28,525,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	2,974.00	6,840,200	
黒崎播磨	1,600	4,845.00	7,752,000	
東京窯業	14,100	331.00	4,667,100	
フジミインコーポレーテッド	5,800	4,495.00	26,071,000	
ニチアス	18,000	2,874.00	51,732,000	
ニチハ	10,000	3,210.00	32,100,000	
日本製鉄	337,300	1,878.00	633,449,400	
神戸製鋼所	129,600	755.00	97,848,000	
合同製鐵	4,600	2,083.00	9,581,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	203,100	1,402.00	284,746,200	
東京製鐵	27,800	966.00	26,854,800	
共英製鋼	8,900	1,636.00	14,560,400	
大和工業	15,500	3,350.00	51,925,000	
東京鐵鋼	3,400	1,957.00	6,653,800	
大阪製鐵	5,000	1,332.00	6,660,000	
淀川製鋼所	9,200	2,480.00	22,816,000	
丸一鋼管	22,900	2,569.00	58,830,100	
モリ工業	2,800	2,598.00	7,274,400	
大同特殊鋼	11,800	5,090.00	60,062,000	
日本冶金工業	6,100	2,009.00	12,254,900	
山陽特殊製鋼	9,000	1,683.00	15,147,000	
愛知製鋼	4,200	3,710.00	15,582,000	
日立金属	67,100	1,920.00	128,832,000	
大平洋金属	5,400	2,175.00	11,745,000	
新日本電工	48,600	370.00	17,982,000	
栗本鐵工所	4,400	1,754.00	7,717,600	
三菱製鋼	8,700	888.00	7,725,600	
日本精線	1,500	3,740.00	5,610,000	

大紀アルミニウム工業所	10,900	993.00	10,823,700	
日本軽金属ホールディングス	19,500	2,118.00	41,301,000	
三井金属鉱業	18,900	3,770.00	71,253,000	
東邦亜鉛	4,500	2,296.00	10,332,000	
三菱マテリアル	46,500	2,556.00	118,854,000	
住友金属鉱山	90,200	4,759.00	429,261,800	
ＤＯＷＡホールディングス	17,800	4,740.00	84,372,000	
古河機械金属	11,800	1,313.00	15,493,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,100	973.00	9,827,300	
東邦チタニウム	13,500	1,041.00	14,053,500	
ＵＡＣＪ	10,800	2,606.00	28,144,800	
ＣＫサンエツ	1,900	3,755.00	7,134,500	
古河電気工業	22,100	2,972.00	65,681,200	
住友電気工業	246,300	1,679.50	413,660,850	
フジクラ	86,700	552.00	47,858,400	
昭和電線ホールディングス	7,200	1,757.00	12,650,400	
タツタ電線	13,500	623.00	8,410,500	
平河ヒューテック	5,100	1,306.00	6,660,600	
リョービ	9,900	1,728.00	17,107,200	
アサヒホールディングス	26,400	2,208.00	58,291,200	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,356.00	7,539,200	
トーカロ	18,400	1,530.00	28,152,000	
アルファＣｏ	5,300	1,159.00	6,142,700	
ＳＵＭＣＯ	90,400	2,705.00	244,532,000	
川田テクノロジーズ	1,900	4,615.00	8,768,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,400	7,150.00	17,160,000	
東洋製罐グループホールディングス	45,900	1,360.00	62,424,000	
ホッカンホールディングス	5,300	1,463.00	7,753,900	
横河ブリッジホールディングス	12,100	2,119.00	25,639,900	
駒井ハルテック	2,300	2,055.00	4,726,500	
三和ホールディングス	67,500	1,441.00	97,267,500	
文化シヤッター	20,900	1,003.00	20,962,700	
三協立山	11,300	908.00	10,260,400	
ＬＩＸＩＬ	97,500	3,130.00	305,175,000	
ノーリツ	15,300	1,754.00	26,836,200	
長府製作所	7,000	2,130.00	14,910,000	

リンナイ	13,800	11,720.00	161,736,000	
日東精工	13,100	593.00	7,768,300	
岡部	17,800	780.00	13,884,000	
ジーテクト	9,400	1,525.00	14,335,000	
東プレ	13,800	1,581.00	21,817,800	
高周波熱錬	19,000	573.00	10,887,000	
東京製綱	6,000	1,176.00	7,056,000	
パイオラックス	10,700	1,584.00	16,948,800	
エイチワン	9,100	871.00	7,926,100	
日本発條	71,700	833.00	59,726,100	
立川ブラインド工業	3,800	1,335.00	5,073,000	
三益半導体工業	5,500	2,894.00	15,917,000	
日本製鋼所	21,900	2,626.00	57,509,400	
三浦工業	30,500	6,040.00	184,220,000	
タクマ	23,500	2,390.00	56,165,000	
ツガミ	14,600	1,823.00	26,615,800	
オークマ	8,300	6,470.00	53,701,000	
芝浦機械	7,500	2,814.00	21,105,000	
アマダ	102,800	1,260.00	129,528,000	
アイダエンジニアリング	18,900	1,013.00	19,145,700	
ＦＵＪＩ	27,700	2,980.00	82,546,000	
牧野フライス製作所	8,400	4,445.00	37,338,000	
オーエスジー	35,500	1,952.00	69,296,000	
旭ダイヤモンド工業	21,600	540.00	11,664,000	
ＤＭＧ森精機	45,200	1,832.00	82,806,400	
ソディック	15,800	1,069.00	16,890,200	
ディスコ	9,600	37,700.00	361,920,000	
日東工器	4,300	1,995.00	8,578,500	
日進工具	6,200	1,573.00	9,752,600	
豊和工業	5,200	905.00	4,706,000	
石川製作所	2,400	1,892.00	4,540,800	
島精機製作所	10,300	2,368.00	24,390,400	
オプトラン	9,100	2,990.00	27,209,000	
フリュー	8,300	1,043.00	8,656,900	
ヤマシンフィルタ	14,300	880.00	12,584,000	
日阪製作所	10,600	881.00	9,338,600	

やまびこ	13,800	1,259.00	17,374,200	
平田機工	3,300	7,550.00	24,915,000	
マルマエ	3,200	1,544.00	4,940,800	
タツモ	3,700	2,007.00	7,425,900	
ナブテスコ	41,400	5,290.00	219,006,000	
三井海洋開発	7,900	2,244.00	17,727,600	
レオン自動機	7,800	1,208.00	9,422,400	
ＳＭＣ	20,900	66,320.00	1,386,088,000	
ホソカワミクロン	2,500	6,600.00	16,500,000	
ユニオンツール	2,800	3,700.00	10,360,000	
オイレス工業	9,900	1,678.00	16,612,200	
日精エー・エス・ビー機械	2,100	5,490.00	11,529,000	
サトーホールディングス	9,500	2,816.00	26,752,000	
技研製作所	6,300	4,810.00	30,303,000	
日本エアーテック	3,100	1,225.00	3,797,500	
日精樹脂工業	7,400	984.00	7,281,600	
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,005.00	3,919,500	
小松製作所	323,300	3,370.00	1,089,521,000	
住友重機械工業	40,500	3,290.00	133,245,000	
日立建機	33,500	3,485.00	116,747,500	
日工	13,300	727.00	9,669,100	
巴工業	3,700	2,120.00	7,844,000	
井関農機	8,500	1,684.00	14,314,000	
ＴＯＷＡ	7,000	2,230.00	15,610,000	
北川鉄工所	3,700	1,595.00	5,901,500	
ローツェ	3,100	9,650.00	29,915,000	
クボタ	375,200	2,587.50	970,830,000	
荏原実業	2,000	4,895.00	9,790,000	
三菱化工機	2,600	2,803.00	7,287,800	
月島機械	13,600	1,317.00	17,911,200	
帝国電機製作所	6,200	1,333.00	8,264,600	
新東工業	18,000	766.00	13,788,000	
澁谷工業	6,200	3,555.00	22,041,000	
アイチ　コーポレーション	12,900	859.00	11,081,100	
小森コーポレーション	17,900	773.00	13,836,700	
鶴見製作所	6,000	1,734.00	10,404,000	

酒井重工業	2,200	2,133.00	4,692,600	
荏原製作所	29,600	4,915.00	145,484,000	
酉島製作所	7,900	862.00	6,809,800	
北越工業	9,100	1,098.00	9,991,800	
ダイキン工業	90,900	22,805.00	2,072,974,500	
オルガノ	2,200	7,380.00	16,236,000	
トーヨーカネツ	3,300	2,639.00	8,708,700	
栗田工業	38,500	4,855.00	186,917,500	
椿本チエイン	9,800	2,988.00	29,282,400	
大同工業	4,300	947.00	4,072,100	
木村化工機	7,500	727.00	5,452,500	
アネスト岩田	12,500	1,040.00	13,000,000	
ダイフク	39,100	11,050.00	432,055,000	
サムコ	2,000	3,425.00	6,850,000	
加藤製作所	6,000	1,130.00	6,780,000	
タダノ	36,100	1,194.00	43,103,400	
フジテック	24,900	2,335.00	58,141,500	
ＣＫＤ	16,600	2,507.00	41,616,200	
キトー	7,200	1,824.00	13,132,800	
平和	19,900	1,889.00	37,591,100	
理想科学工業	6,500	1,400.00	9,100,000	
ＳＡＮＫＹＯ	17,300	2,981.00	51,571,300	
日本金銭機械	10,100	621.00	6,272,100	
マースグループホールディングス	5,500	1,651.00	9,080,500	
フクシマガリレイ	5,000	4,310.00	21,550,000	
竹内製作所	11,700	2,897.00	33,894,900	
アマノ	18,900	2,730.00	51,597,000	
ＪＵＫＩ	10,400	951.00	9,890,400	
蛇の目ミシン工業	8,300	841.00	6,980,300	
マックス	9,800	1,618.00	15,856,400	
グローリー	18,700	2,386.00	44,618,200	
新晃工業	6,700	2,265.00	15,175,500	
大和冷機工業	11,800	1,120.00	13,216,000	
セガサミーホールディングス	64,800	1,731.00	112,168,800	
リケン	4,300	2,501.00	10,754,300	
ＴＰＲ	9,900	1,664.00	16,473,600	

ツバキ・ナカシマ	13,500	1,642.00	22,167,000	
ホシザキ	22,500	10,410.00	234,225,000	
大豊工業	7,400	1,072.00	7,932,800	
日本精工	145,600	1,113.00	162,052,800	
ＮＴＮ	169,200	347.00	58,712,400	
ジェイテクト	68,600	1,135.00	77,861,000	
不二越	6,600	4,665.00	30,789,000	
日本トムソン	23,100	694.00	16,031,400	
ＴＨＫ	44,500	3,955.00	175,997,500	
ユーシン精機	6,400	900.00	5,760,000	
前澤給装工業	6,800	1,156.00	7,860,800	
イーグル工業	9,700	1,216.00	11,795,200	
日本ピラー工業	7,500	1,834.00	13,755,000	
キッツ	23,000	684.00	15,732,000	
マキタ	92,800	5,000.00	464,000,000	
日立造船	56,700	820.00	46,494,000	
三菱重工業	112,400	3,386.00	380,586,400	
ＩＨＩ	48,300	2,214.00	106,936,200	
スター精密	11,400	1,682.00	19,174,800	
日清紡ホールディングス	45,600	870.00	39,672,000	
イビデン	34,400	5,220.00	179,568,000	
コニカミノルタ	147,000	609.00	89,523,000	
ブラザー工業	86,600	2,439.00	211,217,400	
ミネベアミツミ	122,500	2,849.00	349,002,500	
日立製作所	343,200	5,249.00	1,801,456,800	
東芝	105,000	4,595.00	482,475,000	
三菱電機	713,000	1,678.50	1,196,770,500	
富士電機	42,900	5,000.00	214,500,000	
安川電機	76,700	5,510.00	422,617,000	
シンフォニアテクノロジー	10,000	1,468.00	14,680,000	
明電舎	12,500	2,506.00	31,325,000	
オリジン	4,300	1,391.00	5,981,300	
山洋電気	3,700	6,010.00	22,237,000	
デンヨー	6,600	2,027.00	13,378,200	
東芝テック	7,600	4,450.00	33,820,000	
芝浦メカトロニクス	1,500	5,930.00	8,895,000	

マブチモーター	19,800	4,870.00	96,426,000	
日本電産	171,900	13,815.00	2,374,798,500	
トレックス・セミコンダクター	5,100	1,841.00	9,389,100	
東光高岳	4,500	1,586.00	7,137,000	
ダイヘン	7,800	4,970.00	38,766,000	
ヤーマン	11,900	1,504.00	17,897,600	
ＪＶＣケンウッド	58,200	233.00	13,560,600	
ミマキエンジニアリング	11,200	690.00	7,728,000	
Ｉ－ＰＥＸ	4,300	1,990.00	8,557,000	
日新電機	16,900	1,237.00	20,905,300	
大崎電気工業	18,300	607.00	11,108,100	
オムロン	59,100	8,940.00	528,354,000	
日東工業	10,600	1,993.00	21,125,800	
ＩＤＥＣ	10,400	1,845.00	19,188,000	
正興電機製作所	2,100	1,992.00	4,183,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	26,000	3,025.00	78,650,000	
メルコホールディングス	2,800	3,860.00	10,808,000	
日本電気	90,500	6,550.00	592,775,000	
富士通	64,200	16,375.00	1,051,275,000	
沖電気工業	30,800	1,167.00	35,943,600	
電気興業	4,000	2,682.00	10,728,000	
サンケン電気	8,500	5,440.00	46,240,000	
アイホン	5,100	1,778.00	9,067,800	
ルネサスエレクトロニクス	308,000	1,267.00	390,236,000	
セイコーエプソン	88,800	1,821.00	161,704,800	
ワコム	52,700	733.00	38,629,100	
アルバック	13,400	5,030.00	67,402,000	
ＥＩＺＯ	6,300	4,080.00	25,704,000	
日本信号	17,700	989.00	17,505,300	
京三製作所	19,700	409.00	8,057,300	
能美防災	9,700	2,179.00	21,136,300	
ホーチキ	6,300	1,358.00	8,555,400	
エレコム	16,000	2,458.00	39,328,000	
パナソニック	761,500	1,392.00	1,060,008,000	
シャープ	82,700	1,908.00	157,791,600	
アンリツ	43,000	2,447.00	105,221,000	

富士通ゼネラル	22,100	3,050.00	67,405,000	
ソニーグループ	447,300	12,180.00	5,448,114,000	
ＴＤＫ	34,400	15,950.00	548,680,000	
帝国通信工業	6,400	1,096.00	7,014,400	
タムラ製作所	28,100	512.00	14,387,200	
アルプスアルパイン	59,700	1,350.00	80,595,000	
鈴木	4,200	1,259.00	5,287,800	
日本トリム	2,100	4,165.00	8,746,500	
ローランド　ディー．ジー．	5,500	1,792.00	9,856,000	
フォスター電機	8,900	1,275.00	11,347,500	
ＳＭＫ	2,500	2,834.00	7,085,000	
ヨコオ	5,400	2,753.00	14,866,200	
ホシデン	19,500	1,132.00	22,074,000	
ヒロセ電機	11,000	17,520.00	192,720,000	
日本航空電子工業	16,700	1,773.00	29,609,100	
ＴＯＡ	10,800	898.00	9,698,400	
マクセルホールディングス	15,000	1,467.00	22,005,000	
古野電気	10,500	1,157.00	12,148,500	
ユニデンホールディングス	2,600	2,614.00	6,796,400	
スミダコーポレーション	7,500	1,076.00	8,070,000	
アイコム	3,500	2,736.00	9,576,000	
リオン	3,500	2,936.00	10,276,000	
船井電機	16,500	917.00	15,130,500	
横河電機	71,700	2,080.00	149,136,000	
新電元工業	3,400	3,275.00	11,135,000	
アズビル	48,100	4,650.00	223,665,000	
東亜ディーケーケー	5,800	828.00	4,802,400	
日本光電工業	29,800	3,185.00	94,913,000	
共和電業	15,700	402.00	6,311,400	
日本電子材料	3,100	2,061.00	6,389,100	
堀場製作所	14,300	7,170.00	102,531,000	
アドバンテスト	52,900	10,630.00	562,327,000	
エスペック	7,000	1,895.00	13,265,000	
キーエンス	70,100	51,120.00	3,583,512,000	
日置電機	3,700	4,470.00	16,539,000	
シスメックス	55,800	11,260.00	628,308,000	

日本マイクロニクス	12,900	1,855.00	23,929,500	
メガチップス	7,500	3,745.00	28,087,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,400	3,820.00	16,808,000	
コーセル	9,700	1,094.00	10,611,800	
イリソ電子工業	6,200	5,190.00	32,178,000	
オプテックスグループ	12,400	1,677.00	20,794,800	
千代田インテグレ	4,500	1,955.00	8,797,500	
レーザーテック	31,300	17,670.00	553,071,000	
スタンレー電気	50,300	3,320.00	166,996,000	
岩崎電気	4,100	1,536.00	6,297,600	
ウシオ電機	37,800	1,468.00	55,490,400	
日本セラミック	7,700	2,730.00	21,021,000	
古河電池	5,600	1,639.00	9,178,400	
山一電機	5,500	1,547.00	8,508,500	
図研	5,000	2,900.00	14,500,000	
日本電子	13,100	4,490.00	58,819,000	
カシオ計算機	57,900	2,085.00	120,721,500	
ファナック	62,700	27,610.00	1,731,147,000	
日本シイエムケイ	20,300	474.00	9,622,200	
エンプラス	3,500	4,245.00	14,857,500	
大真空	3,000	2,476.00	7,428,000	
ローム	29,600	11,510.00	340,696,000	
浜松ホトニクス	51,000	6,500.00	331,500,000	
三井ハイテック	7,100	4,800.00	34,080,000	
新光電気工業	23,800	3,455.00	82,229,000	
京セラ	108,800	7,236.00	787,276,800	
太陽誘電	31,700	5,390.00	170,863,000	
村田製作所	209,700	8,998.00	1,886,880,600	
双葉電子工業	14,200	926.00	13,149,200	
北陸電気工業	6,100	939.00	5,727,900	
ニチコン	23,100	1,151.00	26,588,100	
日本ケミコン	5,200	1,800.00	9,360,000	
ＫＯＡ	10,500	1,626.00	17,073,000	
市光工業	12,100	728.00	8,808,800	
小糸製作所	42,600	7,220.00	307,572,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,500	11,030.00	137,875,000	

キヤノン電子	7,200	1,784.00	12,844,800	
キヤノン	355,200	2,552.00	906,470,400	
リコー	182,000	1,160.00	211,120,000	
象印マホービン	19,600	2,000.00	39,200,000	
東京エレクトロン	41,800	49,450.00	2,067,010,000	
トヨタ紡織	21,000	1,914.00	40,194,000	
ユニプレス	13,000	1,096.00	14,248,000	
豊田自動織機	57,500	9,510.00	546,825,000	
モリタホールディングス	12,100	1,727.00	20,896,700	
三櫻工業	11,100	1,179.00	13,086,900	
デンソー	157,300	7,179.00	1,129,256,700	
東海理化電機製作所	19,400	1,900.00	36,860,000	
川崎重工業	55,900	2,636.00	147,352,400	
日本車輌製造	3,400	2,464.00	8,377,600	
三菱ロジスネクスト	10,400	1,282.00	13,332,800	
日産自動車	843,900	576.70	486,677,130	
いすゞ自動車	206,700	1,161.00	239,978,700	
トヨタ自動車	723,500	8,507.00	6,154,814,500	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,100	938.00	84,513,800	
三菱自動車工業	267,600	313.00	83,758,800	
武蔵精密工業	16,500	2,107.00	34,765,500	
日産車体	11,000	789.00	8,679,000	
新明和工業	20,600	985.00	20,291,000	
極東開発工業	12,700	1,724.00	21,894,800	
トピー工業	7,600	1,377.00	10,465,200	
タチエス	11,900	1,206.00	14,351,400	
ＮＯＫ	35,600	1,485.00	52,866,000	
フタバ産業	19,900	596.00	11,860,400	
ＫＹＢ	8,200	2,993.00	24,542,600	
大同メタル工業	21,000	593.00	12,453,000	
プレス工業	39,600	342.00	13,543,200	
太平洋工業	15,900	1,256.00	19,970,400	
河西工業	16,400	443.00	7,265,200	
アイシン	51,900	4,080.00	211,752,000	
マツダ	225,100	903.00	203,265,300	

今仙電機製作所	8,900	750.00	6,675,000	
本田技研工業	562,200	3,290.00	1,849,638,000	
スズキ	141,800	4,704.00	667,027,200	
ＳＵＢＡＲＵ	205,400	2,140.00	439,556,000	
安永	4,600	1,248.00	5,740,800	
ヤマハ発動機	100,700	2,798.00	281,758,600	
ＴＢＫ	13,100	434.00	5,685,400	
エクセディ	10,000	1,676.00	16,760,000	
豊田合成	23,200	2,954.00	68,532,800	
愛三工業	14,200	704.00	9,996,800	
ヨロズ	8,000	1,319.00	10,552,000	
エフ・シー・シー	12,100	1,852.00	22,409,200	
シマノ	26,800	26,590.00	712,612,000	
テイ・エス　テック	33,200	1,616.00	53,651,200	
ジャムコ	8,200	950.00	7,790,000	
テルモ	218,800	4,007.00	876,731,600	
日機装	23,000	1,135.00	26,105,000	
日本エム・ディ・エム	4,600	2,226.00	10,239,600	
島津製作所	91,500	4,085.00	373,777,500	
ＪＭＳ	7,300	980.00	7,154,000	
長野計器	6,500	1,148.00	7,462,000	
ブイ・テクノロジー	3,400	5,920.00	20,128,000	
東京計器	6,400	955.00	6,112,000	
インターアクション	3,800	2,423.00	9,207,400	
東京精密	12,000	5,370.00	64,440,000	
マニー	28,600	2,796.00	79,965,600	
ニコン	109,900	1,050.00	115,395,000	
トプコン	37,300	1,504.00	56,099,200	
オリンパス	395,800	2,308.50	913,704,300	
理研計器	6,200	2,994.00	18,562,800	
タムロン	5,900	2,280.00	13,452,000	
ＨＯＹＡ	141,700	13,610.00	1,928,537,000	
ノーリツ鋼機	6,700	2,741.00	18,364,700	
エー・アンド・デイ	6,700	1,377.00	9,225,900	
朝日インテック	75,300	3,010.00	226,653,000	
シチズン時計	90,800	383.00	34,776,400	

メニコン	11,000	6,910.00	76,010,000	
松風	4,200	1,995.00	8,379,000	
セイコーホールディングス	10,100	2,005.00	20,250,500	
ニプロ	54,000	1,342.00	72,468,000	
スノーピーク	4,300	3,660.00	15,738,000	
パラマウントベッドホールディングス	13,800	2,254.00	31,105,200	
トランザクション	5,100	1,350.00	6,885,000	
ニホンフラッシュ	6,900	1,372.00	9,466,800	
前田工繊	7,700	3,335.00	25,679,500	
永大産業	13,800	299.00	4,126,200	
アートネイチャー	10,600	673.00	7,133,800	
バンダイナムコホールディングス	59,100	8,494.00	501,995,400	
ＳＨＯＥＩ	6,200	4,540.00	28,148,000	
フランスベッドホールディングス	11,700	954.00	11,161,800	
パイロットコーポレーション	12,700	3,545.00	45,021,500	
萩原工業	5,100	1,476.00	7,527,600	
トッパン・フォームズ	12,600	1,150.00	14,490,000	
フジシールインターナショナル	14,500	2,506.00	36,337,000	
タカラトミー	32,100	1,026.00	32,934,600	
廣済堂	6,800	1,008.00	6,854,400	
プロネクサス	8,200	1,208.00	9,905,600	
大建工業	5,500	2,085.00	11,467,500	
凸版印刷	107,700	1,935.00	208,399,500	
大日本印刷	86,100	2,301.00	198,116,100	
共同印刷	2,600	2,942.00	7,649,200	
ＮＩＳＳＨＡ	14,600	1,336.00	19,505,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	4,700	1,896.00	8,911,200	
アシックス	64,000	1,857.00	118,848,000	
ローランド	4,200	4,415.00	18,543,000	
ヤマハ	42,400	6,380.00	270,512,000	
河合楽器製作所	2,600	3,450.00	8,970,000	
ピジョン	46,000	4,075.00	187,450,000	
オリバー	2,000	2,895.00	5,790,000	
キングジム	8,400	972.00	8,164,800	
リンテック	15,400	2,537.00	39,069,800	
イトーキ	18,200	410.00	7,462,000	

任天堂	40,900	65,420.00	2,675,678,000	
三菱鉛筆	11,500	1,590.00	18,285,000	
タカラスタンダード	14,300	1,673.00	23,923,900	
コクヨ	34,600	1,778.00	61,518,800	
ナカバヤシ	10,500	621.00	6,520,500	
グローブライド	3,500	4,730.00	16,555,000	
オカムラ	27,500	1,314.00	36,135,000	
美津濃	7,000	2,253.00	15,771,000	
東京電力ホールディングス	603,000	348.00	209,844,000	
中部電力	218,200	1,335.00	291,297,000	
関西電力	271,500	1,094.50	297,156,750	
中国電力	101,800	1,292.00	131,525,600	
北陸電力	68,000	724.00	49,232,000	
東北電力	163,500	1,021.00	166,933,500	
四国電力	60,400	817.00	49,346,800	
九州電力	155,400	1,044.00	162,237,600	
北海道電力	68,700	468.00	32,151,600	
沖縄電力	13,800	1,464.00	20,203,200	
電源開発	56,700	1,833.00	103,931,100	
エフオン	5,300	1,078.00	5,713,400	
イーレックス	10,900	1,916.00	20,884,400	
レノバ	12,200	3,295.00	40,199,000	
東京瓦斯	138,200	2,319.50	320,554,900	
大阪瓦斯	128,100	2,065.00	264,526,500	
東邦瓦斯	35,000	6,400.00	224,000,000	
北海道瓦斯	5,900	1,535.00	9,056,500	
広島ガス	22,700	394.00	8,943,800	
西部ガスホールディングス	8,300	2,765.00	22,949,500	
静岡ガス	20,300	932.00	18,919,600	
メタウォーター	8,300	2,293.00	19,031,900	
ＳＢＳホールディングス	5,200	2,733.00	14,211,600	
東武鉄道	73,500	2,890.00	212,415,000	
相鉄ホールディングス	25,100	2,365.00	59,361,500	
東急	178,600	1,398.00	249,682,800	
京浜急行電鉄	91,600	1,495.00	136,942,000	
小田急電鉄	113,800	2,920.00	332,296,000	

京王電鉄	39,700	7,090.00	281,473,000	
京成電鉄	53,500	3,410.00	182,435,000	
富士急行	9,800	6,010.00	58,898,000	
新京成電鉄	3,300	2,173.00	7,170,900	
東日本旅客鉄道	125,900	7,450.00	937,955,000	
西日本旅客鉄道	64,100	5,881.00	376,972,100	
東海旅客鉄道	59,400	15,725.00	934,065,000	
西武ホールディングス	87,200	1,135.00	98,972,000	
鴻池運輸	11,500	1,182.00	13,593,000	
西日本鉄道	20,200	2,918.00	58,943,600	
ハマキョウレックス	5,600	3,270.00	18,312,000	
サカイ引越センター	3,200	4,995.00	15,984,000	
近鉄グループホールディングス	67,100	4,020.00	269,742,000	
阪急阪神ホールディングス	89,400	3,390.00	303,066,000	
南海電気鉄道	32,900	2,428.00	79,881,200	
京阪ホールディングス	29,900	4,250.00	127,075,000	
神戸電鉄	2,800	3,615.00	10,122,000	
名古屋鉄道	54,800	2,505.00	137,274,000	
山陽電気鉄道	6,300	1,886.00	11,881,800	
日本通運	23,200	8,260.00	191,632,000	
ヤマトホールディングス	94,800	3,000.00	284,400,000	
山九	17,300	4,895.00	84,683,500	
丸全昭和運輸	5,300	3,215.00	17,039,500	
センコーグループホールディングス	36,100	1,041.00	37,580,100	
トナミホールディングス	1,900	5,500.00	10,450,000	
ニッコンホールディングス	23,200	2,263.00	52,501,600	
福山通運	8,500	4,490.00	38,165,000	
セイノーホールディングス	50,400	1,541.00	77,666,400	
神奈川中央交通	2,400	3,675.00	8,820,000	
日立物流	14,600	3,535.00	51,611,000	
丸和運輸機関	13,800	1,970.00	27,186,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,000	1,811.00	12,677,000	
九州旅客鉄道	52,500	2,428.00	127,470,000	
ＳＧホールディングス	127,700	2,478.00	316,440,600	
日本郵船	55,700	3,885.00	216,394,500	
商船三井	39,800	3,890.00	154,822,000	

川崎汽船	20,800	2,620.00	54,496,000	
ＮＳユナイテッド海運	4,500	1,897.00	8,536,500	
飯野海運	34,600	522.00	18,061,200	
乾汽船	6,500	1,106.00	7,189,000	
日本航空	164,600	2,267.00	373,148,200	
ＡＮＡホールディングス	182,700	2,425.00	443,047,500	
トランコム	2,200	8,920.00	19,624,000	
日新	6,700	1,453.00	9,735,100	
三菱倉庫	23,700	3,425.00	81,172,500	
三井倉庫ホールディングス	7,500	2,300.00	17,250,000	
住友倉庫	23,600	1,501.00	35,423,600	
澁澤倉庫	4,500	2,209.00	9,940,500	
東陽倉庫	20,900	346.00	7,231,400	
日本トランスシティ	18,000	544.00	9,792,000	
川西倉庫	4,000	1,204.00	4,816,000	
安田倉庫	7,600	967.00	7,349,200	
東洋埠頭	4,900	1,500.00	7,350,000	
上組	37,000	2,205.00	81,585,000	
近鉄エクスプレス	12,700	2,808.00	35,661,600	
エーアイテイー	6,800	1,038.00	7,058,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	22,400	1,932.00	43,276,800	
システナ	24,800	2,364.00	58,627,200	
デジタルアーツ	4,100	9,900.00	40,590,000	
日鉄ソリューションズ	10,200	3,790.00	38,658,000	
キューブシステム	5,100	1,195.00	6,094,500	
コア	4,500	1,498.00	6,741,000	
ラクーンホールディングス	5,900	3,065.00	18,083,500	
ソリトンシステムズ	4,300	1,714.00	7,370,200	
ソフトクリエイトホールディングス	3,200	2,723.00	8,713,600	
ＴＩＳ	69,800	2,691.00	187,831,800	
電算システム	3,400	3,310.00	11,254,000	
グリー	44,100	575.00	25,357,500	
GMOペパボ	700	7,360.00	5,152,000	
コーエーテクモホールディングス	18,590	5,130.00	95,366,700	
三菱総合研究所	3,100	4,095.00	12,694,500	
ファインデックス	7,800	1,158.00	9,032,400	

ブレインパッド	2,100	5,270.00	11,067,000	
ＫＬａｂ	14,300	846.00	12,097,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,500	1,302.00	13,671,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,808.00	4,212,000	
ネクソン	177,100	3,585.00	634,903,500	
アイスタイル	13,900	459.00	6,380,100	
エムアップホールディングス	2,200	3,035.00	6,677,000	
エイチーム	6,600	1,788.00	11,800,800	
エニグモ	7,400	1,428.00	10,567,200	
テクノスジャパン	8,900	703.00	6,256,700	
コロプラ	23,700	868.00	20,571,600	
ブロードリーフ	36,500	558.00	20,367,000	
デジタルハーツホールディングス	4,600	1,645.00	7,567,000	
システム情報	5,800	1,053.00	6,107,400	
メディアドゥ	2,700	6,620.00	17,874,000	
じげん	22,000	437.00	9,614,000	
ブイキューブ	4,100	2,891.00	11,853,100	
サイバーリンクス	2,700	1,667.00	4,500,900	
フィックスターズ	9,500	1,011.00	9,604,500	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	1,529.00	6,116,000	
オプティム	5,200	2,903.00	15,095,600	
セレス	2,600	4,450.00	11,570,000	
ＳＨＩＦＴ	3,100	14,040.00	43,524,000	
ティーガイア	7,100	1,959.00	13,908,900	
テクマトリックス	11,400	2,133.00	24,316,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,400	2,248.00	39,115,200	
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	14,430.00	215,007,000	
システムリサーチ	3,000	2,032.00	6,096,000	
インターネットイニシアティブ	18,900	2,640.00	49,896,000	
さくらインターネット	10,300	789.00	8,126,700	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,600	6,740.00	10,784,000	
ＳＲＡホールディングス	4,700	2,678.00	12,586,600	
朝日ネット	7,500	787.00	5,902,500	
ｅＢＡＳＥ	9,300	1,003.00	9,327,900	
アバント	8,000	1,808.00	14,464,000	

アドソル日進	3,100	2,948.00	9,138,800	
フリービット	6,000	985.00	5,910,000	
コムチュア	6,300	2,674.00	16,846,200	
アステリア	6,400	870.00	5,568,000	
アイル	4,700	1,845.00	8,671,500	
マークラインズ	3,700	3,010.00	11,137,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,300	2,036.00	16,898,800	
ｇｕｍｉ	11,200	1,043.00	11,681,600	
テラスカイ	2,600	3,435.00	8,931,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,400	2,319.00	10,203,600	
ＰＣＩホールディングス	4,000	1,530.00	6,120,000	
ネオジャパン	2,100	1,756.00	3,687,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,700	3,700.00	6,290,000	
ダブルスタンダード	1,400	4,055.00	5,677,000	
オープンドア	4,900	1,918.00	9,398,200	
アカツキ	2,900	4,465.00	12,948,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,100	3,390.00	7,119,000	
カナミックネットワーク	8,500	758.00	6,443,000	
チェンジ	9,900	3,555.00	35,194,500	
オークネット	5,300	1,371.00	7,266,300	
エイトレッド	2,000	2,357.00	4,714,000	
マクロミル	16,700	953.00	15,915,100	
オロ	2,500	3,700.00	9,250,000	
ユーザーローカル	1,300	5,000.00	6,500,000	
プロトコーポレーション	8,000	1,242.00	9,936,000	
野村総合研究所	127,700	3,330.00	425,241,000	
サイバネットシステム	6,700	905.00	6,063,500	
インテージホールディングス	10,200	1,359.00	13,861,800	
ソースネクスト	38,400	354.00	13,593,600	
インフォコム	6,500	2,975.00	19,337,500	
ＨＥＲＯＺ	2,200	3,010.00	6,622,000	
ラクスル	6,000	5,490.00	32,940,000	
ＩＰＳ	1,600	2,739.00	4,382,400	
イーソル	5,100	1,261.00	6,431,100	
アルテリア・ネットワークス	8,400	1,610.00	13,524,000	
ＥｄｕＬａｂ	900	7,940.00	7,146,000	

ギフティ	3,400	3,425.00	11,645,000	
ベース	800	6,390.00	5,112,000	
フォーカスシステムズ	6,900	976.00	6,734,400	
クレスコ	6,300	1,633.00	10,287,900	
フジ・メディア・ホールディングス	72,400	1,338.00	96,871,200	
オービック	22,000	20,080.00	441,760,000	
ジャストシステム	9,900	6,310.00	62,469,000	
ＴＤＣソフト	7,700	1,036.00	7,977,200	
Ｚホールディングス	964,800	547.00	527,745,600	
トレンドマイクロ	37,500	5,420.00	203,250,000	
日本オラクル	14,200	10,600.00	150,520,000	
アルファシステムズ	2,200	3,655.00	8,041,000	
フューチャー	8,800	2,046.00	18,004,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,100	1,478.00	9,015,800	
ＳＢテクノロジー	2,800	3,295.00	9,226,000	
オービックビジネスコンサルタント	7,000	5,820.00	40,740,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	3,660.00	114,924,000	
アイティフォー	11,200	819.00	9,172,800	
大塚商会	37,700	5,320.00	200,564,000	
サイボウズ	8,300	2,565.00	21,289,500	
電通国際情報サービス	8,700	4,155.00	36,148,500	
ＡＣＣＥＳＳ	9,900	856.00	8,474,400	
デジタルガレージ	11,900	4,805.00	57,179,500	
ＥＭシステムズ	13,100	883.00	11,567,300	
ウェザーニューズ	2,400	5,510.00	13,224,000	
ＣＩＪ	6,500	926.00	6,019,000	
WOWOW	3,500	2,791.00	9,768,500	
スカラ	8,600	777.00	6,682,200	
ネットワンシステムズ	28,800	3,610.00	103,968,000	
アルゴグラフィックス	5,500	3,255.00	17,902,500	
マーベラス	12,800	891.00	11,404,800	
エイベックス	12,600	1,437.00	18,106,200	
日本ユニシス	24,500	3,475.00	85,137,500	
兼松エレクトロニクス	3,700	3,755.00	13,893,500	
都築電気	3,300	1,800.00	5,940,000	
ＴＢＳホールディングス	46,700	2,219.00	103,627,300	

日本テレビホールディングス	58,200	1,441.00	83,866,200	
朝日放送グループホールディングス	11,000	713.00	7,843,000	
テレビ朝日ホールディングス	21,900	2,090.00	45,771,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	47,900	490.00	23,471,000	
テレビ東京ホールディングス	5,200	2,390.00	12,428,000	
ビジョン	10,100	1,029.00	10,392,900	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,100	2,447.00	7,585,700	
コネクシオ	4,500	1,414.00	6,363,000	
日本電信電話	818,500	2,822.00	2,309,807,000	
ＫＤＤＩ	561,700	3,461.00	1,944,043,700	
ソフトバンク	636,500	1,425.50	907,330,750	
光通信	8,200	22,850.00	187,370,000	
エムティーアイ	9,500	834.00	7,923,000	
ＧＭＯインターネット	25,500	3,635.00	92,692,500	
ファイバーゲート	2,800	1,779.00	4,981,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	19,000	4,655.00	88,445,000	
学研ホールディングス	9,600	1,417.00	13,603,200	
ゼンリン	13,900	1,375.00	19,112,500	
アイネット	5,000	1,501.00	7,505,000	
松竹	4,700	13,240.00	62,228,000	
東宝	41,300	4,665.00	192,664,500	
東映	2,300	23,680.00	54,464,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	185,700	1,762.00	327,203,400	
ピー・シー・エー	1,400	4,575.00	6,405,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,200	1,818.00	5,817,600	
ＤＴＳ	13,700	2,601.00	35,633,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,900	6,180.00	184,782,000	
シーイーシー	8,500	1,458.00	12,393,000	
カプコン	60,000	3,700.00	222,000,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,284.00	5,392,800	
ジャステック	5,800	1,271.00	7,371,800	
ＳＣＳＫ	16,200	6,770.00	109,674,000	
日本システムウエア	3,000	2,086.00	6,258,000	
アイネス	8,500	1,430.00	12,155,000	
ＴＫＣ	11,400	3,450.00	39,330,000	
富士ソフト	7,400	5,510.00	40,774,000	

ＮＳＤ	22,400	1,863.00	41,731,200	
コナミホールディングス	25,400	6,660.00	169,164,000	
福井コンピュータホールディングス	3,600	4,560.00	16,416,000	
ＪＢＣＣホールディングス	6,000	1,446.00	8,676,000	
ミロク情報サービス	7,400	2,000.00	14,800,000	
ソフトバンクグループ	556,000	10,110.00	5,621,160,000	
伊藤忠食品	2,000	5,370.00	10,740,000	
エレマテック	7,500	1,030.00	7,725,000	
あらた	5,500	4,760.00	26,180,000	
東京エレクトロン　デバイス	2,700	4,530.00	12,231,000	
フィールズ	9,400	553.00	5,198,200	
双日	384,200	313.00	120,254,600	
アルフレッサ　ホールディングス	72,700	2,110.00	153,397,000	
横浜冷凍	18,400	911.00	16,762,400	
アルコニックス	8,000	1,647.00	13,176,000	
神戸物産	48,400	2,940.00	142,296,000	
あい　ホールディングス	10,800	2,206.00	23,824,800	
ダイワボウホールディングス	31,500	1,711.00	53,896,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	16,700	2,268.00	37,875,600	
ラクト・ジャパン	3,500	2,751.00	9,628,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,400	733.00	10,555,200	
八洲電機	8,800	973.00	8,562,400	
レスターホールディングス	7,700	2,048.00	15,769,600	
ジューテックホールディングス	3,200	1,020.00	3,264,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	32,400	946.00	30,650,400	
三洋貿易	8,900	1,150.00	10,235,000	
ウイン・パートナーズ	5,900	1,040.00	6,136,000	
シップヘルスケアホールディングス	25,000	3,000.00	75,000,000	
コメダホールディングス	15,200	1,967.00	29,898,400	
アセンテック	2,400	1,619.00	3,885,600	
小野建	7,400	1,399.00	10,352,600	
佐鳥電機	7,800	800.00	6,240,000	
伯東	5,700	1,305.00	7,438,500	
コンドーテック	7,100	1,046.00	7,426,600	
ナガイレーベン	9,700	2,694.00	26,131,800	
三菱食品	6,900	2,973.00	20,513,700	

松田産業	5,900	2,306.00	13,605,400	
第一興商	11,000	4,510.00	49,610,000	
メディパルホールディングス	69,700	2,205.00	153,688,500	
ＳＰＫ	5,500	1,314.00	7,227,000	
萩原電気ホールディングス	3,400	2,630.00	8,942,000	
アズワン	5,100	14,300.00	72,930,000	
尾家産業	4,000	1,298.00	5,192,000	
シモジマ	6,000	1,279.00	7,674,000	
ドウシシャ	6,700	1,932.00	12,944,400	
高速	5,000	1,457.00	7,285,000	
丸文	10,900	531.00	5,787,900	
ハピネット	6,900	1,569.00	10,826,100	
日本ライフライン	22,700	1,436.00	32,597,200	
タカショー	7,500	778.00	5,835,000	
マルカ	3,600	1,993.00	7,174,800	
ＩＤＯＭ	25,700	723.00	18,581,100	
進和	5,200	2,166.00	11,263,200	
ダイトロン	4,100	1,785.00	7,318,500	
シークス	9,800	1,594.00	15,621,200	
オーハシテクニカ	5,300	1,583.00	8,389,900	
伊藤忠商事	490,800	3,476.00	1,706,020,800	
丸紅	694,000	916.20	635,842,800	
長瀬産業	39,700	1,769.00	70,229,300	
蝶理	5,600	1,673.00	9,368,800	
豊田通商	70,100	4,870.00	341,387,000	
三共生興	16,400	536.00	8,790,400	
兼松	27,400	1,473.00	40,360,200	
三井物産	570,300	2,303.00	1,313,400,900	
日本紙パルプ商事	3,900	3,680.00	14,352,000	
カメイ	9,700	1,250.00	12,125,000	
スターゼン	5,800	2,418.00	14,024,400	
山善	26,400	1,048.00	27,667,200	
椿本興業	1,800	3,765.00	6,777,000	
住友商事	444,600	1,553.00	690,463,800	
内田洋行	3,000	4,885.00	14,655,000	
三菱商事	427,400	3,064.00	1,309,553,600	

第一実業	3,400	4,305.00	14,637,000	
キヤノンマーケティングジャパン	17,700	2,541.00	44,975,700	
西華産業	5,600	1,630.00	9,128,000	
佐藤商事	7,900	1,027.00	8,113,300	
菱洋エレクトロ	5,500	2,714.00	14,927,000	
東京産業	10,100	617.00	6,231,700	
ユアサ商事	7,100	3,170.00	22,507,000	
阪和興業	13,800	3,355.00	46,299,000	
正栄食品工業	4,600	4,420.00	20,332,000	
カナデン	7,200	1,206.00	8,683,200	
菱電商事	6,400	1,680.00	10,752,000	
フルサト工業	5,500	1,357.00	7,463,500	
岩谷産業	17,000	6,640.00	112,880,000	
極東貿易	3,700	1,397.00	5,168,900	
イワキ	10,800	721.00	7,786,800	
三愛石油	17,600	1,264.00	22,246,400	
稲畑産業	16,400	1,705.00	27,962,000	
ＧＳＩクレオス	5,200	1,263.00	6,567,600	
ヤマエ久野	6,800	1,160.00	7,888,000	
ワキタ	14,400	1,119.00	16,113,600	
東邦ホールディングス	23,100	1,942.00	44,860,200	
サンゲツ	18,800	1,598.00	30,042,400	
ミツウロコグループホールディングス	10,600	1,410.00	14,946,000	
シナネンホールディングス	3,100	2,917.00	9,042,700	
伊藤忠エネクス	14,400	1,077.00	15,508,800	
サンリオ	19,600	1,845.00	36,162,000	
サンワテクノス	6,000	1,160.00	6,960,000	
リョーサン	8,200	2,227.00	18,261,400	
新光商事	12,800	785.00	10,048,000	
トーホー	4,700	1,854.00	8,713,800	
三信電気	4,800	1,955.00	9,384,000	
東陽テクニカ	9,200	1,095.00	10,074,000	
モスフードサービス	10,200	3,145.00	32,079,000	
加賀電子	6,700	2,502.00	16,763,400	
ソーダニッカ	12,000	557.00	6,684,000	
立花エレテック	6,100	1,636.00	9,979,600	

ＰＡＬＴＡＣ	11,300	5,870.00	66,331,000	
三谷産業	12,400	458.00	5,679,200	
太平洋興発	7,700	691.00	5,320,700	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,300	2,813.00	6,469,900	
国際紙パルプ商事	24,700	245.00	6,051,500	
ヤマタネ	4,700	1,509.00	7,092,300	
日鉄物産	4,600	3,990.00	18,354,000	
泉州電業	2,500	3,615.00	9,037,500	
トラスコ中山	15,800	2,888.00	45,630,400	
オートバックスセブン	27,800	1,524.00	42,367,200	
モリト	10,000	639.00	6,390,000	
加藤産業	9,600	3,445.00	33,072,000	
イノテック	5,500	1,355.00	7,452,500	
イエローハット	13,300	1,878.00	24,977,400	
ＪＫホールディングス	8,100	869.00	7,038,900	
日伝	6,100	2,153.00	13,133,300	
杉本商事	4,100	2,325.00	9,532,500	
因幡電機産業	18,000	2,743.00	49,374,000	
東テク	2,900	2,808.00	8,143,200	
ミスミグループ本社	88,000	3,250.00	286,000,000	
タキヒヨー	4,100	1,779.00	7,293,900	
スズケン	29,900	4,135.00	123,636,500	
ジェコス	6,700	966.00	6,472,200	
ローソン	18,000	5,070.00	91,260,000	
サンエー	5,000	4,550.00	22,750,000	
カワチ薬品	5,000	2,742.00	13,710,000	
エービーシー・マート	11,000	6,270.00	68,970,000	
アスクル	6,400	4,075.00	26,080,000	
ゲオホールディングス	9,800	1,183.00	11,593,400	
アダストリア	10,200	2,025.00	20,655,000	
くら寿司	4,300	8,120.00	34,916,000	
キャンドゥ	4,900	2,075.00	10,167,500	
パルグループホールディングス	7,300	1,623.00	11,847,900	
エディオン	28,000	1,224.00	34,272,000	
サーラコーポレーション	16,100	614.00	9,885,400	
ハローズ	3,000	2,883.00	8,649,000	

フジオフードグループ本社	7,900	1,434.00	11,328,600	
あみやき亭	2,700	2,861.00	7,724,700	
大黒天物産	1,900	8,210.00	15,599,000	
ハニーズホールディングス	6,800	1,087.00	7,391,600	
アルペン	5,800	2,595.00	15,051,000	
クオールホールディングス	10,700	1,522.00	16,285,400	
ジンズホールディングス	4,000	8,620.00	34,480,000	
ビックカメラ	41,700	1,268.00	52,875,600	
ＤＣＭホールディングス	42,900	1,155.00	49,549,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	100,200	2,890.00	289,578,000	
アークランドサービスホールディングス	6,500	2,289.00	14,878,500	
Ｊ．フロント　リテイリング	85,800	1,064.00	91,291,200	
ドトール・日レスホールディングス	11,500	1,697.00	19,515,500	
マツモトキヨシホールディングス	29,000	4,820.00	139,780,000	
ブロンコビリー	5,000	2,392.00	11,960,000	
ＺＯＺＯ	41,800	3,425.00	143,165,000	
物語コーポレーション	4,000	7,460.00	29,840,000	
ココカラファイン	6,200	8,270.00	51,274,000	
三越伊勢丹ホールディングス	124,400	765.00	95,166,000	
Ｈａｍｅｅ	2,300	1,822.00	4,190,600	
ウエルシアホールディングス	37,100	3,725.00	138,197,500	
クリエイトＳＤホールディングス	10,200	3,590.00	36,618,000	
シュッピン	6,800	1,195.00	8,126,000	
オイシックス・ラ・大地	7,200	2,952.00	21,254,400	
ネクステージ	12,200	1,947.00	23,753,400	
ジョイフル本田	20,100	1,425.00	28,642,500	
ホットランド	8,000	1,311.00	10,488,000	
すかいらーくホールディングス	80,000	1,694.00	135,520,000	
ＳＦＰホールディングス	5,300	1,420.00	7,526,000	
綿半ホールディングス	6,600	1,298.00	8,566,800	
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	1,187.00	23,383,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,800	1,358.00	7,876,400	
ＢＥＥＮＯＳ	3,800	3,105.00	11,799,000	
あさひ	5,600	1,530.00	8,568,000	
日本調剤	5,500	1,750.00	9,625,000	

コスモス薬品	7,100	16,590.00	117,789,000	
セブン&アイ・ホールディングス	275,200	4,454.00	1,225,740,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	39,300	850.00	33,405,000	
ツルハホールディングス	15,300	13,540.00	207,162,000	
サンマルクホールディングス	7,300	1,712.00	12,497,600	
トリドールホールディングス	18,100	1,638.00	29,647,800	
ＪＭホールディングス	6,100	2,167.00	13,218,700	
アレンザホールディングス	5,400	1,428.00	7,711,200	
バロックジャパンリミテッド	8,000	803.00	6,424,000	
クスリのアオキホールディングス	7,200	8,290.00	59,688,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	38,700	5,310.00	205,497,000	
メディカルシステムネットワーク	8,300	858.00	7,121,400	
ノジマ	12,400	2,861.00	35,476,400	
カッパ・クリエイト	11,300	1,528.00	17,266,400	
良品計画	93,800	2,504.00	234,875,200	
アドヴァン	8,300	1,017.00	8,441,100	
アルビス	3,000	2,427.00	7,281,000	
コナカ	18,700	329.00	6,152,300	
Ｇ－７ホールディングス	4,600	2,788.00	12,824,800	
イオン北海道	11,100	1,283.00	14,241,300	
コジマ	14,000	815.00	11,410,000	
コーナン商事	9,800	3,335.00	32,683,000	
エコス	3,400	1,899.00	6,456,600	
ワタミ	11,400	970.00	11,058,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	140,400	2,561.00	359,564,400	
西松屋チェーン	15,900	1,850.00	29,415,000	
ゼンショーホールディングス	38,200	2,889.00	110,359,800	
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,697.00	10,351,700	
サイゼリヤ	11,400	2,280.00	25,992,000	
ＶＴホールディングス	29,100	445.00	12,949,500	
フジ・コーポレーション	3,000	2,827.00	8,481,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	2,105.00	18,524,000	
ハイデイ日高	10,400	1,767.00	18,376,800	
コロワイド	18,900	1,918.00	36,250,200	
ピーシーデポコーポレーション	11,400	489.00	5,574,600	

壱番屋	5,100	4,885.00	24,913,500	
スギホールディングス	14,100	8,770.00	123,657,000	
薬王堂ホールディングス	3,500	2,591.00	9,068,500	
スクロール	10,700	1,002.00	10,721,400	
ヨンドシーホールディングス	7,200	1,931.00	13,903,200	
木曽路	9,700	2,360.00	22,892,000	
ＳＲＳホールディングス	12,000	849.00	10,188,000	
千趣会	19,800	386.00	7,642,800	
リテールパートナーズ	9,200	1,394.00	12,824,800	
ケーヨー	16,300	701.00	11,426,300	
上新電機	8,200	3,000.00	24,600,000	
日本瓦斯	35,100	1,943.00	68,199,300	
ロイヤルホールディングス	9,200	2,043.00	18,795,600	
いなげや	8,000	1,660.00	13,280,000	
チヨダ	11,100	923.00	10,245,300	
ライフコーポレーション	5,400	3,515.00	18,981,000	
リンガーハット	9,800	2,306.00	22,598,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	11,600	700.00	8,120,000	
ＡＯＫＩホールディングス	17,900	636.00	11,384,400	
オークワ	11,600	1,199.00	13,908,400	
コメリ	10,800	3,055.00	32,994,000	
青山商事	19,500	847.00	16,516,500	
しまむら	8,100	11,570.00	93,717,000	
高島屋	53,500	1,193.00	63,825,500	
松屋	17,400	956.00	16,634,400	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	34,000	857.00	29,138,000	
近鉄百貨店	3,200	3,285.00	10,512,000	
丸井グループ	60,300	2,106.00	126,991,800	
アクシアル　リテイリング	5,700	4,735.00	26,989,500	
イオン	270,400	3,117.00	842,836,800	
イズミ	14,600	4,355.00	63,583,000	
平和堂	12,300	2,364.00	29,077,200	
フジ	8,700	2,246.00	19,540,200	
ヤオコー	8,100	7,050.00	57,105,000	
ゼビオホールディングス	10,400	937.00	9,744,800	
ケーズホールディングス	62,300	1,551.00	96,627,300	

日産東京販売ホールディングス	20,900	255.00	5,329,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,200	3,840.00	12,288,000	
ブックオフグループホールディングス	6,100	1,012.00	6,173,200	
アインホールディングス	10,400	6,780.00	70,512,000	
元気寿司	2,900	2,666.00	7,731,400	
ヤマダホールディングス	234,300	578.00	135,425,400	
アークランドサカモト	11,400	1,678.00	19,129,200	
ニトリホールディングス	28,000	20,175.00	564,900,000	
グルメ杵屋	6,900	948.00	6,541,200	
吉野家ホールディングス	24,400	2,158.00	52,655,200	
松屋フーズホールディングス	3,600	3,505.00	12,618,000	
サガミホールディングス	12,900	1,105.00	14,254,500	
関西スーパーマーケット	6,600	1,128.00	7,444,800	
王将フードサービス	4,600	5,740.00	26,404,000	
プレナス	8,300	1,859.00	15,429,700	
ミニストップ	6,900	1,462.00	10,087,800	
アークス	13,100	2,376.00	31,125,600	
バローホールディングス	13,900	2,476.00	34,416,400	
ベルク	3,600	6,070.00	21,852,000	
ファーストリテイリング	9,400	90,720.00	852,768,000	
サンドラッグ	26,500	4,045.00	107,192,500	
ベルーナ	15,800	1,234.00	19,497,200	
じもとホールディングス	5,600	736.00	4,121,600	
めぶきフィナンシャルグループ	366,400	251.00	91,966,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,400	1,276.00	11,994,400	
九州フィナンシャルグループ	142,600	454.00	64,740,400	
ゆうちょ銀行	199,000	993.00	197,607,000	
富山第一銀行	18,800	296.00	5,564,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	429,100	431.00	184,942,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	47,900	738.00	35,350,200	
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,331.00	8,917,700	
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,386.00	27,439,000	
ひろぎんホールディングス	104,600	631.00	66,002,600	
新生銀行	57,800	1,685.00	97,393,000	
あおぞら銀行	42,200	2,401.00	101,322,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,819,900	586.50	2,826,871,350	

りそなホールディングス	811,060	450.50	365,382,530	
三井住友トラスト・ホールディングス	132,500	3,757.00	497,802,500	
三井住友フィナンシャルグループ	487,200	3,881.00	1,890,823,200	
千葉銀行	235,500	699.00	164,614,500	
群馬銀行	145,900	363.00	52,961,700	
武蔵野銀行	10,500	1,727.00	18,133,500	
千葉興業銀行	20,200	281.00	5,676,200	
筑波銀行	30,600	177.00	5,416,200	
七十七銀行	22,300	1,453.00	32,401,900	
青森銀行	5,600	2,412.00	13,507,200	
秋田銀行	4,800	1,412.00	6,777,600	
山形銀行	8,600	1,040.00	8,944,000	
岩手銀行	4,800	2,230.00	10,704,000	
東邦銀行	67,000	227.00	15,209,000	
東北銀行	4,000	1,057.00	4,228,000	
みちのく銀行	4,500	1,031.00	4,639,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,800	2,001.00	127,663,800	
静岡銀行	168,800	847.00	142,973,600	
十六銀行	8,900	2,091.00	18,609,900	
スルガ銀行	64,200	405.00	26,001,000	
八十二銀行	154,500	374.00	57,783,000	
山梨中央銀行	8,100	857.00	6,941,700	
大垣共立銀行	14,200	2,079.00	29,521,800	
福井銀行	6,200	1,873.00	11,612,600	
北國銀行	6,700	2,543.00	17,038,100	
清水銀行	3,000	1,640.00	4,920,000	
富山銀行	1,500	2,799.00	4,198,500	
滋賀銀行	14,100	2,294.00	32,345,400	
南都銀行	10,400	1,839.00	19,125,600	
百五銀行	66,300	314.00	20,818,200	
京都銀行	25,300	6,380.00	161,414,000	
紀陽銀行	25,100	1,533.00	38,478,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	47,200	975.00	46,020,000	
山陰合同銀行	46,400	528.00	24,499,200	
中国銀行	61,200	885.00	54,162,000	
伊予銀行	92,600	620.00	57,412,000	

百十四銀行	7,500	1,577.00	11,827,500	
四国銀行	9,800	744.00	7,291,200	
阿波銀行	11,000	2,253.00	24,783,000	
大分銀行	4,500	2,019.00	9,085,500	
宮崎銀行	4,900	2,244.00	10,995,600	
佐賀銀行	4,500	1,433.00	6,448,500	
沖縄銀行	6,700	2,870.00	19,229,000	
琉球銀行	15,300	741.00	11,337,300	
セブン銀行	238,400	250.00	59,600,000	
みずほフィナンシャルグループ	956,100	1,543.50	1,475,740,350	
山口フィナンシャルグループ	89,000	696.00	61,944,000	
名古屋銀行	5,600	2,939.00	16,458,400	
北洋銀行	108,200	291.00	31,486,200	
愛知銀行	2,400	2,885.00	6,924,000	
中京銀行	3,000	1,681.00	5,043,000	
愛媛銀行	9,500	961.00	9,129,500	
京葉銀行	32,400	431.00	13,964,400	
栃木銀行	40,500	184.00	7,452,000	
北日本銀行	2,700	1,877.00	5,067,900	
東和銀行	12,600	632.00	7,963,200	
トモニホールディングス	57,600	309.00	17,798,400	
フィデアホールディングス	75,000	133.00	9,975,000	
池田泉州ホールディングス	82,400	172.00	14,172,800	
ＦＰＧ	22,000	697.00	15,334,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	4,500	1,575.00	7,087,500	
ＳＢＩホールディングス	86,300	3,170.00	273,571,000	
ジャフコ　グループ	11,200	7,530.00	84,336,000	
大和証券グループ本社	523,100	581.70	304,287,270	
野村ホールディングス	1,075,400	585.30	629,431,620	
岡三証券グループ	62,600	462.00	28,921,200	
丸三証券	22,100	644.00	14,232,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,300	410.00	31,283,000	
水戸証券	24,200	312.00	7,550,400	
いちよし証券	16,300	612.00	9,975,600	
松井証券	36,200	935.00	33,847,000	
マネックスグループ	63,800	1,067.00	68,074,600	

極東証券	10,900	853.00	9,297,700	
岩井コスモホールディングス	7,500	1,762.00	13,215,000	
藍澤證券	13,900	1,042.00	14,483,800	
スパークス・グループ	33,800	314.00	10,613,200	
かんぽ生命保険	87,900	2,232.00	196,192,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	124,000	4,134.00	512,616,000	
アニコム　ホールディングス	22,200	975.00	21,645,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	170,300	3,231.00	550,239,300	
第一生命ホールディングス	371,600	2,020.50	750,817,800	
東京海上ホールディングス	233,300	5,281.00	1,232,057,300	
Ｔ＆Ｄホールディングス	210,200	1,389.00	291,967,800	
アドバンスクリエイト	4,000	1,086.00	4,344,000	
全国保証	18,500	5,210.00	96,385,000	
日本モーゲージサービス	4,200	1,112.00	4,670,400	
アルヒ	11,500	1,894.00	21,781,000	
プレミアグループ	3,900	2,576.00	10,046,400	
クレディセゾン	41,500	1,322.00	54,863,000	
芙蓉総合リース	7,400	7,330.00	54,242,000	
みずほリース	11,100	3,350.00	37,185,000	
東京センチュリー	16,300	7,280.00	118,664,000	
日本証券金融	28,700	796.00	22,845,200	
アイフル	123,900	317.00	39,276,300	
リコーリース	6,100	3,520.00	21,472,000	
イオンフィナンシャルサービス	43,200	1,310.00	56,592,000	
アコム	142,000	523.00	74,266,000	
ジャックス	8,500	2,209.00	18,776,500	
オリエントコーポレーション	199,800	142.00	28,371,600	
オリックス	435,200	1,816.50	790,540,800	
三菱ＨＣキャピタル	240,180	632.00	151,793,760	
日本取引所グループ	190,500	2,795.00	532,447,500	
イー・ギャランティ	8,800	2,106.00	18,532,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,500	2,014.00	7,049,000	
いちご	82,300	313.00	25,759,900	
日本駐車場開発	89,800	161.00	14,457,800	
スター・マイカ・ホールディングス	5,200	1,200.00	6,240,000	

ＳＲＥホールディングス	1,000	5,150.00	5,150,000	
ヒューリック	149,300	1,277.00	190,656,100	
三栄建築設計	3,500	2,036.00	7,126,000	
野村不動産ホールディングス	42,700	2,669.00	113,966,300	
三重交通グループホールディングス	18,800	493.00	9,268,400	
サムティ	10,100	2,003.00	20,230,300	
ディア・ライフ	16,100	467.00	7,518,700	
日本商業開発	6,500	1,700.00	11,050,000	
プレサンスコーポレーション	11,800	1,778.00	20,980,400	
日本管理センター	5,600	1,287.00	7,207,200	
フージャースホールディングス	13,600	688.00	9,356,800	
オープンハウス	22,200	5,020.00	111,444,000	
東急不動産ホールディングス	191,300	633.00	121,092,900	
飯田グループホールディングス	58,100	2,798.00	162,563,800	
ハウスドゥ	4,800	1,136.00	5,452,800	
ケイアイスター不動産	2,300	3,865.00	8,889,500	
グッドコムアセット	3,900	1,521.00	5,931,900	
ジェイ・エス・ビー	1,700	3,235.00	5,499,500	
パーク２４	38,300	1,962.00	75,144,600	
パラカ	4,600	1,694.00	7,792,400	
三井不動産	321,200	2,460.00	790,152,000	
三菱地所	462,700	1,917.00	886,995,900	
平和不動産	12,000	3,620.00	43,440,000	
東京建物	70,200	1,691.00	118,708,200	
ダイビル	19,000	1,323.00	25,137,000	
京阪神ビルディング	12,900	1,499.00	19,337,100	
住友不動産	158,600	3,787.00	600,618,200	
テーオーシー	16,500	774.00	12,771,000	
東京楽天地	1,800	4,785.00	8,613,000	
スターツコーポレーション	7,800	2,874.00	22,417,200	
フジ住宅	11,800	746.00	8,802,800	
空港施設	13,100	585.00	7,663,500	
ゴールドクレスト	7,400	1,673.00	12,380,200	
日本エスコン	13,600	787.00	10,703,200	
タカラレーベン	35,000	374.00	13,090,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,800	907.00	7,074,600	

イオンモール	35,500	1,824.00	64,752,000	
カチタス	17,500	3,250.00	56,875,000	
トーセイ	11,500	1,125.00	12,937,500	
サンフロンティア不動産	11,200	947.00	10,606,400	
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	1,096.00	8,329,600	
ランドビジネス	13,800	382.00	5,271,600	
日本空港ビルデング	22,800	5,030.00	114,684,000	
日本工営	4,700	3,055.00	14,358,500	
ＬＩＦＵＬＬ	29,900	403.00	12,049,700	
ミクシィ	13,200	2,813.00	37,131,600	
ジェイエイシーリクルートメント	5,500	1,850.00	10,175,000	
日本M&Aセンター	112,200	3,045.00	341,649,000	
メンバーズ	2,600	2,761.00	7,178,600	
ＵＴグループ	10,100	3,705.00	37,420,500	
アイティメディア	2,900	1,966.00	5,701,400	
タケエイ	9,100	1,320.00	12,012,000	
夢真ビーネックスグループ	10,100	1,492.00	15,069,200	
コシダカホールディングス	19,800	580.00	11,484,000	
パソナグループ	7,900	1,908.00	15,073,200	
リンクアンドモチベーション	15,200	627.00	9,530,400	
ＧＣＡ	13,300	835.00	11,105,500	
エス・エム・エス	23,900	3,375.00	80,662,500	
パーソルホールディングス	68,900	2,197.00	151,373,300	
リニカル	6,600	760.00	5,016,000	
クックパッド	29,600	320.00	9,472,000	
スタジオアリス	4,600	2,325.00	10,695,000	
シミックホールディングス	4,900	1,569.00	7,688,100	
綜合警備保障	27,100	5,000.00	135,500,000	
カカクコム	50,900	3,085.00	157,026,500	
アイロムグループ	3,300	2,445.00	8,068,500	
セントケア・ホールディング	6,400	1,238.00	7,923,200	
ルネサンス	7,300	1,186.00	8,657,800	
ディップ	10,900	2,922.00	31,849,800	
デジタルホールディングス	5,400	2,076.00	11,210,400	
新日本科学	11,100	729.00	8,091,900	
ベネフィット・ワン	25,400	2,881.00	73,177,400	

エムスリー	120,400	8,094.00	974,517,600	
アウトソーシング	39,700	1,751.00	69,514,700	
ウェルネット	14,600	584.00	8,526,400	
ワールドホールディングス	2,900	2,889.00	8,378,100	
ディー・エヌ・エー	29,600	2,192.00	64,883,200	
博報堂ＤＹホールディングス	95,200	1,852.00	176,310,400	
ぐるなび	15,600	602.00	9,391,200	
タカミヤ	12,900	567.00	7,314,300	
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	815.00	6,275,500	
ファンコミュニケーションズ	23,800	416.00	9,900,800	
ライク	2,700	2,261.00	6,104,700	
エスプール	18,300	1,027.00	18,794,100	
ＷＤＢホールディングス	3,700	2,527.00	9,349,900	
手間いらず	900	5,550.00	4,995,000	
アドウェイズ	9,900	859.00	8,504,100	
バリューコマース	4,800	3,690.00	17,712,000	
インフォマート	70,900	1,028.00	72,885,200	
ＪＰホールディングス	27,700	324.00	8,974,800	
ＥＰＳホールディングス	10,700	1,170.00	12,519,000	
プレステージ・インターナショナル	26,500	817.00	21,650,500	
アミューズ	4,600	2,410.00	11,086,000	
ドリームインキュベータ	4,300	1,094.00	4,704,200	
クイック	6,300	1,199.00	7,553,700	
電通グループ	77,000	3,470.00	267,190,000	
イオンファンタジー	3,400	2,138.00	7,269,200	
シーティーエス	8,900	892.00	7,938,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	19,800	3,510.00	69,498,000	
アルプス技研	6,800	2,107.00	14,327,600	
日本空調サービス	11,200	740.00	8,288,000	
オリエンタルランド	72,600	16,000.00	1,161,600,000	
ダスキン	16,400	2,744.00	45,001,600	
明光ネットワークジャパン	13,600	625.00	8,500,000	
ファルコホールディングス	4,600	1,676.00	7,709,600	
ラウンドワン	24,400	1,142.00	27,864,800	
リゾートトラスト	32,900	1,783.00	58,660,700	
ビー・エム・エル	8,800	3,685.00	32,428,000	

りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,429.00	15,290,300	
リソー教育	40,400	319.00	12,887,600	
ユー・エス・エス	76,600	2,124.00	162,698,400	
東京個別指導学院	9,400	674.00	6,335,600	
サイバーエージェント	168,800	1,940.00	327,472,000	
楽天グループ	318,700	1,306.00	416,222,200	
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,536.00	7,680,000	
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	1,192.00	6,913,600	
セントラルスポーツ	4,100	2,445.00	10,024,500	
フルキャストホールディングス	7,000	1,945.00	13,615,000	
エン・ジャパン	12,500	3,410.00	42,625,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,800	8,710.00	120,198,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	2,900	15,190.00	44,051,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,900	2,346.00	11,495,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,100	823.00	5,020,300	
イー・ガーディアン	3,300	3,165.00	10,444,500	
ジャパンマテリアル	21,400	1,376.00	29,446,400	
ベクトル	9,600	1,268.00	12,172,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,900	1,297.00	7,652,300	
キャリアリンク	2,700	2,537.00	6,849,900	
ＩＢＪ	7,800	950.00	7,410,000	
アサンテ	4,100	1,777.00	7,285,700	
バリューＨＲ	4,000	1,617.00	6,468,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,600	5,450.00	30,520,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,500	1,719.00	6,016,500	
シグマクシス	4,500	1,823.00	8,203,500	
ウィルグループ	6,600	1,101.00	7,266,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,800	274.00	4,329,200	
メドピア	3,300	6,570.00	21,681,000	
リクルートホールディングス	488,800	5,271.00	2,576,464,800	
エラン	9,400	1,400.00	13,160,000	
日本郵政	516,600	934.70	482,866,020	
ベルシステム２４ホールディングス	12,100	1,789.00	21,646,900	
鎌倉新書	8,200	1,287.00	10,553,400	
アトラエ	5,000	1,791.00	8,955,000	

ストライク	2,700	4,890.00	13,203,000	
ソラスト	17,200	1,451.00	24,957,200	
セラク	2,800	2,006.00	5,616,800	
インソース	6,100	2,372.00	14,469,200	
ベイカレント・コンサルティング	4,500	26,040.00	117,180,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,200	3,150.00	6,930,000	
アイモバイル	3,300	1,460.00	4,818,000	
グレイステクノロジー	7,200	3,295.00	23,724,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,800	2,332.00	46,173,600	
ミダック	1,800	4,660.00	8,388,000	
日総工産	7,100	819.00	5,814,900	
キュービーネットホールディングス	5,000	1,830.00	9,150,000	
ＲＰＡホールディングス	9,700	675.00	6,547,500	
マネジメントソリューションズ	4,000	2,247.00	8,988,000	
プロレド・パートナーズ	1,200	3,230.00	3,876,000	
カーブスホールディングス	20,200	1,051.00	21,230,200	
ダイレクトマーケティングミックス	3,200	3,475.00	11,120,000	
ポピンズホールディングス	1,700	4,385.00	7,454,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,100	4,060.00	12,586,000	
リログループ	38,300	2,330.00	89,239,000	
東祥	5,300	1,869.00	9,905,700	
エイチ・アイ・エス	10,400	2,229.00	23,181,600	
ラックランド	3,000	2,470.00	7,410,000	
共立メンテナンス	11,700	3,530.00	41,301,000	
イチネンホールディングス	8,600	1,353.00	11,635,800	
建設技術研究所	5,000	2,581.00	12,905,000	
長大	3,500	1,797.00	6,289,500	
燦ホールディングス	4,800	1,117.00	5,361,600	
東京テアトル	6,200	1,269.00	7,867,800	
ナガワ	2,200	8,690.00	19,118,000	
東京都競馬	4,700	5,970.00	28,059,000	
カナモト	12,400	2,877.00	35,674,800	
西尾レントオール	6,500	3,150.00	20,475,000	
トランス・コスモス	6,900	3,280.00	22,632,000	
乃村工藝社	30,700	884.00	27,138,800	

日本管財	7,100	2,195.00	15,584,500	
トーカイ	6,700	2,483.00	16,636,100	
セコム	67,200	9,313.00	625,833,600	
セントラル警備保障	3,800	3,325.00	12,635,000	
丹青社	15,500	874.00	13,547,000	
メイテック	8,900	5,930.00	52,777,000	
応用地質	8,800	1,338.00	11,774,400	
船井総研ホールディングス	14,600	2,138.00	31,214,800	
オオバ	8,700	861.00	7,490,700	
ベネッセホールディングス	26,000	2,556.00	66,456,000	
イオンディライト	8,300	3,440.00	28,552,000	
ダイセキ	11,800	4,210.00	49,678,000	
合　計	74,506,080		191,803,100,950	

(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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 4月13日現在）	（2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	315,440,332	271,148,043
コール・ローン	219,278,434	140,524,695
国債証券	103,352,030,980	105,477,475,540
地方債証券	8,508,860,805	8,542,550,820
特殊債券	13,059,052,368	11,582,718,565
社債券	6,272,811,000	4,045,168,000
未収利息	243,655,508	230,194,166

前払費用	6,060,238	3,090,887
流動資産合計	131,977,189,665	130,292,870,716
資産合計	131,977,189,665	130,292,870,716
負債の部		
流動負債		
未払金	-	52,732,500
未払解約金	1,839,311	3,455,246
未払利息	594	384
その他未払費用	219,836	5,597
流動負債合計	2,059,741	56,193,727
負債合計	2,059,741	56,193,727
純資産の部		
元本等		
元本	102,757,947,265	102,034,101,931
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	29,217,182,659	28,202,575,058
元本等合計	131,975,129,924	130,236,676,989
純資産合計	131,975,129,924	130,236,676,989
負債純資産合計	131,977,189,665	130,292,870,716

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2020年 4月13日現在）	（2021年 4月13日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	102,757,947,265口	102,034,101,931口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2843円 (10,000口当たりの純資産額　12,843円)	1口当たり純資産額　1.2764円 (10,000口当たりの純資産額　12,764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14日 至 2021年 4月13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、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 4月13日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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13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	135,164,231,551円
同期中における追加設定元本額	26,368,392,039円
同期中における一部解約元本額	58,774,676,325円
2020年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	4,916,603,754円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	8,113,528,180円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,680,333,318円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	760,735,655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）	50,269,872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）	178,435,133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）	338,879,703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）	323,559,798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）	131,188,831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）	240,773,140円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	120,113,280円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,134,904,474円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	857,165,158円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	298,800,465円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	13,814,140円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,104,968,204円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	354,564,578円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	480,307,279円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	82,224,866円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	7,138,094円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	43,025,062円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	765,954円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	1,983,487円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	445,605円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,688,392円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,908,244,271円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	15,261,189,102円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,456,184,151円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,516,600,710円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	310,135,056円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	527,038,286円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,972,815円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	215,926,783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＞	103,533,600円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,849,952,469円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,964,073,011円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,434,015,824円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	9,071,254,432円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	2,114,879円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,357,582,563円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	448,466,921円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	622,144,119円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	170,571,267円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	41,651,607円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,741,366,557円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,265,783,446円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	884,439,072円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	201,287,819円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	17,629,769円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	309,173,518円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,580,424,372円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	257,779,674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＞	379,382,709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＞	1,223,935,464円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	1,393,683,063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＞	4,003,193,514円
合計	102,757,947,265円

（2021年 4月13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	102,757,947,265円
同期中における追加設定元本額	23,130,574,048円
同期中における一部解約元本額	23,854,419,382円
2021年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	6,094,869,774円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	10,799,784,589円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,409,904,423円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	650,911,787円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	43,319,205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）	200,477,835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）	430,298,494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）	542,880,234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）	237,927,219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）	394,951,809円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	139,859,405円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,262,690,529円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	398,901,014円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,590,257円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	32,881,227円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,220,630,022円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	398,613,032円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	568,525,120円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	118,550,076円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	33,192,378円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	90,202,755円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	79,038,998円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	126,731,002円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	35,039,983円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,679,578円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,615,752,867円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	14,461,969,440円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,723,802,531円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	16,890,224,082円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	330,039,962円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	596,483,349円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	264,477,800円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	120,304,219円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,898,851,071円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,189,946,035円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,559,318,640円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	9,289,850,382円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	948,903円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,263,341,710円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	469,017,209円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	595,459,501円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	180,178,556円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,116,807円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,639,537,473円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,264,897,999円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	808,518,064円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	216,345,674円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	18,836,644円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	299,035,679円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,582,241,420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＞	344,315,421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＞	907,783,289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＞	758,516,436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＞	3,372,540,023円
合計	102,034,101,931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４１９回利付国債（２年）	2,090,000,000	2,098,192,800	
	第４２０回利付国債（２年）	510,000,000	512,106,300	
	第４２１回利付国債（２年）	390,000,000	391,688,700	
	第４２２回利付国債（２年）	390,000,000	391,797,900	
	第４２３回利付国債（２年）	120,000,000	120,330,000	
	第１３３回利付国債（５年）	48,000,000	48,158,400	
	第１３４回利付国債（５年）	110,000,000	110,435,600	
	第１３５回利付国債（５年）	190,000,000	190,864,500	
	第１３６回利付国債（５年）	500,000,000	502,570,000	
	第１３７回利付国債（５年）	100,000,000	100,586,000	
	第１３８回利付国債（５年）	600,000,000	603,960,000	
	第１３９回利付国債（５年）	260,000,000	261,835,600	
	第１４０回利付国債（５年）	600,000,000	604,602,000	
	第１４１回利付国債（５年）	15,000,000	15,121,650	
	第１４２回利付国債（５年）	680,000,000	685,786,800	
	第１４３回利付国債（５年）	770,000,000	776,837,600	
	第１４４回利付国債（５年）	1,250,000,000	1,261,562,500	
	第１４５回利付国債（５年）	1,310,000,000	1,322,851,100	

第１４６回利付国債（５年）	1,840,000,000	1,857,756,000	
第１４７回利付国債（５年）	340,000,000	341,768,000	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	57,764,400	
第２回利付国債（４０年）	242,000,000	339,087,980	
第３回利付国債（４０年）	185,000,000	260,539,200	
第４回利付国債（４０年）	247,000,000	349,495,120	
第５回利付国債（４０年）	225,000,000	308,387,250	
第６回利付国債（４０年）	240,000,000	324,475,200	
第７回利付国債（４０年）	255,000,000	332,129,850	
第８回利付国債（４０年）	300,000,000	365,598,000	
第９回利付国債（４０年）	483,000,000	441,090,090	
第１０回利付国債（４０年）	470,000,000	502,759,000	
第１１回利付国債（４０年）	320,000,000	332,313,600	
第１２回利付国債（４０年）	390,000,000	366,069,600	
第１３回利付国債（４０年）	465,000,000	435,877,050	
第３２６回利付国債（１０年）	77,000,000	78,078,770	
第３２７回利付国債（１０年）	25,000,000	25,392,500	
第３２８回利付国債（１０年）	130,000,000	131,836,900	
第３２９回利付国債（１０年）	2,030,000,000	2,071,330,800	
第３３０回利付国債（１０年）	1,285,000,000	1,314,349,400	
第３３２回利付国債（１０年）	793,000,000	808,812,420	
第３３３回利付国債（１０年）	815,000,000	832,750,700	
第３３４回利付国債（１０年）	315,000,000	322,452,900	
第３３５回利付国債（１０年）	50,000,000	51,087,000	
第３３６回利付国債（１０年）	340,000,000	347,864,200	
第３３７回利付国債（１０年）	120,000,000	121,887,600	
第３３８回利付国債（１０年）	805,000,000	821,695,700	
第３３９回利付国債（１０年）	785,000,000	802,160,100	
第３４０回利付国債（１０年）	770,000,000	787,848,600	
第３４１回利付国債（１０年）	557,000,000	567,616,420	
第３４２回利付国債（１０年）	350,000,000	353,468,500	
第３４３回利付国債（１０年）	890,000,000	898,802,100	
第３４４回利付国債（１０年）	811,000,000	818,964,020	
第３４５回利付国債（１０年）	818,000,000	826,171,820	
第３４６回利付国債（１０年）	640,000,000	646,284,800	
第３４７回利付国債（１０年）	540,000,000	545,362,200	

第３４８回利付国債（１０年）	345,000,000	348,339,600	
第３４９回利付国債（１０年）	250,000,000	252,430,000	
第３５０回利付国債（１０年）	640,000,000	646,003,200	
第３５１回利付国債（１０年）	290,000,000	292,607,100	
第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	796,762,400	
第３５３回利付国債（１０年）	640,000,000	645,164,800	
第３５４回利付国債（１０年）	865,000,000	871,513,450	
第３５５回利付国債（１０年）	870,000,000	876,037,800	
第３５６回利付国債（１０年）	850,000,000	855,006,500	
第３５７回利付国債（１０年）	365,000,000	366,894,350	
第３５８回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,104,884,000	
第３５９回利付国債（１０年）	780,000,000	782,488,200	
第３６０回利付国債（１０年）	1,870,000,000	1,874,375,800	
第３６１回利付国債（１０年）	1,020,000,000	1,020,979,200	
第２回利付国債（３０年）	510,000,000	616,197,300	
第４回利付国債（３０年）	340,000,000	431,572,200	
第５回利付国債（３０年）	290,000,000	351,059,500	
第７回利付国債（３０年）	474,000,000	586,210,020	
第９回利付国債（３０年）	100,000,000	114,223,000	
第１０回利付国債（３０年）	555,000,000	615,356,250	
第１１回利付国債（３０年）	430,000,000	508,225,600	
第１２回利付国債（３０年）	590,000,000	727,782,700	
第１４回利付国債（３０年）	712,000,000	910,021,440	
第１６回利付国債（３０年）	465,000,000	603,746,700	
第１８回利付国債（３０年）	450,000,000	575,352,000	
第１９回利付国債（３０年）	470,000,000	602,389,600	
第２１回利付国債（３０年）	345,000,000	444,549,750	
第２２回利付国債（３０年）	315,000,000	416,118,150	
第２３回利付国債（３０年）	329,000,000	435,691,410	
第２４回利付国債（３０年）	310,000,000	411,825,700	
第２５回利付国債（３０年）	300,000,000	390,171,000	
第２６回利付国債（３０年）	363,000,000	478,539,270	
第２７回利付国債（３０年）	440,000,000	589,771,600	
第２８回利付国債（３０年）	386,000,000	519,899,540	
第２９回利付国債（３０年）	177,000,000	236,431,290	
第３０回利付国債（３０年）	472,000,000	625,182,880	

第３１回利付国債（３０年）	315,000,000	413,059,500	
第３２回利付国債（３０年）	390,000,000	520,404,300	
第３３回利付国債（３０年）	378,000,000	485,752,680	
第３４回利付国債（３０年）	457,000,000	606,608,090	
第３５回利付国債（３０年）	390,000,000	504,543,000	
第３６回利付国債（３０年）	60,000,000	77,865,000	
第３７回利付国債（３０年）	355,000,000	455,184,550	
第３８回利付国債（３０年）	350,000,000	442,991,500	
第３９回利付国債（３０年）	190,000,000	244,826,400	
第４０回利付国債（３０年）	270,000,000	342,532,800	
第４１回利付国債（３０年）	270,000,000	337,383,900	
第４２回利付国債（３０年）	260,000,000	325,189,800	
第４３回利付国債（３０年）	305,000,000	381,829,500	
第４４回利付国債（３０年）	300,000,000	375,912,000	
第４５回利付国債（３０年）	345,000,000	417,615,600	
第４６回利付国債（３０年）	295,000,000	357,289,250	
第４７回利付国債（３０年）	280,000,000	345,702,000	
第４８回利付国債（３０年）	345,000,000	410,822,550	
第４９回利付国債（３０年）	355,000,000	422,879,550	
第５０回利付国債（３０年）	355,000,000	373,637,500	
第５１回利付国債（３０年）	345,000,000	322,706,100	
第５２回利付国債（３０年）	353,000,000	346,356,540	
第５３回利付国債（３０年）	247,000,000	247,824,980	
第５４回利付国債（３０年）	45,000,000	47,231,550	
第５５回利付国債（３０年）	335,000,000	351,351,350	
第５６回利付国債（３０年）	320,000,000	335,366,400	
第５７回利付国債（３０年）	355,000,000	371,756,000	
第５８回利付国債（３０年）	350,000,000	366,229,500	
第５９回利付国債（３０年）	400,000,000	408,392,000	
第６０回利付国債（３０年）	400,000,000	427,764,000	
第６１回利付国債（３０年）	345,000,000	351,106,500	
第６２回利付国債（３０年）	105,000,000	101,396,400	
第６３回利付国債（３０年）	380,000,000	356,519,800	
第６４回利付国債（３０年）	245,000,000	229,199,950	
第６５回利付国債（３０年）	355,000,000	331,538,050	
第６６回利付国債（３０年）	260,000,000	242,691,800	

第６７回利付国債（３０年）	310,000,000	305,074,100	
第６８回利付国債（３０年）	400,000,000	393,596,000	
第６９回利付国債（３０年）	330,000,000	332,861,100	
第７０回利付国債（３０年）	20,000,000	20,149,400	
第５９回利付国債（２０年）	1,455,000,000	1,499,959,500	
第６１回利付国債（２０年）	1,215,000,000	1,241,584,200	
第６４回利付国債（２０年）	1,025,000,000	1,075,840,000	
第６５回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,075,926,600	
第６９回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,086,932,400	
第７０回利付国債（２０年）	780,000,000	843,078,600	
第７２回利付国債（２０年）	753,000,000	810,943,350	
第７４回利付国債（２０年）	664,000,000	718,687,040	
第７５回利付国債（２０年）	490,000,000	532,968,100	
第７８回利付国債（２０年）	590,000,000	639,973,000	
第８２回利付国債（２０年）	620,000,000	681,225,000	
第８４回利付国債（２０年）	850,000,000	934,014,000	
第８５回利付国債（２０年）	645,000,000	715,143,750	
第８８回利付国債（２０年）	742,000,000	834,349,320	
第８９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,385,000	
第９０回利付国債（２０年）	580,000,000	652,192,600	
第９２回利付国債（２０年）	734,000,000	825,140,780	
第９３回利付国債（２０年）	632,000,000	709,704,400	
第９５回利付国債（２０年）	305,000,000	349,673,350	
第９７回利付国債（２０年）	677,000,000	775,341,020	
第９９回利付国債（２０年）	693,000,000	792,667,260	
第１００回利付国債（２０年）	207,000,000	239,145,030	
第１０１回利付国債（２０年）	355,000,000	415,062,450	
第１０２回利付国債（２０年）	457,000,000	536,751,070	
第１０５回利付国債（２０年）	390,000,000	451,397,700	
第１０６回利付国債（２０年）	370,000,000	431,005,600	
第１０７回利付国債（２０年）	378,000,000	439,167,960	
第１０８回利付国債（２０年）	390,000,000	447,115,500	
第１０９回利付国債（２０年）	340,000,000	391,081,600	
第１１１回利付国債（２０年）	386,000,000	454,935,740	
第１１３回利付国債（２０年）	427,000,000	501,584,090	
第１１４回利付国債（２０年）	363,000,000	427,904,400	

第１１６回利付国債（２０年）	200,000,000	238,340,000	
第１１８回利付国債（２０年）	200,000,000	235,436,000	
第１１９回利付国債（２０年）	295,000,000	341,878,450	
第１２０回利付国債（２０年）	200,000,000	228,130,000	
第１２１回利付国債（２０年）	255,000,000	298,740,150	
第１２２回利付国債（２０年）	330,000,000	383,512,800	
第１２３回利付国債（２０年）	80,000,000	95,530,400	
第１２４回利付国債（２０年）	190,000,000	225,058,800	
第１２５回利付国債（２０年）	205,000,000	247,576,450	
第１２６回利付国債（２０年）	180,000,000	213,841,800	
第１２７回利付国債（２０年）	145,000,000	170,833,200	
第１２８回利付国債（２０年）	215,000,000	254,011,750	
第１２９回利付国債（２０年）	190,000,000	222,560,300	
第１３０回利付国債（２０年）	155,000,000	182,025,800	
第１３１回利付国債（２０年）	380,000,000	442,335,200	
第１３２回利付国債（２０年）	450,000,000	525,006,000	
第１３３回利付国債（２０年）	190,000,000	223,673,700	
第１３４回利付国債（２０年）	200,000,000	235,998,000	
第１３５回利付国債（２０年）	155,000,000	181,227,550	
第１３６回利付国債（２０年）	120,000,000	139,012,800	
第１３７回利付国債（２０年）	25,000,000	29,294,250	
第１３９回利付国債（２０年）	20,000,000	23,215,200	
第１４０回利付国債（２０年）	500,000,000	587,130,000	
第１４１回利付国債（２０年）	230,000,000	270,627,200	
第１４２回利付国債（２０年）	110,000,000	130,692,100	
第１４３回利付国債（２０年）	170,000,000	198,427,400	
第１４４回利付国債（２０年）	30,000,000	34,665,900	
第１４５回利付国債（２０年）	110,000,000	130,011,200	
第１４６回利付国債（２０年）	105,000,000	124,336,800	
第１４７回利付国債（２０年）	220,000,000	258,262,400	
第１４８回利付国債（２０年）	59,000,000	68,624,670	
第１４９回利付国債（２０年）	695,000,000	809,487,350	
第１５０回利付国債（２０年）	261,000,000	300,993,030	
第１５１回利付国債（２０年）	770,000,000	868,513,800	
第１５２回利付国債（２０年）	265,000,000	299,092,250	
第１５３回利付国債（２０年）	247,000,000	282,330,880	

	第１５４回利付国債（２０年）	580,000,000	655,394,200	
	第１５５回利付国債（２０年）	410,000,000	451,635,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	380,000,000	385,430,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	175,000,000	172,082,750	
	第１５８回利付国債（２０年）	360,000,000	369,802,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	418,000,000	435,154,720	
	第１６０回利付国債（２０年）	355,000,000	374,596,000	
	第１６１回利付国債（２０年）	320,000,000	332,505,600	
	第１６２回利付国債（２０年）	210,000,000	217,988,400	
	第１６３回利付国債（２０年）	670,000,000	694,756,500	
	第１６４回利付国債（２０年）	215,000,000	219,102,200	
	第１６５回利付国債（２０年）	590,000,000	600,448,900	
	第１６６回利付国債（２０年）	295,000,000	309,676,250	
	第１６７回利付国債（２０年）	500,000,000	507,420,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	150,000,000	149,499,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	400,000,000	390,900,000	
	第１７０回利付国債（２０年）	255,000,000	248,698,950	
	第１７１回利付国債（２０年）	495,000,000	481,783,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	500,000,000	495,205,000	
	第１７３回利付国債（２０年）	515,000,000	509,103,250	
	第１７４回利付国債（２０年）	610,000,000	602,393,300	
	第１７５回利付国債（２０年）	375,000,000	377,025,000	
国債証券合計		97,087,000,000	105,477,475,540	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	103,356,000	
	第１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	123,259,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,847,000	
	第８回東京都公募公債（３０年）	400,000,000	516,712,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	500,000,000	634,315,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	100,975,000	
	第７１０回東京都公募公債	100,000,000	100,949,000	
	平成２４年度第１回北海道公募公債	100,000,000	101,007,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	101,475,000	
	平成２６年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	101,626,000	
	平成２９年度第６回北海道公募公債（５年）	300,000,000	299,970,000	
	第１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	108,108,000	
	第３回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	108,818,000	

第７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	112,767,000	
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	202,176,000	
第３７３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,960,000	
第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,818,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	102,297,000	
平成２９年度第１２回京都府公募公債	300,000,000	300,201,000	
第５回兵庫県公募公債（１５年）	300,000,000	325,899,000	
第７回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	128,693,000	
平成２０年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	109,645,000	
平成２９年度第２回埼玉県公募公債（５年）	200,000,000	200,000,000	
平成２５年度第１１回福岡県公募公債	100,000,000	101,980,000	
平成２６年度第１０回福岡県公募公債	100,000,000	101,738,000	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,740,000	
第９回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	101,289,000	
第１１１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,108,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,600,500	
第１１３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,045,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,179,000	
第１１５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,442,000	
第１１８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,491,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,772,000	
第１７２回共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,840,000	
第１８３回共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,460,000	
第１回名古屋市公募公債（２０年）	200,000,000	210,670,000	
第３回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	108,480,000	
第５回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	112,280,000	
第１回京都市公募公債（３０年）	100,000,000	133,553,000	
第７回京都市公募公債（２０年）	100,000,000	116,926,000	
平成２９年度第５回京都市公募公債	100,000,000	100,068,000	
平成２６年度第１７回神戸市公募公債	100,000,000	101,044,000	
第４回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,963,000	
第９回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	111,977,000	
第１４回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	115,468,000	
第４７回横浜市公募公債（５年）	100,000,000	100,062,000	
平成２６年度第４回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,704,000	
平成２４年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,192,000	

	平成２３年度第９回福岡市公募公債	147,000,000	148,405,320	
	平成２９年度第１１回福岡市公募公債（５年）	300,000,000	300,201,000	
地方債証券合計		7,997,000,000	8,542,550,820	
特殊債券	第３回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	211,422,000	
	第３４回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,060,000	
	第３６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,928,000	
	第９回道路債券	100,000,000	128,620,000	
	第１８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,656,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	435,849,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,400,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	348,936,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,722,000	
	第８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	232,450,000	
	第８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,835,000	
	第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	350,187,000	
	第９９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,118,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	405,492,000	
	第１７６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,845,000	
	第１９６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,244,000	
	第２１０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,482,000	
	第２２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,734,000	
	第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,337,000	
	第２８８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	189,000,000	188,845,020	
	第２回地方公営企業等金融機構債券（２０年）	100,000,000	116,997,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	100,000,000	101,989,000	
	第５回公営企業債券（２０年）	100,000,000	105,107,000	
	第１７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	111,652,000	

第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券（６年）	800,000,000	800,144,000	
第２０回公営企業債券（２０年）	100,000,000	112,740,000	
第２２回公営企業債券（２０年）	100,000,000	113,602,000	
第２４回公営企業債券（２０年）	200,000,000	230,272,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,295,000	
第４５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,956,000	
第６１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,164,000	
第６２回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,088,000	
第６３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,909,000	
第６７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,691,000	
第１０１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,844,000	
第１０６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,172,000	
第３４２回東京交通債券	100,000,000	102,843,000	
第５１回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,933,000	
第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,149,000	10,216,693	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,218,000	12,559,737	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,540,000	10,624,425	
第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,698,000	14,247,974	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	23,224,000	23,768,602	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,865,000	14,534,402	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	36,072,000	37,100,052	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,614,000	14,139,364	
第１１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,686,000	15,456,868	
第１７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	22,912,000	23,168,156	
第１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,760,000	18,843,360	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,508,000	38,923,004	
第２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,479,000	58,780,555	
第２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,432,000	21,693,267	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,192,000	23,627,156	
第２９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,061,000	11,228,352	
第２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,952,000	26,732,574	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,310,000	26,045,247	
第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,408,000	12,702,938	

第３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,374,000	51,404,147	
第３５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,254,000	13,709,937	
第３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,108,000	26,700,600	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,604,000	26,043,580	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,975,000	12,245,635	
第４１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,920,000	13,384,086	
第４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,748,000	25,581,760	
第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,535,000	33,440,344	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,423,000	28,102,710	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,164,000	54,277,329	
第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,837,000	27,323,144	
第５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,905,000	12,260,840	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,922,000	61,220,657	
第５２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,412,000	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,727,000	13,179,826	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,596,000	81,986,381	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,582,000	38,619,617	
第５８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,900,000	42,126,420	
第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,886,000	81,275,421	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,490,000	125,840,893	
第６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,626,000	40,524,467	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,181,000	46,078,573	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,886,000	94,631,980	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,824,000	81,608,581	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,439,000	46,820,041	
第９５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,980,000	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,019,000	68,296,655	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,128,000	84,922,168	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,719,000	84,279,917	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,064,000	84,623,866	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,290,000	85,719,008	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,655,000	85,206,950	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,104,000	86,876,352	
第１３０回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,426,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,025,000	89,923,262	
第１６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,511,000	

	第２２６回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,829,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,528,000	24,128,434	
	第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,156,000	27,042,426	
	第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,562,000	12,943,382	
	第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,108,000	12,404,767	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	26,434,000	27,335,663	
	い第８１０号農林債	300,000,000	300,387,000	
	第１２回国際協力機構債券	100,000,000	101,058,000	
	第４５回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,280,000	
	第８５回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,201,000	
	第２０回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,788,000	
	第２３回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,804,000	
特殊債券合計		10,772,778,000	11,582,718,565	
社債券	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	200,000,000	200,516,000	
	第１３回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
	第３０回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,183,000	
	第５６回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,122,000	
	第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,268,000	
	第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,243,000	
	第１６回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,924,000	
	第２２回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,032,000	
	第６３回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,822,000	
	第８回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	114,244,000	
	株式会社三井住友フィナンシャル第１回無担保社債	100,000,000	101,437,000	
	第９回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
	第８回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	112,390,000	
	第１回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,466,000	
	第２４回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,193,000	
	第９回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,185,000	
	第１７回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,386,000	
	第９３回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	400,016,000	

	野村ホールディングス株式会社第１回無担保社債	100,000,000	100,019,000	
	第５８回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	125,392,000	
	第３８回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,456,000	
	第１１０回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,502,000	
	第４１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,138,000	
	第４２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,691,000	
	第４５回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,907,000	
	第２７回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,796,000	
	第４７２回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,572,000	
	第５０８回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,906,000	
	第３７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,682,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,322,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,267,000	
社債券合計		3,900,000,000	4,045,168,000	
合計			129,647,912,925	

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。

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13日現在）	（2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,613,138,714	1,980,401,795
金銭信託	196,407,416	1,160,138,477
コール・ローン	136,532,670	601,251,271
株式	187,233,126,027	283,975,881,503
投資証券	5,087,009,262	6,632,679,127
派生商品評価勘定	145,973,096	67,211,947
未収入金	1,819,725	383,008
未収配当金	245,293,678	312,896,444
差入委託証拠金	1,816,503,539	1,307,692,251
流動資産合計	196,475,804,127	296,038,535,823
資産合計	196,475,804,127	296,038,535,823

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	236,418	3,068,399
前受金	136,840,750	65,838,580
未払解約金	2,100,611,158	390,760,813
未払利息	370	1,647
その他未払費用	99,189	3,865
流動負債合計	2,237,787,885	459,673,304
負債合計	2,237,787,885	459,673,304
純資産の部		
元本等		
元本	58,474,870,859	58,211,745,190
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	135,763,145,383	237,367,117,329
元本等合計	194,238,016,242	295,578,862,519
純資産合計	194,238,016,242	295,578,862,519
負債純資産合計	196,475,804,127	296,038,535,823

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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	外貨建資産等の会計処理

なる重要な事項	「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13日現在）	（2021年 4月13日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	58,474,870,859口	58,211,745,190口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　3.3217円 (10,000口当たりの純資産額　33,217円)	1口当たり純資産額　5.0776円 (10,000口当たりの純資産額　50,776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14日 至 2021年 4月13日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 4月13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13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,756,190,656	-	1,893,031,406	136,840,750
	SPMINI 2006	1,274,191,790	-	1,383,945,668	109,753,878
	DJ EUR 2006	287,308,580	-	303,894,765	16,586,185
	FTSE 2006	90,052,466	-	94,128,144	4,075,678
	SPI200 2006	104,637,820	-	111,062,829	6,425,009
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	90,036,600	-	90,016,300	△20,300
	米ドル	70,356,000	-	70,343,000	△13,000
	ユーロ	9,464,000	-	9,460,800	△3,200
	英ポンド	8,089,800	-	8,087,400	△2,400
	スウェーデンクローナ	870,400	-	869,600	△800
	香港ドル	1,256,400	-	1,255,500	△900
	売建	1,914,997,788	-	1,906,081,560	8,916,228
	米ドル	1,445,100,800	-	1,437,161,600	7,939,200
	カナダドル	55,925,870	-	55,828,800	97,070
	ユーロ	151,146,450	-	150,781,500	364,950
	英ポンド	73,605,672	-	73,325,760	279,912
	スイスフラン	76,343,680	-	76,173,600	170,080
	スウェーデンクローナ	17,072,235	-	17,065,900	6,335
	ノルウェークローネ	4,041,424	-	4,009,000	32,424
	デンマーククローネ	16,677,080	-	16,632,000	45,080
	オーストラリアドル	38,902,562	-	39,079,200	△176,638
	ニュージーランドドル	1,969,200	-	1,972,200	△3,000
	香港ドル	23,156,415	-	23,017,500	138,915
	シンガポールドル	6,508,200	-	6,494,000	14,200
	イスラエルシュケル	4,548,200	-	4,540,500	7,700
合計		3,761,225,044	-	3,889,129,266	145,736,678

（2021年 4月13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	6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580
	SPMINI 2106	4,592,481,363	-	4,650,475,482	57,994,119
	DJ EUR 2106	980,286,606	-	985,446,999	5,160,393
	FTSE 2106	287,848,728	-	288,833,521	984,793
	SPI200 2106	186,653,370	-	188,352,645	1,699,275
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,412,729,730	-	2,411,034,698	△1,695,032
	米ドル	1,819,250,400	-	1,817,899,629	△1,350,771
	カナダドル	52,331,760	-	52,277,628	△54,132
	ユーロ	294,957,980	-	294,752,440	△205,540
	英ポンド	67,749,720	-	67,760,180	10,460
	スイスフラン	55,755,930	-	55,771,231	15,301
	スウェーデンクローナ	14,174,700	-	14,174,700	-
	ノルウェークローネ	3,742,570	-	3,741,000	△1,570
	デンマーククローネ	11,576,750	-	11,576,400	△350
	オーストラリアドル	50,940,280	-	50,873,685	△66,595
	ニュージーランドドル	768,530	-	768,580	50
	香港ドル	29,055,840	-	29,045,010	△10,830
	シンガポールドル	4,086,300	-	4,086,865	565
	イスラエルシュケル	8,338,970	-	8,307,350	△31,620
合計		8,459,999,797	-	8,524,143,345	64,143,548

（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14日 至 2021年 4月13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13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,227,388,044円
同期中における追加設定元本額	27,385,256,620円
同期中における一部解約元本額	20,137,773,805円
2020年 4月13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	25,231,318,479円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	378,421,998円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,463,649,022円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	930,435,402円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	91,109,362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）	2,603,248円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	9,144,941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）	28,111,210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）	58,883,705円

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	44,465,029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）	98,964,448円
外国株式指数ファンド	547,230,104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	5,541,347,659円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	258,142,746円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	257,721,554円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	188,944,854円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	9,114,050円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	64,371,954円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	53,821,410円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	154,555,549円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	74,647,971円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	91,931,978円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	24,370,050円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	2,667,451円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	54,190円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	329,790円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	229,988円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,790,260円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	1,336,856,076円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	8,390,349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＞	1,603,381,875円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,550,405,958円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,427,072,311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＞	105,025,426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＞	743,175,435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＞	186,221,797円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	790,847,473円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	666,936,328円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,587,087,513円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	897,600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）	285,453,719円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	135,588,581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＞	7,055,036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＞	688,091,914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＞	5,755,492,578円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	256,998,128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	58,474,870,859円

（2021年 4月13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	58,474,870,859円
同期中における追加設定元本額	16,974,480,468円
同期中における一部解約元本額	17,237,606,137円
2021年 4月13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	28,675,405,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	283,051,086円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,207,524,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	838,459,709円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	70,282,809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）	6,549,259円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	20,430,761円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	51,182,329円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	48,571,646円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	96,727,490円
外国株式指数ファンド	587,742,940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	9,008,165,638円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	264,170,743円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	278,944,246円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	174,748,649円
イオン・バランス戦略ファンド	62,925,621円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	13,540,485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）	79,483,815円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	251,680,503円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	124,835,202円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	142,461,893円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	31,309,522円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	182,400,691円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	3,651,079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）	11,796,950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）	28,095,372円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	784,383,935円

バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,116,828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＞	931,142,266円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,030,755,411円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	4,447,927,100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＞	602,644,828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＞	48,753,013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＞	587,698,333円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	443,142,590円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,029,197,056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）	252,196,472円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	91,962,063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＞	9,927,876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＞	29,806,757円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	77,183,276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＞	196,801,861円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	82,054,599円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	2,543,269,267円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	160,265,042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＞	1,441,122,783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＞	410,194,343円
合計	58,211,745,190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	20.09	642,357.66	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	16.96	332,958.72	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	72.20	848,133.40	

CHEVRON CORPORATION	98,304	101.78	10,005,381.12	
CONOCOPHILLIPS	70,648	50.86	3,593,157.28	
DEVON ENERGY CORPORATION	31,182	21.88	682,262.16	
EOG RESOURCES INC	30,830	70.10	2,161,183.00	
EXXON MOBIL CORPORATION	216,177	55.50	11,997,823.50	
HALLIBURTON CO	44,317	21.02	931,543.34	
HESS CORPORATION	14,344	72.95	1,046,394.80	
KINDER MORGAN INC	105,940	16.50	1,748,010.00	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,933	52.21	1,771,641.93	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	24.23	1,177,093.40	
ONEOK INC	21,278	50.91	1,083,262.98	
PHILLIPS 66	22,492	77.62	1,745,829.04	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,578	145.02	1,534,021.56	
SCHLUMBERGER LTD	73,444	26.54	1,949,203.76	
VALERO ENERGY CORP	22,007	70.30	1,547,092.10	
WILLIAMS COS INC	64,802	23.45	1,519,606.90	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,102	282.88	3,140,533.76	
ALBEMARLE CORPORATION	5,548	147.71	819,495.08	
AMCOR PLC	82,302	11.72	964,579.44	
AVERY DENNISON CORP	4,232	196.54	831,757.28	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	30.12	379,210.80	
BALL CORPORATION	17,166	90.70	1,556,956.20	
CELANESE CORPORATION	6,420	154.54	992,146.80	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	45.47	545,730.94	
CORTEVA INC	39,348	47.10	1,853,290.80	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	105.54	724,321.02	
DOW INC	38,654	63.79	2,465,738.66	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	76.20	2,129,332.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	113.92	800,515.84	
ECOLAB INC	13,341	219.74	2,931,551.34	
FMC CORPORATION	6,676	112.40	750,382.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	75,431	33.67	2,539,761.77	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	55.94	1,070,691.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,734	140.49	1,648,509.66	
LINDE PLC	26,732	285.43	7,630,114.76	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	105.37	1,467,909.47	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	348.65	1,078,025.80	
MOSAIC CO/THE	18,584	31.77	590,413.68	
NEWMONT CORPORATION	41,882	60.61	2,538,468.02	
NUCOR CORP	15,455	80.53	1,244,591.15	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	139.10	651,266.20	
PPG INDUSTRIES INC	12,256	151.39	1,855,435.84	
RPM INTERNATIONAL INC	5,917	92.11	545,014.87	
SEALED AIR CORP	7,895	47.29	373,354.55	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,573	257.60	3,238,804.80	
STEEL DYNAMICS,INC.	10,191	51.83	528,199.53	
VULCAN MATERIALS CO	6,698	174.35	1,167,796.30	
WESTROCK CO	13,034	54.29	707,615.86	
3M COMPANY	29,504	197.83	5,836,776.32	
ALLEGION PLC	4,764	131.61	626,990.04	
AMETEK INC	11,312	132.99	1,504,382.88	
BOEING CO	27,549	249.52	6,874,026.48	
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	42.60	1,842,577.80	
CATERPILLAR INC	27,618	230.93	6,377,824.74	
CUMMINS INC	7,315	261.23	1,910,897.45	
DEERE & CO	15,109	378.26	5,715,130.34	
DOVER CORP	6,972	140.49	979,496.28	
EATON CORP PLC	19,959	141.29	2,820,007.11	
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	92.01	2,868,687.78	
FASTENAL COMPANY	29,892	50.71	1,515,823.32	
FORTIVE CORP	15,750	73.56	1,158,570.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,166	101.02	723,909.32	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	328.34	1,083,522.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	184.94	2,338,011.48	
GENERAL ELECTRIC CO	454,142	13.59	6,171,789.78	
HEICO CORP	1,888	132.03	249,272.64	
HEICO CORP-CLASS A	3,183	119.26	379,604.58	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,419	228.60	8,325,383.40	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	32.32	614,855.68	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	210.27	443,038.89	

IDEX CORP	3,839	218.24	837,823.36	
ILLINOIS TOOL WORKS	15,933	223.60	3,562,618.80	
INGERSOLL-RAND INC	16,781	50.15	841,567.15	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	64.37	740,255.00	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,600	32.90	348,740.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	38,644	62.03	2,397,087.32	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,215	209.59	2,350,551.85	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,527	331.07	505,543.89	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	12,847	387.85	4,982,708.95	
MASCO CORP	14,885	63.19	940,583.15	
NORDSON CORP	3,207	203.58	652,881.06	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	340.69	2,826,023.55	
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	70.65	1,491,492.15	
OWENS CORNING	5,205	97.48	507,383.40	
PACCAR INC	18,041	95.29	1,719,126.89	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	6,691	321.18	2,149,015.38	
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	63.35	520,737.00	
PLUG POWER INC	22,755	29.68	675,368.40	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,825	78.72	6,205,104.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	265.09	1,648,594.71	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,207	425.65	2,216,359.55	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	58.65	445,740.00	
SMITH(A.O.) CORP	7,157	68.41	489,610.37	
SNAP-ON INC	2,285	236.32	539,991.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,007	204.14	1,634,548.98	
SUNRUN INC	6,112	50.81	310,550.72	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	427.46	880,567.60	
TEXTRON INC	11,803	58.43	689,649.29	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	170.61	2,176,812.99	
TRANSDIGM GROUP INC	2,681	623.64	1,671,978.84	
UNITED RENTALS INC	3,596	327.87	1,179,020.52	
WABTEC CORP	9,231	80.81	745,957.11	
WW GRAINGER INC	2,390	405.97	970,268.30	
XYLEM INC	9,124	108.41	989,132.84	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	83.03	666,647.87	

CINTAS CORP	4,615	355.17	1,639,109.55	
COPART INC	10,977	118.31	1,298,688.87	
COSTAR GROUP INC	2,054	887.49	1,822,904.46	
EQUIFAX INC	6,127	187.22	1,147,096.94	
IHS MARKIT LTD	19,584	102.32	2,003,834.88	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	134.43	931,196.61	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	100.56	698,590.32	
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	103.29	1,179,055.35	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	81.85	454,676.75	
ROLLINS INC	11,493	35.62	409,380.66	
TRANSUNION	9,497	96.87	919,974.39	
VERISK ANALYTICS INC	7,929	182.50	1,447,042.50	
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	114.54	1,552,704.24	
WASTE MANAGEMENT INC	22,023	134.47	2,961,432.81	
AMERCO	390	605.00	235,950.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	6,925	99.04	685,852.00	
CSX CORPORATION	40,214	98.61	3,965,502.54	
DELTA AIR LINES INC	8,299	48.82	405,157.18	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	109.52	951,619.28	
FEDEX CORP	13,083	290.79	3,804,405.57	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	171.50	756,486.50	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	263.74	1,345,074.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	7,940	50.03	397,238.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,783	271.55	3,471,223.65	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	249.02	1,226,672.52	
SOUTHWEST AIRLINES	7,076	62.66	443,382.16	
UBER TECHNOLOGIES INC	49,619	59.44	2,949,353.36	
UNION PACIFIC CORP	34,975	223.55	7,818,661.25	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,671	178.58	6,548,707.18	
XPO LOGISTICS INC	4,716	134.75	635,481.00	
APTIV PLC	14,147	143.15	2,025,143.05	
AUTOLIV INC	4,001	93.18	372,813.18	
BORGWARNER INC	12,075	47.58	574,528.50	
FORD MOTOR COMPANY	194,883	12.38	2,412,651.54	
GENERAL MOTORS CO	65,911	59.66	3,932,250.26	

LEAR CORP	2,749	180.25	495,507.25	
TESLA INC	38,906	701.98	27,311,233.88	
D.R.HORTON INC	18,162	93.75	1,702,687.50	
GARMIN LTD	6,854	137.85	944,823.90	
HASBRO INC	7,491	97.11	727,451.01	
LENNAR CORP-CL A	14,494	104.86	1,519,840.84	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	323.87	2,099,001.47	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	204.11	584,366.93	
NEWELL BRANDS INC	17,587	27.38	481,532.06	
NIKE INC -CL B	63,986	136.64	8,743,047.04	
NVR INC	173	4,873.73	843,155.29	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,599	118.97	1,498,903.03	
PULTE GROUP INC	13,075	54.10	707,357.50	
VF CORP	17,117	85.40	1,461,791.80	
WHIRLPOOL CORP	3,212	237.52	762,914.24	
AIRBNB INC-CLASS A	2,549	176.49	449,873.01	
ARAMARK	13,242	39.46	522,529.32	
CARNIVAL CORP	40,398	27.75	1,121,044.50	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,381	1,539.50	2,126,049.50	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,111	143.69	878,089.59	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	390.62	828,505.02	
DRAFTKINGS INC - CL A	8,947	58.03	519,194.41	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	125.28	1,831,217.76	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	61.61	1,086,430.74	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	149.35	2,197,685.25	
MCDONALD'S CORPORATION	38,673	230.96	8,931,916.08	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,044	19.95	220,327.80	
MGM MIRAGE	25,878	41.16	1,065,138.48	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	87.06	1,035,143.40	
STARBUCKS CORP	61,056	113.81	6,948,783.36	
VAIL RESORTS INC	2,038	304.59	620,754.42	
WYNN RESORTS LTD	4,913	129.94	638,395.22	
YUM! BRANDS INC	15,549	116.42	1,810,214.58	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	96.14	3,854,444.88	
ALPHABET INC-CL A	15,456	2,244.62	34,692,846.72	

ALPHABET INC-CL C	15,276	2,254.79	34,444,172.04	
ALTICE USA INC-A	14,243	32.61	464,464.23	
CABLE ONE INC	246	1,779.01	437,636.46	
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,262	619.30	4,497,356.60	
COMCAST CORP-CLASS A	236,457	53.32	12,607,887.24	
DISCOVERY INC-A	7,075	40.38	285,688.50	
DISCOVERY INC-C	17,417	35.01	609,769.17	
DISH NETWORK CORP.	12,937	37.95	490,959.15	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	141.45	2,171,540.40	
FACEBOOK INC-A	123,699	311.54	38,537,186.46	
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	37.42	634,718.04	
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	36.10	316,705.30	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	244.01	969,695.74	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	29.99	588,583.74	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	145.64	191,079.68	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	149.45	1,224,892.20	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	44.28	455,552.64	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	46.48	355,479.04	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	46.67	193,260.47	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	84.88	637,618.56	
MATCH GROUP INC	12,773	144.53	1,846,081.69	
NETFLIX INC	22,733	552.78	12,566,347.74	
NEWS CORP-CLASS A	16,662	26.76	445,875.12	
OMNICOM GROUP	10,417	79.28	825,859.76	
PINTEREST INC- CLASS A	26,515	83.98	2,226,729.70	
ROKU INC	5,620	371.12	2,085,694.40	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.23	421,496.88	
SNAP INC-A	47,744	62.44	2,981,135.36	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	182.76	1,043,011.32	
THE WALT DISNEY CO.	93,161	186.49	17,373,594.89	
TWITTER INC	40,795	70.86	2,890,733.70	
VIACOMCBS INC	29,772	39.77	1,184,032.44	
ZILLOW GROUP INC-A	3,154	144.68	456,320.72	
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	142.01	1,122,731.06	
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	188.06	644,293.56	

AMAZON.COM INC	21,921	3,379.39	74,079,608.19	
AUTOZONE INC	1,137	1,454.19	1,653,414.03	
BEST BUY COMPANY INC	12,132	121.56	1,474,765.92	
BOOKING HOLDINGS INC	2,139	2,409.05	5,152,957.95	
BURLINGTON STORES INC	3,391	325.42	1,103,499.22	
CARMAX INC	8,427	132.10	1,113,206.70	
CARVANA CO	3,285	269.28	884,584.80	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	84.04	333,554.76	
DOLLAR GENERAL CORP	13,090	209.04	2,736,333.60	
DOLLAR TREE INC	12,047	117.04	1,409,980.88	
EBAY INC	36,668	62.64	2,296,883.52	
ETSY INC	6,272	218.13	1,368,111.36	
EXPEDIA GROUP INC	6,894	171.71	1,183,768.74	
GENUINE PARTS CO	7,406	117.75	872,056.50	
HOME DEPOT INC	55,148	320.79	17,690,926.92	
LKQ CORPORATION	15,922	44.19	703,593.18	
LOWE'S COMPANIES INC	38,030	200.65	7,630,719.50	
MERCADOLIBRE INC	2,337	1,593.65	3,724,360.05	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,833	519.57	1,991,511.81	
POOL CORP	2,107	371.18	782,076.26	
ROSS STORES INC	18,792	128.00	2,405,376.00	
TARGET CORP	26,147	205.10	5,362,749.70	
TJX COMPANIES INC	60,539	69.52	4,208,671.28	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	178.14	1,089,682.38	
ULTA BEAUTY INC	2,765	327.79	906,339.35	
WAYFAIR INC-CLASS A	3,266	319.97	1,045,022.02	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,674	364.81	8,271,701.94	
KROGER CO	40,843	37.97	1,550,808.71	
SYSCO CORP	25,165	81.57	2,052,709.05	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,873	54.70	2,071,653.10	
WALMART INC	72,907	139.80	10,192,398.60	
ALTRIA GROUP INC	94,742	51.75	4,902,898.50	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27,559	58.59	1,614,681.81	
BROWN-FORMAN CORPORATION	16,130	72.41	1,167,973.30	
BUNGE LIMITED	7,174	79.26	568,611.24	

CAMPBELL SOUP CO	10,638	48.83	519,453.54	
COCA-COLA CO/THE	208,965	53.35	11,148,282.75	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,193	54.61	502,029.73	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	37.53	924,701.67	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	226.31	2,009,859.11	
GENERAL MILLS INC	31,489	60.97	1,919,884.33	
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	47.03	702,581.17	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	129.53	747,129.04	
KELLOGG CO	12,949	63.41	821,096.09	
KEURIG DR PEPPER INC	29,587	35.49	1,050,042.63	
KRAFT HEINZ COMPANY	32,774	40.70	1,333,901.80	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	78.69	583,643.73	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	88.23	1,154,401.32	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	50.62	487,419.98	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,601	58.61	4,372,364.61	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	21,116	95.42	2,014,888.72	
PEPSICO INC	71,110	143.02	10,170,152.20	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	79,247	91.39	7,242,383.33	
THE HERSHEY COMPANY	7,514	159.60	1,199,234.40	
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	77.56	1,159,444.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	87.41	1,091,313.85	
CLOROX COMPANY	6,542	190.77	1,248,017.34	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	42,815	80.16	3,432,050.40	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,508	303.22	3,489,455.76	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	137.23	2,442,694.00	
PROCTER & GAMBLE CO	127,591	136.92	17,469,759.72	
ABBOTT LABORATORIES	90,543	121.04	10,959,324.72	
ABIOMED INC	2,288	333.11	762,155.68	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	601.11	2,316,677.94	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	117.54	939,497.22	
ANTHEM INC	12,576	359.42	4,520,065.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	84.54	2,234,730.36	
BECTON DICKINSON & CO	15,140	247.41	3,745,787.40	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	39.34	2,933,033.04	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	60.86	919,838.04	

CENTENE CORP	30,528	62.43	1,905,863.04	
CERNER CORP	15,537	73.57	1,143,057.09	
CIGNA CORPORATION	18,589	245.82	4,569,547.98	
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,771	388.02	1,075,203.42	
CVS HEALTH CORPORATION	66,840	74.46	4,976,906.40	
DANAHER CORP	32,969	234.84	7,742,439.96	
DAVITA INC	4,138	109.88	454,683.44	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	64.15	761,075.60	
DEXCOM INC	4,765	387.15	1,844,769.75	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,336	85.82	2,775,075.52	
HCA HEALTHCARE INC	14,352	191.66	2,750,704.32	
HENRY SCHEIN INC	7,559	70.00	529,130.00	
HOLOGIC INC	13,592	74.42	1,011,516.64	
HUMANA INC.	6,899	413.21	2,850,735.79	
IDEXX LABORATORIES INC	4,260	506.43	2,157,391.80	
INSULET CORP	3,400	284.72	968,048.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,946	779.26	4,633,479.96	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	255.66	1,277,021.70	
MASIMO CORPORATION	2,941	234.71	690,282.11	
MCKESSON CORP	8,411	191.71	1,612,472.81	
MEDTRONIC PLC	69,837	121.79	8,505,448.23	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,698	240.85	649,813.30	
NOVOCURE LTD	4,517	131.88	595,701.96	
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	128.86	878,052.04	
RESMED INC	7,181	201.74	1,448,694.94	
STERIS PLC	4,287	200.62	860,057.94	
STRYKER CORP	17,769	251.83	4,474,767.27	
TELADOC HEALTH INC	6,122	182.01	1,114,265.22	
TELEFLEX INC	2,340	426.29	997,518.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	48,823	376.28	18,371,118.44	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	139.26	585,309.78	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,718	177.12	835,652.16	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,005	263.04	1,842,595.20	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	296.94	1,122,136.26	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	168.33	1,827,390.48	

10X GENOMICS INC-CLASS A	3,227	188.31	607,676.37	
ABBVIE INC	90,104	108.25	9,753,758.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,406	131.27	2,022,345.62	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,519	154.01	1,774,041.19	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	135.03	757,923.39	
AMGEN INC	30,216	248.94	7,521,971.04	
AVANTOR INC	25,606	32.97	844,229.82	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	603.99	736,867.80	
BIOGEN INC	7,987	262.80	2,098,983.60	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	77.11	700,158.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,054	62.69	7,275,425.26	
CATALENT INC	8,935	109.38	977,310.30	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	29.40	611,843.40	
ELI LILLY & CO	44,684	181.82	8,124,444.88	
EXACT SCIENCES CORP	8,428	124.94	1,052,994.32	
GILEAD SCIENCES INC	65,673	64.66	4,246,416.18	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	89.79	1,039,947.78	
ILLUMINA INC	7,655	398.99	3,054,268.45	
INCYTE CORP	9,243	79.87	738,238.41	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	40.87	276,281.20	
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	208.21	2,065,651.41	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	162.28	422,577.12	
JOHNSON & JOHNSON	134,979	161.64	21,818,005.56	
MERCK & CO. INC.	129,538	76.22	9,873,386.36	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	1,218.84	1,533,300.72	
MODERNA INC	14,409	139.40	2,008,614.60	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	92.79	388,418.94	
PERKINELMER INC	5,624	132.62	745,854.88	
PFIZER INC	283,848	36.97	10,493,860.56	
PPD INC	6,413	38.41	246,323.33	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	472.80	2,598,036.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,431	41.23	306,380.13	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	69.38	265,586.64	
SEAGEN INC	6,654	140.72	936,350.88	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	58,227	10.94	637,003.38	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,225	475.98	9,626,695.50	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	213.60	2,890,008.00	
VIATRIS INC	63,072	13.26	836,334.72	
WATERS CORP	2,901	307.04	890,723.04	
ZOETIS INC	24,975	162.51	4,058,687.25	
BANK OF AMERICA CORP	398,648	40.06	15,969,838.88	
CITIGROUP INC	108,059	72.69	7,854,808.71	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	45.92	955,090.08	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	38.85	1,443,277.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	173.12	1,540,248.64	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	16.48	874,461.76	
JPMORGAN CHASE & CO	156,788	155.95	24,451,088.60	
KEYCORP	51,128	20.84	1,065,507.52	
M & T BANK CORP	6,094	156.22	952,004.68	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	21,991	180.81	3,976,192.71	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,041	21.42	1,007,618.22	
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	500.65	1,321,716.00	
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	70,316	60.19	4,232,320.04	
US BANCORP	70,743	57.68	4,080,456.24	
WELLS FARGO & COMPANY	200,117	40.77	8,158,770.09	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	48.05	967,678.95	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,523	147.57	5,242,129.11	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,412	245.67	1,575,236.04	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	7,745	47.56	368,352.20	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	49.09	2,071,941.63	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	70,244	267.93	18,820,474.92	
BLACKROCK INC	7,916	807.98	6,395,969.68	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	134.24	3,175,312.96	
CARLYLE GROUP INC/THE	9,341	38.00	354,958.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	101.42	574,138.62	
CME GROUP INC.	18,712	204.70	3,830,346.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	100.45	1,649,891.25	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	33.57	766,067.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	311.26	603,533.14	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	31.26	446,955.48	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,965	331.84	5,629,665.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,608	117.71	3,367,447.68	
INVESCO LIMITED	18,328	26.71	489,540.88	
KKR & CO INC	25,154	52.01	1,308,259.54	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	535.45	1,023,780.40	
MOODY'S CORP	8,519	314.48	2,679,055.12	
MORGAN STANLEY	71,864	80.18	5,762,055.52	
MSCI INC-A	4,383	453.14	1,986,112.62	
NASDAQ INC	5,392	156.09	841,637.28	
NORTHERN TRUST CORP	9,502	109.96	1,044,839.92	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	128.20	823,813.20	
S&P GLOBAL INC	12,166	371.11	4,514,924.26	
SCHWAB (CHARLES) CORP	77,565	67.71	5,251,926.15	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	63.56	348,372.36	
STATE STREET CORP	18,694	86.93	1,625,069.42	
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	43.15	1,200,648.75	
T ROWE PRICE GROUP INC	11,312	182.49	2,064,326.88	
THE BLACKSTONE GROUP INC	34,684	77.37	2,683,501.08	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	79.02	412,484.40	
VOYA FINANCIAL INC	7,308	66.88	488,759.04	
AFLAC INC	35,411	52.44	1,856,952.84	
ALLEGHANY CORPORATION	689	663.27	456,993.03	
ALLSTATE CORP	14,978	119.36	1,787,774.08	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	119.39	422,521.21	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	47.16	2,110,174.20	
AON PLC	12,005	238.83	2,867,154.15	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	40.00	819,040.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,895	132.35	1,309,603.25	
ASSURANT INC	3,114	147.91	460,591.74	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,865	50.80	247,142.00	
BROWN & BROWN INC	14,036	47.86	671,762.96	
CHUBB LTD	23,255	160.94	3,742,659.70	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	106.47	836,641.26	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	222.42	286,476.96	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	254.98	526,533.70	

FNF GROUP	13,937	44.15	615,318.55	
GLOBE LIFE INC	6,040	100.80	608,832.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	66.52	1,219,378.12	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	63.64	552,204.28	
LOEWS CORPORATION	13,914	54.18	753,860.52	
MARKEL CORP	702	1,183.77	831,006.54	
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	126.21	3,360,341.25	
METLIFE INC	39,703	62.66	2,487,789.98	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	62.88	888,117.12	
PROGRESSIVE CORP	30,543	96.43	2,945,261.49	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	95.56	1,980,767.68	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	130.45	394,219.90	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	170.48	520,304.96	
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	151.84	1,993,051.84	
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	79.55	590,897.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	243.96	1,664,539.08	
CBRE GROUP INC-A	18,244	80.98	1,477,399.12	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.98	260,454.00	
ACCENTURE PLC-CL A	32,321	287.54	9,293,580.34	
ADOBE INC	24,573	506.03	12,434,675.19	
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	104.23	867,297.83	
ANSYS INC	4,470	366.94	1,640,221.80	
AUTODESK INC	11,506	294.50	3,388,517.00	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,463	189.76	4,262,578.88	
AVALARA INC	4,319	143.39	619,301.41	
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	74.26	566,083.98	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	155.93	918,271.77	
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	144.79	2,063,257.50	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	90.83	633,902.57	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,376	116.41	625,820.16	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	142.06	921,969.40	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,320	69.73	719,613.60	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	26,533	80.23	2,128,742.59	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	268.46	936,925.40	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,093	203.99	1,854,881.07	

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	138.91	285,460.05	
DATADOG INC - CLASS A	8,402	90.46	760,044.92	
DOCUSIGN INC	9,078	213.48	1,937,971.44	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	26.05	432,013.20	
DYNATRACE INC	11,194	53.01	593,393.94	
EPAM SYSTEMS INC	2,689	424.67	1,141,937.63	
FAIR ISAAC CORP	1,494	525.11	784,514.34	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,016	150.07	4,804,641.12	
FISERV INC	29,729	124.13	3,690,260.77	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	286.96	1,254,302.16	
FORTINET INC	7,360	197.09	1,450,582.40	
GARTNER INC	4,568	188.45	860,839.60	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,685	214.46	3,363,805.10	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	85.90	764,939.50	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	104.88	496,187.28	
HUBSPOT INC	2,275	520.96	1,185,184.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,622	134.59	6,140,264.98	
INTUIT INC	13,620	415.93	5,664,966.60	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	155.76	609,800.40	
MASTERCARD INC-CL A	45,776	379.84	17,387,555.84	
MICROSOFT CORP	369,581	255.91	94,579,473.71	
MONGODB INC	2,659	304.21	808,894.39	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	22.20	695,903.40	
OKTA INC	6,306	248.96	1,569,941.76	
ORACLE CORPORATION	101,577	76.12	7,732,041.24	
PALO ALTO NETWORKS INC	4,942	355.36	1,756,189.12	
PAYCHEX INC	15,878	95.85	1,521,906.30	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	381.01	960,907.22	
PAYPAL HOLDINGS INC	56,963	269.03	15,324,755.89	
PTC INC	5,462	146.65	801,002.30	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	318.05	1,269,655.60	
SALESFORCE.COM,INC.	47,267	228.76	10,812,798.92	
SERVICENOW INC	10,018	537.00	5,379,666.00	
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	23,822	41.94	999,094.68	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,505	233.39	351,251.95	

SPLUNK INC	8,252	144.71	1,194,146.92	
SQUARE INC-A	19,920	265.20	5,282,784.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	73.36	847,014.56	
SYNOPSYS INC	7,869	258.05	2,030,595.45	
TRADE DESK INC/THE- CLASS A	2,140	705.86	1,510,540.40	
TWILIO INC-A	7,283	371.06	2,702,429.98	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	437.11	881,213.76	
VERISIGN INC	5,227	203.72	1,064,844.44	
VISA INC	86,724	221.47	19,206,764.28	
VMWARE INC	4,194	154.72	648,895.68	
WESTERN UNION COMPANY	21,840	25.10	548,184.00	
WIX.COM LTD	2,840	288.20	818,488.00	
WORKDAY INC-CLASS A	9,080	259.51	2,356,350.80	
ZENDESK INC	6,067	146.36	887,966.12	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10,108	321.51	3,249,823.08	
ZSCALER INC	3,503	188.38	659,895.14	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	31,396	67.72	2,126,137.12	
APPLE INC	874,220	131.24	114,732,632.80	
ARISTA NETWORKS INC	2,699	314.01	847,512.99	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	116.35	480,525.50	
CDW CORP/DE	7,404	174.25	1,290,147.00	
CISCO SYSTEMS INC	215,929	51.57	11,135,458.53	
COGNEX CORP	8,698	84.32	733,415.36	
CORNING INC	39,709	45.05	1,788,890.45	
DELL TECHNOLOGIES INC-C	12,602	93.45	1,177,656.90	
F5 NETWORKS INC	2,909	207.20	602,744.80	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	63,881	15.82	1,010,597.42	
HP INC	73,161	32.74	2,395,291.14	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	225.49	400,470.24	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	25.51	445,404.60	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	145.03	1,383,876.26	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,312	187.79	1,560,910.48	
NETAPP INC	10,919	74.20	810,189.80	
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	79.91	1,009,582.94	
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	131.86	2,297,660.50	

TRIMBLE INC	12,759	81.30	1,037,306.70	
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	71.43	1,061,235.51	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	505.50	1,383,553.50	
AT&T INC	364,117	29.96	10,908,945.32	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	25.81	217,629.92	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	25.71	541,941.09	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	12.87	640,385.46	
T-MOBILE US INC	29,019	130.76	3,794,524.44	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	211,595	57.54	12,175,176.30	
AES CORPORATION	33,656	27.68	931,598.08	
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	54.21	655,995.21	
AMEREN CORPORATION	12,454	80.72	1,005,286.88	
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	86.00	2,212,522.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	152.25	1,393,696.50	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	99.36	692,042.40	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	23.34	594,329.76	
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	60.76	853,070.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,187	75.32	1,219,204.84	
DOMINION ENERGY INC	41,951	76.26	3,199,183.26	
DTE ENERGY COMPANY	10,496	135.63	1,423,572.48	
DUKE ENERGY CORP	37,896	97.64	3,700,165.44	
EDISON INTERNATIONAL	18,856	59.84	1,128,343.04	
ENTERGY CORP	10,866	101.97	1,108,006.02	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,567	45.83	484,285.61	
EVERGY INC	11,273	60.93	686,863.89	
EVERSOURCE ENERGY	17,557	86.41	1,517,100.37	
EXELON CORP	50,837	44.74	2,274,447.38	
FIRSTENERGY CORP	26,948	34.69	934,826.12	
NEXTERA ENERGY INC	100,635	77.64	7,813,301.40	
NISOURCE INC	18,919	24.75	468,245.25	
NRG ENERGY INC	13,547	38.57	522,507.79	
OGE ENERGY CORP	11,870	32.39	384,469.30	
P G & E CORPORATION	76,538	11.58	886,310.04	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	82.55	494,969.80	
PPL CORPORATION	39,561	28.73	1,136,587.53	

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,969	61.29	1,530,350.01	
	SEMPRA ENERGY	15,304	133.29	2,039,870.16	
	SOUTHERN CO	55,514	62.89	3,491,275.46	
	UGI CORPORATION	10,588	42.67	451,789.96	
	VISTRA CORP	25,777	17.16	442,333.32	
	WEC ENERGY GROUP INC	16,438	92.95	1,527,912.10	
	XCEL ENERGY INC	26,959	67.91	1,830,785.69	
	ADVANCED MICRO DEVICES	62,122	78.58	4,881,546.76	
	ANALOG DEVICES INC	19,298	159.73	3,082,469.54	
	APPLIED MATERIALS INC	47,402	135.00	6,399,270.00	
	BROADCOM INC	21,006	483.67	10,159,972.02	
	ENPHASE ENERGY INC	6,292	151.87	955,566.04	
	INTEL CORP	209,686	65.40	13,714,512.83	
	KLA CORPORATION	8,157	345.10	2,814,980.70	
	LAM RESEARCH CORP	7,291	650.27	4,741,118.57	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	34,976	49.65	1,736,558.40	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	95.01	1,312,468.14	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,024	158.77	2,067,820.48	
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,027	95.59	5,546,800.93	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	373.92	838,702.56	
	NVIDIA CORP	31,711	608.36	19,291,703.96	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	207.94	3,006,188.58	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	42.40	886,668.80	
	QORVO INC	6,042	192.56	1,163,447.52	
	QUALCOMM INC	57,637	137.44	7,921,629.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	188.12	1,647,366.84	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	263.20	693,268.80	
	TERADYNE INC	8,542	130.43	1,114,133.06	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	46,835	192.43	9,012,459.05	
	XILINX INC	12,876	124.23	1,599,585.48	
米ドル 小計		16,130,639		1,869,092,040.24 (204,815,105,769)	
カナダドル	CAMECO CORP	18,890	21.01	396,878.90	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	59,883	38.44	2,301,902.52	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	9.52	714,571.20	

ENBRIDGE INC	106,452	46.11	4,908,501.72	
IMPERIAL OIL LTD	12,999	31.96	415,448.04	
INTER PIPELINE LTD	19,394	17.92	347,540.48	
KEYERA CORP	11,374	26.03	296,065.22	
PARKLAND CORP	7,666	39.06	299,433.96	
PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	36.56	1,002,146.16	
SUNCOR ENERGY INC	78,642	26.08	2,050,983.36	
TC ENERGY CORP	47,323	58.85	2,784,958.55	
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	13,447	75.50	1,015,248.50	
B2GOLD CORP	42,963	5.87	252,192.81	
BARRICK GOLD CORP	93,098	26.35	2,453,132.30	
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	70.16	460,460.08	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	25.90	820,304.80	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,165	168.30	1,710,769.50	
KINROSS GOLD CORP	63,501	9.08	576,589.08	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	13,385	45.14	604,198.90	
LUNDIN MINING CORP	28,209	13.20	372,358.80	
NUTRIEN LTD	29,898	68.44	2,046,219.12	
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	40.85	480,518.55	
SSR MINING INC	11,552	19.20	221,798.40	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	24.43	606,206.02	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	102.90	456,670.20	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,382	51.22	1,095,186.04	
YAMANA GOLD INC	53,588	5.71	305,987.48	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	9,158	28.02	256,607.16	
CAE INC	12,891	37.85	487,924.35	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	97.46	374,538.78	
WSP GLOBAL INC	6,141	123.37	757,615.17	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	44.11	437,262.43	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	5,667	79.44	450,186.48	
THOMSON REUTERS CORP	10,122	114.16	1,155,527.52	
AIR CANADA	5,737	27.00	154,899.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,544	147.08	5,374,891.52	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	474.54	3,376,352.10	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	112.39	1,614,369.96	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	41.73	378,324.18	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,510	84.08	1,220,000.80	
QUEBECOR INC -CL B	9,953	34.92	347,558.76	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	33.59	914,722.88	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,001	186.77	560,496.77	
DOLLARAMA INC	17,025	56.66	964,636.50	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	44,270	41.69	1,845,616.30	
EMPIRE CO LTD A	9,148	40.54	370,859.92	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	70.49	612,064.67	
METRO INC	13,109	59.06	774,217.54	
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	112.60	482,040.60	
SAPUTO INC	13,425	38.84	521,427.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	37.61	618,571.67	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	34.73	390,747.23	
BANK OF MONTREAL	33,057	115.72	3,825,356.04	
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	78.49	4,968,966.43	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	124.46	2,926,427.98	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	86.80	1,474,992.40	
ROYAL BANK OF CANADA	73,234	117.59	8,611,586.06	
TORONTO-DOMINION BANK	92,906	83.60	7,766,941.60	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,755	57.73	3,796,036.15	
IGM FINANCIAL INC	6,433	39.85	256,355.05	
ONEX CORPORATION	4,217	79.99	337,317.83	
TMX GROUP LTD	3,142	135.89	426,966.38	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	572.04	796,851.72	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	34.63	491,746.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	70.15	340,297.65	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	160.29	1,131,326.82	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	27.47	2,741,780.70	
POWER CORP OF CANADA	25,796	34.08	879,127.68	
SUN LIFE FINANCIAL INC	28,819	65.10	1,876,116.90	
FIRSTSERVICE CORP	1,820	197.98	360,323.60	
BLACKBERRY LIMITED	25,993	11.35	295,020.55	
CGI INC-CL A	12,634	108.27	1,367,883.18	
CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,914.12	1,963,887.12	

	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	62.31	851,466.15	
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,661	1,508.52	8,539,731.72	
	BCE INC	8,379	57.93	485,395.47	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,236	60.64	1,105,831.04	
	TELUS CORPORATION	15,222	25.73	391,662.06	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	20.28	635,960.52	
	ALTAGAS LTD	17,347	21.23	368,276.81	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	42.82	129,744.60	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	59.21	375,154.56	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	34.43	252,853.92	
	EMERA INC	14,279	56.65	808,905.35	
	FORTIS INC	24,171	54.74	1,323,120.54	
	HYDRO ONE LTD	15,052	30.00	451,560.00	
	NORTHLAND POWER INC	8,016	46.52	372,904.32	
カナダドル 小計		2,042,482		116,165,604.88 (10,121,509,153)	
ユーロ	ENI SPA	123,580	10.16	1,255,819.96	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	22,025	9.65	212,717.45	
	NESTE OYJ	22,153	45.60	1,010,176.80	
	OMV AG	7,130	42.18	300,743.40	
	REPSOL SA	81,853	10.21	835,719.13	
	TENARIS S.A.	25,963	9.11	236,626.78	
	TOTAL SE	130,580	37.67	4,918,948.60	
	VOPAK	3,130	40.76	127,578.80	
	AIR LIQUIDE SA	24,154	140.42	3,391,704.68	
	AKZO NOBEL	10,399	97.56	1,014,526.44	
	ARCELORMITTAL	36,689	24.35	893,560.59	
	ARKEMA	3,250	103.50	336,375.00	
	BASF SE	47,459	71.08	3,373,385.72	
	COVESTRO AG	9,346	56.42	527,301.32	
	CRH PLC	40,255	40.54	1,631,937.70	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	30.27	331,517.04	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.02	144,977.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,170	78.14	560,263.80	
	KONINKLIJKE DSM NV	8,994	148.75	1,337,857.50	

LANXESS	4,409	62.32	274,768.88	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	39.84	514,772.64	
SOLVAY SA	3,758	106.40	399,851.20	
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	16.19	489,488.46	
SYMRISE AG	6,524	105.85	690,565.40	
UMICORE	9,351	46.75	437,159.25	
UPM-KYMMENE OYJ	28,055	31.00	869,705.00	
VOESTALPINE AG	6,056	36.26	219,590.56	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,285	27.65	339,680.25	
AIRBUS SE	30,165	99.90	3,013,483.50	
ALSTOM RGPT	11,800	44.02	519,436.00	
BOUYGUES SA	11,049	34.37	379,754.13	
BRENNTAG SE	7,392	73.02	539,763.84	
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	12.94	709,062.37	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	26,413	51.85	1,369,514.05	
DASSAULT AVIATION SA	172	959.00	164,948.00	
EIFFAGE SA	4,989	87.84	438,233.76	
FERROVIAL SA	24,212	22.09	534,843.08	
GEA GROUP AG	8,178	35.80	292,772.40	
HOCHTIEF AG	1,931	76.88	148,455.28	
KINGSPAN GROUP PLC	7,215	73.32	529,003.80	
KION GROUP AG	3,179	82.04	260,805.16	
KNORR-BREMSE AG	3,881	105.00	407,505.00	
KONE OYJ-B	17,618	70.92	1,249,468.56	
LEGRAND SA	13,323	82.48	1,098,881.04	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	199.15	588,886.55	
PRYSMIAN SPA	12,526	26.52	332,189.52	
RATIONAL AG	190	657.00	124,830.00	
SAFRAN SA	15,933	117.78	1,876,588.74	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,924	133.46	3,726,737.04	
SIEMENS AG-REG	39,550	139.28	5,508,524.00	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	29.53	586,318.15	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	29.52	338,948.64	
THALES SA	5,403	85.56	462,280.68	
VINCI S.A.	27,668	90.67	2,508,657.56	

WARTSILA OYJ-B SHARES	26,753	9.05	242,114.65	
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.77	441,327.09	
RANDSTAD NV	5,367	62.14	333,505.38	
TELEPERFORMANCE	2,970	325.20	965,844.00	
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	76.22	1,111,135.16	
AENA SME SA	3,556	135.85	483,082.60	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	102.25	137,628.50	
ATLANTIA SPA	26,501	16.26	430,906.26	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	10.91	180,822.34	
DEUTSCHE POST AG-REG	51,345	48.48	2,489,462.32	
GETLINK	22,311	12.97	289,485.22	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	88.95	1,589,803.35	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,564	69.65	178,582.60	
CONTINENTAL AG	5,578	111.80	623,620.40	
DAIMLER AG	44,402	75.97	3,373,219.94	
FAURECIA	6,090	46.25	281,662.50	
FERRARI NV	6,452	176.10	1,136,197.20	
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	125.00	1,093,250.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	94.98	737,519.70	
RENAULT SA	8,830	35.75	315,716.65	
STELLANTIS NV	105,516	14.93	1,576,198.00	
VALEO SA	9,522	27.40	260,902.80	
VOLKSWAGEN AG	1,484	296.40	439,857.60	
VOLKSWAGEN AG PFD	9,278	235.55	2,185,432.90	
ADIDAS AG	9,675	281.60	2,724,480.00	
ESSILORLUXOTTICA	14,521	139.14	2,020,451.94	
HERMES INTERNATIONAL	1,676	985.40	1,651,530.40	
KERING	3,983	616.40	2,455,121.20	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,228	589.70	8,390,251.60	
MONCLER SPA	10,437	50.10	522,893.70	
PUMA SE	5,052	91.72	463,369.44	
SEB SA	1,127	144.50	162,851.50	
ACCOR SA	10,451	32.59	340,598.09	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,599	174.20	1,497,945.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	40.68	235,333.80	

SODEXO	3,900	83.06	323,934.00	
BOLLORE	39,433	4.12	162,542.82	
PUBLICIS GROUPE	10,736	51.04	547,965.44	
SCOUT24 AG	5,610	69.20	388,212.00	
SES	25,036	6.81	170,495.16	
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	4,745	66.62	316,111.90	
VIVENDI SA	41,661	28.00	1,166,508.00	
DELIVERY HERO SE	6,675	120.25	802,668.75	
HELLOFRESH AG	8,096	70.02	566,881.92	
INDITEX	55,025	27.49	1,512,637.25	
JUST EAT TAKEAWAY	6,355	84.84	539,158.20	
PROSUS NV	25,646	92.67	2,376,614.82	
ZALANDO SE	7,911	85.16	673,700.76	
CARREFOUR SA	27,456	14.96	410,879.04	
COLRUYT NV	2,164	49.58	107,291.12	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	14,348	14.28	204,961.18	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	25.25	338,400.50	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	23.63	1,404,850.76	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,567	54.69	2,163,919.23	
DANONE	32,081	59.53	1,909,781.93	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	9.68	271,299.32	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	78.70	485,421.60	
HEINEKEN NV	13,143	91.10	1,197,327.30	
JDE PEET'S BV	2,166	31.34	67,882.44	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	110.40	904,507.20	
PERNOD-RICARD SA	11,112	168.25	1,869,594.00	
REMY COINTREAU	1,273	163.40	208,008.20	
BEIERSDORF AG	5,138	91.72	471,257.36	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	85.35	509,880.90	
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	98.68	892,363.24	
L'OREAL	12,964	337.10	4,370,164.40	
AMPLIFON SPA	7,567	32.82	248,348.94	
BIOMERIEUX	1,570	111.85	175,604.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	138.90	315,164.10	
DIASORIN SPA	1,313	153.05	200,954.65	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	63.70	708,216.60	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	38.75	827,923.06	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,760	50.44	2,409,014.40	
ORPEA	2,695	106.80	287,826.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	450.60	812,882.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	14,182	46.98	666,270.36	
ARGENX SE	2,330	228.00	531,240.00	
BAYER AG	50,652	52.94	2,681,516.88	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	85.64	600,336.40	
GALAPAGOS NV	2,318	64.71	149,997.78	
GRIFOLS S.A.	15,169	23.29	353,286.01	
IPSEN	1,498	75.18	112,619.64	
MERCK KGAA	6,553	146.70	961,325.10	
ORION OYJ	4,159	34.87	145,024.33	
QIAGEN N.V.	12,543	43.04	539,850.72	
RECORDATI SPA	4,578	45.37	207,703.86	
SANOFI	58,854	84.69	4,984,345.26	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	362.70	563,998.50	
UCB SA	6,623	79.26	524,938.98	
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	10.63	201,228.40	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	4.47	1,579,884.05	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	893,341	2.90	2,597,388.95	
BNP PARIBAS	58,640	51.42	3,015,268.80	
CAIXABANK	218,103	2.60	567,285.90	
COMMERZBANK AG	46,644	5.04	235,132.40	
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	12.52	728,377.92	
ERSTE GROUP BANK AG	14,968	29.28	438,263.04	
FINECOBANK SPA	32,034	14.08	451,198.89	
ING GROEP NV-CVA	205,237	10.37	2,129,128.63	
INTESA SANPAOLO	852,114	2.26	1,926,203.69	
KBC GROUPE SA	13,049	62.16	811,125.84	
MEDIOBANCA SPA	24,371	9.38	228,599.98	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,034	18.29	128,651.86	
SOCIETE GENERALE	41,025	22.08	906,037.12	

UNICREDIT SPA	112,845	8.63	974,755.11	
AMUNDI SA	3,955	72.70	287,528.50	
DEUTSCHE BANK AG -REG	102,459	10.37	1,062,499.83	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	147.50	1,479,572.50	
EURAZEO	1,792	66.60	119,347.20	
EXOR NV	6,204	71.44	443,213.76	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	91.52	541,249.28	
NATIXIS	45,362	4.03	183,171.75	
SOFINA	804	304.60	244,898.40	
WENDEL	1,082	110.40	119,452.80	
AEGON NV	91,609	3.97	364,512.21	
AGEAS	8,765	51.24	449,118.60	
ALLIANZ SE-REG	21,071	219.15	4,617,709.65	
ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	17.07	978,162.21	
AXA SA	100,473	23.68	2,379,200.64	
CNP ASSURANCES	8,978	16.76	150,516.17	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	157.15	480,564.70	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,008	265.30	1,859,222.40	
NN GROUP NV	14,069	42.26	594,555.94	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.78	286,471.17	
SAMPO OYJ-A SHS	24,178	40.28	973,889.84	
SCOR SE	6,322	29.39	185,803.58	
AROUNDTOWN SA	52,114	6.30	328,526.65	
DEUTSCHE WOHNEN SE	17,590	41.56	731,040.40	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	114.90	422,832.00	
VONOVIA SE	27,415	57.60	1,579,104.00	
ADYEN NV	942	1,959.00	1,845,378.00	
AMADEUS IT GROUP SA	23,777	58.58	1,392,856.66	
ATOS SE	4,592	59.66	273,958.72	
BECHTLE AG	1,435	164.65	236,272.75	
CAPGEMINI SA	7,966	151.65	1,208,043.90	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,023	188.45	1,323,484.35	
EDENRED	12,139	45.43	551,474.77	
NEMETSCHEK SE	3,011	57.90	174,336.90	
NEXI SPA	20,612	15.51	319,692.12	

SAP SE	54,000	111.24	6,006,960.00	
TEAMVIEWER AG	9,059	37.42	338,987.78	
WORLDLINE SA	12,774	73.32	936,589.68	
NOKIA OYJ	280,161	3.47	972,859.07	
CELLNEX TELECOM SA	22,722	41.86	951,142.92	
CELLNEX TELECOM SA RTS	16,378	2.14	35,163.56	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	175,196	16.30	2,856,045.19	
ELISA OYJ	6,988	48.79	340,944.52	
ILIAD SA	1,016	160.75	163,322.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.39	148,494.38	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.86	497,893.40	
ORANGE S.A.	106,132	10.34	1,097,829.40	
PROXIMUS SA	9,697	18.78	182,109.66	
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.43	215,438.91	
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.46	118,122.52	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.46	115,455.49	
TELEFONICA S.A.	261,218	3.81	995,240.58	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	33.58	176,933.02	
E.ON SE	116,681	10.03	1,170,543.79	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	5.16	752,895.60	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	29,644	12.13	359,581.72	
ELIA GROUP SA/NV	1,464	91.75	134,322.00	
ENAGAS	14,471	18.50	267,713.50	
ENDESA S.A.	14,104	22.65	319,455.60	
ENEL SPA	420,487	8.58	3,607,778.46	
ENGIE	94,886	12.45	1,181,520.47	
FORTUM OYJ	24,312	22.39	544,345.68	
IBERDROLA SA	310,163	11.43	3,545,163.09	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	20.87	322,211.93	
RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	15.02	355,070.80	
RWE AG	32,165	34.53	1,110,657.45	
SNAM SPA	106,707	4.64	495,440.60	
SUEZ	18,986	19.86	377,156.89	
TERNA SPA	70,562	6.10	430,851.57	
UNIPER SE	10,456	31.16	325,808.96	

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	24.75	706,884.75	
	VERBUND AG	3,190	62.95	200,810.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,455	262.50	644,437.50	
	ASML HOLDING NV	21,794	524.40	11,428,773.60	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	66,553	35.18	2,341,334.54	
	STMICROELECTRONICS NV	33,261	32.54	1,082,312.94	
ユーロ 小計		9,861,260		235,055,600.45 (30,655,951,410)	
英ポンド	BP PLC	1,057,250	2.98	3,154,834.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,867	14.02	2,985,672.54	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	188,653	13.36	2,521,913.30	
	ANGLO AMERICAN PLC	61,589	30.29	1,865,530.81	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	17.00	330,463.00	
	BHP GROUP PLC	110,160	21.18	2,333,188.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,626	65.70	435,328.20	
	EVRAZ PLC	28,275	5.95	168,292.80	
	FRESNILLO PLC	9,684	8.86	85,877.71	
	GLENCORE PLC	538,015	2.86	1,539,798.93	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	31.52	317,532.48	
	MONDI PLC	25,128	18.94	476,049.96	
	RIO TINTO PLC	57,926	56.45	3,269,922.70	
	ASHTEAD GROUP PLC	23,686	45.42	1,075,818.12	
	BAE SYSTEMS PLC	165,753	5.05	837,052.65	
	BUNZL PLC	17,064	24.34	415,337.76	
	DCC PLC	5,954	62.72	373,434.88	
	FERGUSON PLC	11,059	92.20	1,019,639.80	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	1.71	422,734.88	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	389,579	1.08	421,602.39	
	SMITHS GROUP PLC	16,787	15.92	267,332.97	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	120.20	442,937.00	
	EXPERIAN PLC	48,895	26.48	1,294,739.60	
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	59.84	489,730.56	
	RELX PLC	100,974	19.11	1,929,613.14	
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	5.13	464,531.76	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	7.80	364,586.75	

BURBERRY GROUP PLC	23,066	20.52	473,314.32	
PERSIMMON PLC	16,916	31.37	530,654.92	
TAYLOR WIMPEY PLC	158,662	1.84	293,286.70	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	45.93	330,098.91	
COMPASS GROUP PLC	93,018	15.73	1,463,173.14	
ENTAIN PLC	28,865	15.73	454,046.45	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,790	51.24	399,159.60	
WHITBREAD PLC	11,282	34.46	388,777.72	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	5.70	250,801.52	
INFORMA PLC	78,152	5.76	450,155.52	
PEARSON PLC	39,623	7.96	315,716.06	
WPP PLC	63,987	9.39	601,221.85	
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	9.13	263,664.96	
KINGFISHER PLC	109,678	3.34	367,092.26	
NEXT PLC	6,860	81.00	555,660.00	
OCADO GROUP PLC	27,379	21.00	574,959.00	
SAINSBURY (J) PLC	67,872	2.45	166,354.27	
TESCO PLC	399,930	2.32	927,837.60	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.82	267,463.81	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	24.63	413,069.73	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	119,386	27.88	3,329,078.61	
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.41	212,464.64	
DIAGEO PLC	120,446	31.62	3,808,502.52	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	15.53	776,796.60	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	66.34	2,480,120.90	
UNILEVER PLC	133,961	41.35	5,539,957.15	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.01	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	14.00	621,191.77	
ASTRAZENECA PLC	67,526	72.25	4,878,753.50	
GLAXOSMITHKLINE PLC	258,176	12.97	3,350,091.77	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	24.31	184,294.11	
BARCLAYS PLC	904,741	1.88	1,701,636.87	
HSBC HOLDINGS PLC	1,044,428	4.32	4,517,673.31	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.44	1,667,521.89	
NATWEST GROUP PLC	245,244	1.98	487,545.07	

	STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.96	728,261.60	
	3I GROUP PLC	49,338	12.38	610,804.44	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	16.77	328,222.44	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,810	75.00	1,185,750.00	
	M&G PLC	133,064	2.17	289,015.00	
	SCHRODERS PLC	6,213	36.43	226,339.59	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	13.34	348,934.38	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	2.96	365,105.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	32.04	369,581.40	
	AVIVA PLC	198,601	4.08	810,490.68	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.04	192,525.13	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.96	928,992.79	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	21,914	7.36	161,462.35	
	PRUDENTIAL PLC	130,604	15.52	2,027,627.10	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	6.82	357,070.26	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	37.57	226,810.09	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	6.47	362,235.89	
	HALMA PLC	19,839	25.35	502,918.65	
	BT GROUP PLC	469,907	1.52	714,493.59	
	VODAFONE GROUP PLC	1,338,401	1.34	1,804,432.22	
	NATIONAL GRID PLC	182,788	8.99	1,643,995.27	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	24.32	302,005.76	
	SSE PLC	55,879	15.33	856,625.07	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	9.69	321,975.07	
英ポンド 小計		15,165,706		88,011,347.71 (13,252,748,738)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.95	191,413.95	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	828.00	294,768.00	
	GIVAUDAN-REG	484	3,764.00	1,821,776.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	27,239	57.04	1,553,712.56	
	SIKA AG	7,399	272.50	2,016,227.50	
	ABB LTD	95,025	29.33	2,787,083.25	
	GEBERIT AG-REG	1,986	618.60	1,228,539.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	268.20	252,376.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	277.00	590,564.00	

	ADECCO GROUP AG-REG	8,786	65.44	574,955.84	
	SGS SA	308	2,734.00	842,072.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,618	275.00	719,950.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,855	92.20	2,568,231.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,257	279.30	351,080.10	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	54.35	136,744.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	2,164.00	311,616.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	59	8,600.00	507,400.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	90,400.00	452,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	147,564	108.30	15,981,181.20	
	ALCON INC	26,585	68.32	1,816,287.20	
	SONOVA HOLDING AG	2,660	260.10	691,866.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	475	1,232.50	585,437.50	
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	536.40	2,137,017.60	
	NOVARTIS AG-REG SHS	113,904	80.68	9,189,774.72	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	1,436	322.40	462,966.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	35,910	306.80	11,017,188.00	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	128.60	339,246.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOISE REG	1,570	95.00	149,150.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	126,713	9.83	1,245,588.79	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,324	61.20	631,828.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	1,317.50	1,281,927.50	
	UBS GROUP AG	191,189	14.82	2,834,376.92	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	162.60	402,435.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,421	475.40	675,543.40	
	SWISS RE AG	15,168	93.76	1,422,151.68	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,733	384.40	2,972,565.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	89.20	348,415.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	4,063	143.25	582,024.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,150	100.10	815,815.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	482.80	675,437.20	
スイスフラン 小計		899,451		73,458,735.46 (8,716,613,549)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	266.20	2,284,262.20	
	BOLIDEN AB	13,086	317.30	4,152,187.80	

SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	34,370	156.80	5,389,216.00	
ALFA LAVAL AB	13,939	272.40	3,796,983.60	
ASSA ABLOY AB-B	52,119	255.60	13,321,616.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	546.80	18,828,511.20	
ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	468.70	9,274,166.90	
EPIROC AB-A	34,230	204.70	7,006,881.00	
EPIROC AB-B	16,402	184.15	3,020,428.30	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	4,951	236.60	1,171,406.60	
NIBE INDUSTRIER-B	18,441	294.30	5,427,186.30	
SANDVIK AB	61,070	239.40	14,620,158.00	
SKANSKA AB-B SHS	17,183	227.20	3,903,977.60	
SKF AB-B SHARES	20,607	249.80	5,147,628.60	
VOLVO AB-B SHS	71,792	206.80	14,846,585.60	
SECURITAS AB-B SHS	16,123	148.80	2,399,102.40	
ELECTROLUX AB-SER B	15,098	242.20	3,656,735.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	124.45	2,313,898.85	
EVOLUTION GAMING GROUP	7,578	1,355.00	10,268,190.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	42,837	197.96	8,480,012.52	
ICA GRUPPEN AB	5,614	422.40	2,371,353.60	
SWEDISH MATCH AB	8,464	720.80	6,100,851.20	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,701	279.80	9,149,739.80	
NORDEA BANK ABP	167,942	87.30	14,661,336.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	108.60	9,591,226.20	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	96.94	7,529,135.92	
SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	158.18	7,263,783.78	
EQT AB	12,365	290.90	3,596,978.50	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,396	333.00	1,130,868.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	312.10	3,321,368.20	
INVESTOR AB-B SHS	23,614	712.80	16,832,059.20	
KINNEVIK AB-B SHS	12,465	452.40	5,639,166.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	490.00	1,650,320.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	467.00	2,485,841.00	
ERICSSON LM-B SHS	146,984	118.90	17,476,397.60	
HEXAGON AB-B SHS	14,730	836.00	12,314,280.00	
TELE2 AB-B SHS	25,537	119.65	3,055,502.05	

	TELIA CO AB	128,045	38.37	4,913,086.65	
スウェーデンクローナ 小計		1,334,317		268,392,429.77 (3,427,371,328)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	51,871	163.90	8,501,656.90	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	52.76	3,394,789.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	426.50	3,840,632.50	
	ADEVINTA ASA-B	11,815	130.15	1,537,722.25	
	SCHIBSTED ASA	3,372	381.20	1,285,406.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	331.40	1,816,072.00	
	MOWI ASA	22,242	205.30	4,566,282.60	
	ORKLA ASA	37,292	85.50	3,188,466.00	
	DNB ASA	49,048	181.15	8,885,045.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	201.70	2,301,800.40	
	TELENOR ASA	34,937	152.85	5,340,120.45	
ノルウェークローネ 小計		300,818		44,657,994.14 (576,088,124)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	597.80	3,293,280.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	408.20	4,699,198.40	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S	205	2,600.00	533,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,488	1,200.20	12,587,697.60	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	13,920.00	2,338,560.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	311	14,900.00	4,633,900.00	
	DSV PANALPINA A S	10,873	1,269.50	13,803,273.50	
	PANDORA A/S	4,763	681.80	3,247,413.40	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,045.50	5,839,117.50	
	AMBU A/S-B	8,356	308.20	2,575,319.20	
	COLOPLAST-B	6,399	957.20	6,125,122.80	
	DEMANT A/S	4,455	291.10	1,296,850.50	
	GN STORE NORD A/S	6,484	515.80	3,344,447.20	
	GENMAB A/S	3,317	2,102.00	6,972,334.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	223.80	648,124.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	89,680	434.40	38,956,992.00	
	DANSKE BANK A/S	31,326	123.10	3,856,230.60	
	TRYG A/S	16,989	150.25	2,552,597.25	
	ORSTED A/S	9,555	1,046.00	9,994,530.00	

デンマーククローネ 小計		228,871		127,297,988.95 (2,232,806,726)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	10,927	24.50	267,711.50	
	OIL SEARCH LTD	105,618	4.05	427,752.90	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,448	4.73	517,689.04	
	SANTOS LTD	84,586	7.13	603,098.18	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	5,294	32.54	172,266.76	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	24.33	1,225,112.82	
	BHP GROUP LTD	153,209	46.18	7,075,191.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	20.33	469,399.37	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.47	377,357.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	92,105	20.55	1,892,757.75	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,266	41.65	927,378.90	
	NEWCREST MINING LIMITED	42,131	26.04	1,097,091.24	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,015	10.59	519,068.85	
	ORICA LIMITED	17,981	14.41	259,106.21	
	RIO TINTO LIMITED	19,336	114.88	2,221,319.68	
	SOUTH32 LTD	233,326	2.89	674,312.14	
	CIMIC GROUP LTD	4,062	17.96	72,953.52	
	BRAMBLES LIMITED	74,638	10.68	797,133.84	
	AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.95	373,038.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	5.32	243,820.92	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	36.29	1,115,881.21	
	CROWN RESORTS LTD	21,863	12.09	264,323.67	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	112,817	4.92	555,059.64	
	REA GROUP LTD	2,833	152.95	433,307.35	
	SEEK LIMITED	16,730	31.40	525,322.00	
	WESFARMERS LIMITED	57,250	54.31	3,109,247.50	
	COLES GROUP LIMITED	67,053	15.76	1,056,755.28	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	41.04	2,692,511.28	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,639	13.46	358,560.94	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	10.28	374,849.92	
	COCHLEAR LIMITED	3,798	221.76	842,244.48	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	67.89	641,288.94	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	35.48	747,953.88	

	CSL LIMITED	23,602	265.50	6,266,331.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	148,002	28.87	4,272,817.74	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	90,927	86.72	7,885,189.44	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	172,940	26.83	4,639,980.20	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	189,179	25.30	4,786,228.70	
	AMP LIMITED	223,504	1.26	281,615.04	
	ASX LTD	11,180	73.07	816,922.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	17,336	153.92	2,668,357.12	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	48.40	279,897.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	4.83	566,013.21	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.91	374,586.84	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	68,618	9.73	667,653.14	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	10.36	662,345.88	
	AFTERPAY LTD	11,190	121.20	1,356,228.00	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	14.56	407,199.52	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	30.63	242,252.67	
	XERO LTD	6,090	141.26	860,273.40	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.49	757,131.07	
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.30	111,875.40	
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	9.60	311,923.20	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.87	159,361.40	
オーストラリアドル 小計		3,460,890		71,305,049.50 (5,946,841,128)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.68	543,060.48	
	A2 MILK CO LTD	37,422	8.57	320,706.54	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	28,241	32.17	908,512.97	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	20,761	14.87	308,716.07	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	89,712	4.37	392,041.44	
	MERCURY NZ LTD	31,947	6.75	215,642.25	
	MERIDIAN ENERGY LTD	67,872	5.62	381,440.64	
ニュージーランドドル 小計		346,666		3,070,120.39 (235,969,453)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	150,924	62.15	9,379,926.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	136.50	9,623,250.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	64,000	25.10	1,606,400.00	

	MTR CORPORATION	84,500	43.90	3,709,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	69.30	8,177,400.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	36.45	4,228,200.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	9.95	796,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	15.16	1,073,328.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	24.05	2,154,880.00	
	WH GROUP LIMITED	474,500	6.79	3,221,855.00	
	BANK OF EAST ASIA	38,420	16.60	637,772.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	26.95	5,053,125.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	151.40	5,874,320.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,900	456.60	28,720,140.00	
	AIA GROUP LTD	622,000	96.20	59,836,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,924	47.30	6,618,405.20	
	ESR CAYMAN LTD	64,600	25.00	1,615,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	20.90	2,048,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	34.60	2,885,086.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	40.75	3,456,944.75	
	SINO LAND CO	118,200	11.00	1,300,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	118.00	8,024,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	61.40	1,657,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	23.45	1,242,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	43.00	4,386,000.00	
	PCCW LIMITED	256,000	4.49	1,149,440.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	46.45	1,393,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	74.75	6,361,225.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	125,000	7.73	966,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	607,514	12.20	7,411,670.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	45.80	3,274,700.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,600	102.20	1,185,520.00	
香港ドル 小計		4,294,099		199,069,338.75 (2,806,877,676)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	5.44	380,256.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	76,100	3.97	302,117.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.60	436,609.60	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.92	302,937.50	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	5.40	557,280.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	91,200	28.69	2,616,528.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	171,500	11.80	2,023,700.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	58,700	26.02	1,527,374.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.96	426,288.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	3.77	514,982.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.05	207,690.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.75	168,175.00	
	VENTURE CORP LTD	15,200	20.28	308,256.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,115	2.43	1,042,749.45	
シンガポールドル 小計		1,647,281		10,814,942.55 (884,013,404)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LIMITED	28,711	20.76	596,040.36	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	471.00	654,219.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	26.98	1,791,552.94	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	22.90	1,606,435.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	14.08	769,809.92	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	89.20	825,010.80	
	AZRIELI GROUP	2,140	214.30	458,602.00	
	NICE LTD	3,251	752.50	2,446,377.50	
イスラエルシュケル 小計		235,967		9,148,047.52 (303,985,045)	
合　計		55,948,447		283,975,881,503 (283,975,881,503)	

（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　593銘柄	69.3%	72.1%
カナダドル	株式　87銘柄	3.4%	3.6%
ユーロ	株式　235銘柄	10.4%	10.8%
英ポンド	株式　86銘柄	4.5%	4.7%
スイスフラン	株式　40銘柄	2.9%	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	2.0%	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　32銘柄	0.9%	1.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	0.3%	0.3%
イスラエルシュケル	株式　8銘柄	0.1%	0.1%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	436,667.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,496	1,097,564.16	
		AMERICAN TOWER CORP	23,040	5,564,160.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,936	567,540.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344	1,374,209.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	824,163.65	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	550,102.44	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	22,634	4,018,440.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,002	2,009,567.04	
		DUKE REALTY CORP	17,601	761,771.28	
		EQUINIX INC	4,655	3,218,606.65	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	568,185.12	
		EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,411,984.38	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	945,355.04	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,164	858,460.28	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756	944,347.04	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	648,065.25	
		INVITATION HOMES INC	27,735	901,387.50	
		IRON MOUNTAIN INC	14,204	538,473.64	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858	691,318.60	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	851,451.80	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,364	392,381.04	
		PROLOGIS INC	38,832	4,265,306.88	
		PUBLIC STORAGE	8,249	2,151,834.14	

	REALTY INCOME CORPORATION	17,798	1,168,794.66	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289	483,663.15	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	1,659,378.84	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,201	1,858,902.74	
	SUN COMMUNITIES INC	5,064	778,944.48	
	UDR INC	16,633	734,513.28	
	VENTAS INC	19,379	1,067,589.11	
	VEREIT INC	10,854	440,129.70	
	VICI PROPERTIES INC	27,615	790,893.60	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706	399,605.40	
	WELLTOWER INC	21,015	1,584,320.85	
	WEYERHAEUSER CO	38,940	1,452,851.40	
	WP CAREY INC	8,640	615,600.00	
米ドル 小計		645,105	48,626,530.86 (5,328,495,251)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	3,971	221,303.83	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	149,043.23	
カナダドル 小計		11,412	370,347.06 (32,268,339)	
ユーロ	COVIVIO	2,388	176,043.36	
	GECINA SA	2,189	262,242.20	
	KLEPIERRE	9,305	190,845.55	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,962	545,635.86	
ユーロ 小計		21,844	1,174,766.97 (153,213,108)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	228,496.88	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861	283,013.10	
	SEGRO PLC	59,874	578,382.84	
英ポンド 小計		144,697	1,089,892.82 (164,116,060)	
オーストラリアドル	APA GROUP	55,644	564,230.16	
	DEXUS	54,256	538,219.52	
	GOODMAN GROUP	86,301	1,576,719.27	
	GPT GROUP	97,296	459,237.12	

		LENDLEASE GROUP	36,263	480,122.12	
		MIRVAC GROUP	200,053	494,130.91	
		SCENTRE GROUP	275,200	781,568.00	
		STOCKLAND	127,393	583,459.94	
		SYDNEY AIRPORT	73,899	455,217.84	
		TRANSURBAN GROUP	138,897	1,898,721.99	
		VICINITY CENTRES	167,788	281,044.90	
	オーストラリアドル 小計		1,312,990	8,112,671.77 (676,596,825)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,163,060.00	
		LINK REIT	110,100	7,756,545.00	
	香港ドル 小計		307,100	9,919,605.00 (139,866,430)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	170,500	521,730.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	238,488	515,134.08	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	222,388.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	138,100	269,295.00	
		SUNTEC REIT	102,700	161,239.00	
	シンガポールドル 小計		754,688	1,689,786.08 (138,123,114)	
合計				6,632,679,127 (6,632,679,127)	

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券　37銘柄	1.8%	80.3%
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%	2.3%
英ポンド	投資証券　3銘柄	0.1%	2.5%
オーストラリアドル	投資証券　11銘柄	0.2%	10.2%
香港ドル	投資証券　2銘柄	0.0%	2.1%
シンガポールドル	投資証券　5銘柄	0.0%	2.1%

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13日現在）	（2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	308,581,281	45,981,282
金銭信託	597,505,503	228,213,133
コール・ローン	415,356,115	118,273,326
国債証券	154,165,757,446	162,158,985,055
未収利息	1,166,031,411	1,125,045,179
前払費用	26,718,180	21,150,614
流動資産合計	156,679,949,936	163,697,648,589
資産合計	156,679,949,936	163,697,648,589
負債の部		
流動負債		
未払解約金	346,702,542	9,011,993
未払利息	1,126	324
その他未払費用	127,850	3,950
流動負債合計	346,831,518	9,016,267
負債合計	346,831,518	9,016,267
純資産の部		
元本等		
元本	84,556,952,355	84,438,755,498
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	71,776,166,063	79,249,876,824
元本等合計	156,333,118,418	163,688,632,322
純資産合計	156,333,118,418	163,688,632,322
負債純資産合計	156,679,949,936	163,697,648,589

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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13日現在）	（2021年 4月13日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	84,556,952,355口	84,438,755,498口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.8488円 (10,000口当たりの純資産額　18,488円)	1口当たり純資産額　1.9385円 (10,000口当たりの純資産額　19,385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14日 至 2021年 4月13日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第２条第４項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２.金融商品の内容及び金融商品に係る	(1)金融商品の内容

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 4月13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14日 至 2021年 4月13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13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	93,585,617,520円
同期中における追加設定元本額	19,007,917,668円
同期中における一部解約元本額	28,036,582,833円
2020年 4月13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	21,722,757,217円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	620,743,841円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,623,582,446円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	762,999,674円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	59,334,732円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	8,595,523円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	31,127,149円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	88,259,689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）	122,049,060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）	67,678,112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）	141,427,020円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	22,354,389円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	123,833,140円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	139,221,474円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	105,757,710円
イオン・バランス戦略ファンド	11,543,568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）	56,776,890円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	60,159,644円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	118,132,027円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	42,972,475円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	19,521,125円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	39,747,781円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,305,631円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	96,216円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	393,028円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	205,854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＞	1,979,767,666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＞	9,428,559,138円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,852,730,810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＞	615,393,737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＞	1,687,191,656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＞	9,314,565,021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）	360,272,280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＞	102,843,371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＞	145,459,904円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	40,950,132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＞	1,197,268,688円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	19,121,083円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,870,186,532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＞	4,740,964,036円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	515,138,509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＞	119,634,570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＞	37,467,680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＞	519,383,116円
合計	84,556,952,355円

（2021年 4月13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	84,556,952,355円
同期中における追加設定元本額	11,304,078,309円
同期中における一部解約元本額	11,422,275,166円
2021年 4月13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	23,568,244,950円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	727,323,151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）	31,877,472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）	102,070,891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）	114,686,398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）	24,554,885円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	124,954,775円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	43,978,309円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	12,865,502円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	68,983,578円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	45,540,068円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	104,193,059円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	33,020,764円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	21,739,889円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	79,084,232円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	124,065,397円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	9,459,055円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	23,768,100円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	15,321,018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＞	2,341,294,117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＞	737,710,826円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	120,185,798円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,100,173,191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＞	1,679,976,562円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	5,272,263,603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＞	8,795,241,360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）	345,889,060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＞	110,155,429円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	454,726,492円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	120,646,991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＞	1,117,480,487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＞	793,807,908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＞	1,093,960,390円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	3,262,823,790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＞	52,198,733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＞	837,661,929円
合計	84,438,755,498円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.125	1,800,000.00	1,799,085.94	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,289,585.95	
		US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,978,750.00	
		US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,679,738.26	
		US TREASURY N/B 0.125	7,700,000.00	7,653,980.48	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,005,664.05	
		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,706,316.38	
		US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	2,997,187.50	
		US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,353,781.25	
		US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,232,066.39	
		US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,953,906.26	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,965,195.32	
		US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,959,296.88	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,934,843.75	
		US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,456,921.87	
		US TREASURY N/B 0.375	7,800,000.00	7,368,562.50	
		US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,491,562.50	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,883,750.00	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,876,601.57	
		US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,212,656.27	
		US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,454,941.41	
		US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	957,187.50	
		US TREASURY N/B 0.625	3,200,000.00	3,058,750.01	
		US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	6,865,429.72	
		US TREASURY N/B 0.625	9,800,000.00	8,933,695.28	
		US TREASURY N/B 0.75	6,700,000.00	6,449,273.47	
		US TREASURY N/B 0.875	7,000,000.00	6,512,734.39	
		US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,529,003.91	
		US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,000,390.62	
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,325,273.45	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,069,960.93	

		US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	3,908,472.66	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,073,593.76	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,066,328.14	
		US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	512,675.78	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,567,871.10	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,082,968.75	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,029,179.69	
		US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,651,085.94	
		US TREASURY N/B 1.375	4,900,000.00	3,880,953.12	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,567,539.08	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,074,296.89	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,077,109.39	
		US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,068,203.12	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,539,492.19	
		US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,022,265.63	
		US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,467,128.89	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,040,312.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,469,859.39	
		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	3,087,187.50	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,090,585.93	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,103,828.14	
		US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,486,531.25	
		US TREASURY N/B 1.625	4,550,000.00	4,709,072.27	
		US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,025,835.95	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,093,398.43	
		US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,490,154.30	
		US TREASURY N/B 1.625	3,200,000.00	2,705,250.00	
		US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,828,546.88	
		US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,441,250.00	
		US TREASURY N/B 1.75	1,600,000.00	1,628,875.00	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,055,429.68	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,059,062.50	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,070,429.68	

		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,084,960.93	
		US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,786,484.37	
		US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,298,734.43	
		US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	886,125.00	
		US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,489,625.00	
		US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,067,343.76	
		US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,034,140.62	
		US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,055,429.68	
		US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,059,648.43	
		US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,738,648.44	
		US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,914,937.48	
		US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,080,039.07	
		US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,884,515.63	
		US TREASURY N/B 1.875	1,400,000.00	1,465,679.68	
		US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,347,124.99	
		US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	539,296.87	
		US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,072,890.64	
		US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,600,078.12	
		US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,149,804.70	
		US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,927,062.50	
		US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,097,890.62	
		US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,463,710.95	
		US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,625,878.90	
		US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,686,894.54	
		US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,533,812.50	
		US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,255,273.45	
		US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,597,000.00	
		US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,554,785.15	
		US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,072,890.64	
		US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,133,906.24	
		US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,249,914.07	
		US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,101,953.12	
		US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,836,679.72	
		US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,693,183.58	
		US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,224,218.76	

		US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,902,445.30	
		US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,188,449.23	
		US TREASURY N/B 2.125	900,000.00	953,648.44	
		US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,392,886.70	
		US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,157,500.00	
		US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,318,250.00	
		US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,014,343.75	
		US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,591,523.44	
		US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,685,136.70	
		US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,293,992.20	
		US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,262,812.52	
		US TREASURY N/B 2.25	5,800,000.00	6,182,890.65	
		US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,683,593.77	
		US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,464,468.75	
		US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,671,906.27	
		US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,807,472.67	
		US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,430,957.04	
		US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,247,531.25	
		US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,915,496.10	
		US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,955,906.26	
		US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,253,144.51	
		US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,226,156.25	
		US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	1,915,734.37	
		US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,264,062.50	
		US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,068,941.39	
		US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,645,039.05	
		US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,146,871.10	
		US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,245,101.58	
		US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	2,997,761.72	
		US TREASURY N/B 2.5	3,600,000.00	3,720,515.61	
		US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,183,593.76	
		US TREASURY N/B 2.625	1,900,000.00	2,019,046.87	
		US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,479,687.50	
		US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,765,578.13	
		US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,926,335.95	

		US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,106,660.16	
		US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,051,230.47	
		US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,054,062.50	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,115,390.62	
		US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,026,515.64	
		US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,468,242.19	
		US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,449,230.45	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,164,921.88	
		US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	4,991,718.75	
		US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,281,617.19	
		US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,251,125.02	
		US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,172,656.26	
		US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	325,429.68	
		US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,116,320.32	
		US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,626,210.94	
		US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,065,976.56	
		US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,135,625.00	
		US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,396,195.31	
		US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,199,000.00	
		US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,734,375.00	
		US TREASURY N/B 2.875	5,000,000.00	5,515,039.05	
		US TREASURY N/B 2.875	3,800,000.00	4,193,507.82	
		US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,656,593.74	
		US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,092,835.95	
		US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,987,281.26	
		US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,557,226.56	
		US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,392,968.76	
		US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,407,093.75	
		US TREASURY N/B 3	800,000.00	904,187.50	
		US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	3,951,582.04	
		US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,388,593.75	
		US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,055,218.75	
		US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,834,667.97	
		US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,495,195.31	
		US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,520,800.78	

	US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,139,335.92	
	US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,326,359.39	
	US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,713,023.44	
	US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,266,289.06	
	US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,153,046.88	
	US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,647,246.08	
	US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	3,803,121.10	
	US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,789,156.25	
	US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,596,718.75	
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,772,312.50	
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	968,750.00	
	US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	2,979,843.74	
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,479,468.76	
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,885,546.87	
	US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	885,964.84	
	US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	637,031.25	
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,326,484.38	
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	801,656.25	
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	667,070.31	
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	944,671.87	
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,894,703.13	
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	408,070.31	
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	999,667.97	
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	270,804.68	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,367,656.25	
	US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	835,171.87	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,131,875.00	
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	707,656.25	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	639,062.50	
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	429,850.00	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	644,843.75	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,244,218.75	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,310,390.63	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	912,687.50	
米ドル 小計		629,370,000.00	656,464,717.54	

			(71,935,403,748)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,005,400.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	590,982.00	
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,033,090.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,292,031.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	3,400,000.00	3,338,494.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,052,340.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,030,950.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	2,976,995.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,130,679.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,247,064.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,900,000.00	1,999,674.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,051,800.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,486,548.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,177,374.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,230,599.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,852,380.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,296,471.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	619,435.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,709,266.00	
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,049,225.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,117,072.50	
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	334,572.50	
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	724,455.00	
カナダドル 小計		34,400,000.00	37,346,897.00	
			(3,254,035,135)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,865,920.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	20,008,400.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	28,000,000.00	28,569,962.40	
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	26,931,845.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,498,796.20	
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	19,244,469.60	
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	28,969,380.00	
	MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,177,150.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	26,150,436.50	

	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	44,391,588.00	
メキシコペソ 小計		224,000,000.00	242,807,947.70	
			(1,319,564,072)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	719,045.00	
	BELGIAN 0.1	700,000.00	713,125.00	
	BELGIAN 0.4	300,000.00	292,875.00	
	BELGIAN 0.8	800,000.00	846,472.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,075,720.00	
	BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,080,830.00	
	BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,555,499.00	
	BELGIAN 0304 5	1,400,000.00	2,318,750.00	
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,046,468.00	
	BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	876,806.00	
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,822,995.00	
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,596,690.00	
	BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,539,637.00	
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	956,984.00	
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,039,430.00	
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	713,680.00	
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	466,644.00	
	BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,418,144.00	
	BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	616,730.00	
	BELGIAN 0353 0.65	400,000.00	342,020.00	
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,509,662.00	
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,104,480.00	
	BELGIAN 1.25	400,000.00	455,056.00	
	BELGIAN 1.6	850,000.00	1,021,419.50	
	BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,245,190.00	
	BELGIAN 2.15	500,000.00	717,515.00	
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,350,120.00	
	BTPS 0.35	2,700,000.00	2,745,684.00	
	BTPS 0.5	1,000,000.00	1,021,530.00	
	BTPS 0.65	2,000,000.00	2,046,900.00	
	BTPS 0.85	1,700,000.00	1,763,461.00	
	BTPS 0.9	2,250,000.00	2,287,732.50	
	BTPS 0.9	1,200,000.00	1,219,200.00	

BTPS 0.95	2,000,000.00	2,049,020.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,050,020.00	
BTPS 0.95	800,000.00	832,952.00	
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,847,592.00	
BTPS 1	1,000,000.00	1,017,670.00	
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,015,660.00	
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,697,104.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,035,660.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,052,240.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,902,384.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,061,230.00	
BTPS 1.45	600,000.00	623,958.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,873,799.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,292,148.00	
BTPS 1.65	1,200,000.00	1,306,176.00	
BTPS 1.65	1,800,000.00	1,955,484.00	
BTPS 1.7	500,000.00	495,430.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,063,360.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,079,020.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,419,626.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,776,896.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,665,990.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,103,890.00	
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,573,769.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,380,024.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,288,386.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,049,679.00	
BTPS 2.5	600,000.00	657,210.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,340,093.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,892,364.00	
BTPS 2.8	300,000.00	352,674.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,095,318.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,630,681.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,197,305.00	
BTPS 3.1	900,000.00	1,152,864.00	

BTPS 3.25	1,500,000.00	2,003,070.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,095,845.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,940,148.00	
BTPS 3.5	4,900,000.00	6,124,559.00	
BTPS 3.75	1,500,000.00	1,699,020.00	
BTPS 3.85	900,000.00	1,334,385.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,630,224.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,529,517.00	
BTPS 4.5	1,000,000.00	1,136,290.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,190,456.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,794,000.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,625,500.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,596,448.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,197,930.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,084,589.80	
BTPS 5	1,800,000.00	2,868,264.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,732,104.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,297,668.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,181,840.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,619,479.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,323,760.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,380,238.00	
BTPS 7.25	400,000.00	556,880.00	
BTPS 9	300,000.00	371,085.00	
BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,598,525.00	
BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,021,180.00	
BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,928,215.00	
BUNDESOBL-178 0	1,600,000.00	1,629,904.00	
BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,328,704.00	
BUNDESOBL-180 0	1,100,000.00	1,127,830.00	
BUNDESOBL-182 0	1,800,000.00	1,855,116.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,482,320.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,623,515.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,344,096.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,500,000.00	1,547,805.00	

		DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	302,262.00	
		DEUTSCHLAND REP 0	2,300,000.00	2,131,893.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	3,992,470.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,062,719.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,007,692.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,618,225.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	1,900,000.00	2,008,566.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,635,178.00	
		DEUTSCHLAND REP 0.5	2,100,000.00	2,251,725.00	
		DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,376,258.00	
		DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,202,581.50	
		DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,100,483.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,186,793.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,361,139.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,139,820.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,266,660.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,357,938.00	
		DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,129,720.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,407,778.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.5	2,500,000.00	3,951,875.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,008,968.00	
		DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	2,960,334.00	
		DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,690,192.50	
		DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,225,040.00	
		DEUTSCHLAND REP 4.75	2,000,000.00	3,325,020.00	
		DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,156,813.00	
		DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,424,151.00	
		DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,425,510.00	
		DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,432,032.00	
		DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	798,535.00	
		DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,452,390.00	
		FINNISH GOV'T 0	400,000.00	402,760.00	
		FINNISH GOV'T 0.125	300,000.00	295,842.00	
		FINNISH GOV'T 0.25	300,000.00	294,825.00	
		FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	425,012.00	

FINNISH GOV'T 0.5		800,000.00	849,848.00	
FINNISH GOV'T 0.75		500,000.00	543,020.00	
FINNISH GOV'T 1.125		200,000.00	226,496.00	
FINNISH GOV'T 1.375		300,000.00	371,106.00	
FINNISH GOV'T 1.5		1,000,000.00	1,044,320.00	
FINNISH GOV'T 1.625		1,000,000.00	1,033,240.00	
FINNISH GOV'T 2		600,000.00	648,684.00	
FINNISH GOV'T 2.625		500,000.00	735,335.00	
FINNISH GOV'T 2.75		600,000.00	737,382.00	
FINNISH GOV'T 4		1,000,000.00	1,197,610.00	
FRANCE O.A.T. 0		2,200,000.00	2,216,478.00	
FRANCE O.A.T. 0		2,000,000.00	2,025,980.00	
FRANCE O.A.T. 0		4,000,000.00	4,074,960.00	
FRANCE O.A.T. 0		1,200,000.00	1,227,252.00	
FRANCE O.A.T. 0		2,100,000.00	2,149,938.00	
FRANCE O.A.T. 0		4,500,000.00	4,550,805.00	
FRANCE O.A.T. 0		2,900,000.00	2,909,425.00	
FRANCE O.A.T. 0.25		2,900,000.00	3,013,042.00	
FRANCE O.A.T. 0.5		900,000.00	727,713.00	
FRANCE O.A.T. 0.5		2,900,000.00	3,028,470.00	
FRANCE O.A.T. 0.5		3,500,000.00	3,677,100.00	
FRANCE O.A.T. 0.5		2,800,000.00	2,957,164.00	
FRANCE O.A.T. 0.75		2,500,000.00	2,686,775.00	
FRANCE O.A.T. 0.75		3,200,000.00	3,443,648.00	
FRANCE O.A.T. 0.75		1,500,000.00	1,468,635.00	
FRANCE O.A.T. 1		2,050,000.00	2,196,513.50	
FRANCE O.A.T. 1		2,500,000.00	2,715,275.00	
FRANCE O.A.T. 1.25		2,700,000.00	3,063,231.00	
FRANCE O.A.T. 1.25		2,400,000.00	2,729,640.00	
FRANCE O.A.T. 1.5		3,850,000.00	4,439,935.50	
FRANCE O.A.T. 1.5		2,400,000.00	2,850,792.00	
FRANCE O.A.T. 1.75		4,200,000.00	4,415,964.00	
FRANCE O.A.T. 1.75		2,600,000.00	2,823,470.00	
FRANCE O.A.T. 1.75		2,400,000.00	2,957,424.00	
FRANCE O.A.T. 1.75		800,000.00	1,043,432.00	

FRANCE O.A.T. 2		2,200,000.00	2,891,922.00	
FRANCE O.A.T. 2.25		1,900,000.00	1,985,652.00	
FRANCE O.A.T. 2.25		3,400,000.00	3,708,176.00	
FRANCE O.A.T. 2.5		3,500,000.00	4,337,305.00	
FRANCE O.A.T. 2.75		3,850,000.00	4,643,639.00	
FRANCE O.A.T. 3		4,000,000.00	4,151,680.00	
FRANCE O.A.T. 3.25		1,700,000.00	2,697,577.00	
FRANCE O.A.T. 3.5		2,500,000.00	3,009,925.00	
FRANCE O.A.T. 4		2,000,000.00	3,228,700.00	
FRANCE O.A.T. 4		1,370,000.00	2,659,539.90	
FRANCE O.A.T. 4		1,400,000.00	2,845,990.00	
FRANCE O.A.T. 4.25		4,000,000.00	4,503,160.00	
FRANCE O.A.T. 4.5		2,600,000.00	4,597,008.00	
FRANCE O.A.T. 4.75		2,200,000.00	3,583,668.00	
FRANCE O.A.T. 5.5		2,750,000.00	4,030,290.00	
FRANCE O.A.T. 5.75		2,100,000.00	3,480,813.00	
FRANCE O.A.T. 6		3,000,000.00	3,905,190.00	
FRANCE O.A.T. 8.5		600,000.00	712,698.00	
IRISH GOVT 0		400,000.00	403,828.00	
IRISH GOVT 0.9		700,000.00	759,164.00	
IRISH GOVT 1		1,000,000.00	1,075,180.00	
IRISH GOVT 1.1		1,600,000.00	1,764,080.00	
IRISH GOVT 1.3		600,000.00	682,248.00	
IRISH GOVT 1.35		500,000.00	567,590.00	
IRISH GOVT 1.5		400,000.00	476,272.00	
IRISH GOVT 1.7		300,000.00	362,613.00	
IRISH GOVT 2		1,000,000.00	1,308,320.00	
IRISH GOVT 2.4		600,000.00	736,422.00	
IRISH GOVT 3.4		500,000.00	558,915.00	
IRISH GOVT 3.9		500,000.00	544,030.00	
IRISH GOVT 5.4		800,000.00	988,232.00	
NETHERLANDS GOVT 0		1,000,000.00	1,019,600.00	
NETHERLANDS GOVT 0		1,900,000.00	1,940,869.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25		1,900,000.00	1,972,124.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25		500,000.00	523,540.00	

		NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,796,305.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.5	800,000.00	848,320.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	1,300,000.00	1,400,854.00	
		NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,083,980.00	
		NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,689,968.00	
		NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,088,680.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,555,590.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,306,420.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	1,951,188.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	755,426.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,248,181.00	
		NETHERLANDS GOVT 4	1,600,000.00	2,591,392.00	
		NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	984,865.00	
		REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,621.00	
		REP OF AUSTRIA 0	900,000.00	912,384.00	
		REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	846,632.00	
		REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	901,731.00	
		REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	962,217.00	
		REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	754,096.00	
		REP OF AUSTRIA 0.75	800,000.00	842,528.00	
		REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	143,851.50	
		REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,081,110.00	
		REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	272,142.00	
		REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	873,299.00	
		REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,190,057.00	
		REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,061,420.00	
		REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,171,368.00	
		REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	968,496.00	
		REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,172,655.00	
		REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,044,040.00	
		REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,492,239.00	
		REP OF AUSTRIA 4.15	1,000,000.00	1,621,850.00	
		REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	635,445.00	
		REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,425,050.00	
		SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,013,650.00	

		SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,022,270.00	
		SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,019,740.00	
		SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	507,820.00	
		SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,021,520.00	
		SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	421,832.00	
		SPANISH GOV'T 1	300,000.00	276,393.00	
		SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	515,030.00	
		SPANISH GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,173,640.00	
		SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,924,640.00	
		SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,194,300.00	
		SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,757,872.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	400,000.00	362,900.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,854,098.00	
		SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,201,948.00	
		SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,318,368.00	
		SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,835,218.00	
		SPANISH GOV'T 1.85	2,400,000.00	2,764,512.00	
		SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,889,718.00	
		SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,960,440.00	
		SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,670,528.00	
		SPANISH GOV'T 2.35	1,300,000.00	1,573,949.00	
		SPANISH GOV'T 2.7	1,550,000.00	2,068,382.00	
		SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,336,880.00	
		SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,920,814.00	
		SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,733,347.00	
		SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,582,798.00	
		SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,487,292.50	
		SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,251,780.00	
		SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,188,062.00	
		SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,511,720.00	
		SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,722,930.00	
		SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,542,275.00	
		SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,072,115.00	
		SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,196,468.00	
		SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,491,852.50	

	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,375,685.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	662,545.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,207,182.00	
ユーロ 小計		429,490,000.00	509,822,857.70 (66,491,097,101)	
英ポンド	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	700,987.00	
	UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,483,335.00	
	UK TSY GILT 0.375	1,000,000.00	958,920.00	
	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,811,574.00	
	UK TSY GILT 0.625	1,700,000.00	1,726,622.00	
	UK TSY GILT 0.625	500,000.00	465,960.00	
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,691,817.00	
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,012,030.00	
	UK TSY GILT 1	1,600,000.00	1,642,192.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,200,000.00	1,255,548.00	
	UK TSY GILT 1.25	700,000.00	697,060.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,058,370.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,773,287.00	
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	658,157.50	
	UK TSY GILT 1.625	1,900,000.00	2,041,512.00	
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	546,715.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,229,268.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,900,000.00	2,060,322.00	
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	828,262.50	
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,183,578.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,841,993.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,318,688.00	
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,414,400.00	
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,218,624.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,395,470.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,675,061.50	
	UK TSY GILT 3.75	1,200,000.00	1,963,128.00	
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,166,250.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,368,444.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,217,295.00	

	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,504,177.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,450,000.00	2,183,961.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,986,829.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,462,565.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,538,145.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,135,395.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,577,422.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,176,564.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,572,648.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,888,944.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,541,345.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	909,415.00	
英ポンド 小計		54,800,000.00	69,882,281.50	
			(10,522,873,948)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,178,080.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,169,520.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	6,400,000.00	6,769,152.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,326,970.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,550,250.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,348,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,759,930.00	
スウェーデンクローナ 小計		39,000,000.00	43,102,542.00	
			(550,419,461)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	1,994,460.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,582,495.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,101,430.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,787,993.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,190,320.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,467,640.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,267,320.00	
ノルウェークローネ 小計		30,200,000.00	31,391,658.00	
			(404,952,388)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,229,540.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	11,100,000.00	11,693,850.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,224,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,260,000.00	

	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,610,200.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	18,704,700.00	
デンマーククローネ 小計		37,900,000.00	47,722,290.00	
			(837,048,966)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	6,000,000.00	5,999,069.73	
	POLAND GOVT BOND 1.25	1,800,000.00	1,754,064.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,900,000.00	5,111,043.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	1,066,060.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,258,330.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,271,410.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	5,900,000.00	6,536,964.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,665,141.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,598,240.00	
ポーランドズロチ 小計		34,900,000.00	37,260,321.73	
			(1,071,975,730)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	900,000.00	886,049.10	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	3,300,000.00	3,226,740.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	600,000.00	486,343.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,552,080.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,212,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,454,895.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,699,995.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,768,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,990,953.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,300,000.00	3,632,310.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	863,680.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,501,924.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,113,940.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,395,680.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	2,870,025.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,449,156.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,117,725.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,796,340.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,600,000.00	1,956,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	1,400,000.00	1,552,810.00	

		AUSTRALIAN GOVT. 5.75	1,500,000.00	1,606,500.00	
	オーストラリアドル 小計		38,350,000.00	42,133,645.50	
				(3,513,946,034)	
	シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,039,855.00	
		SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	434,520.00	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,258,560.00	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	448,080.00	
		SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	789,600.00	
		SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	444,728.00	
		SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	754,600.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	829,840.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	760,175.00	
		SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,696,650.00	
	シンガポールドル 小計		7,750,000.00	8,456,608.00	
				(691,243,137)	
	マレーシアリンギット	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,131,380.90	
		MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,201,134.57	
		MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,602,569.58	
		MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,516,516.50	
		MALAYSIA GOVT 4.736	4,500,000.00	4,681,977.30	
	マレーシアリンギット 小計		29,700,000.00	31,133,578.85	
				(825,223,527)	
	イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.75	6,200,000.00	6,256,668.00	
		ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	2,997,991.00	
		ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,651,305.00	
		ISRAEL FIXED 3.75	3,700,000.00	4,845,372.00	
		ISRAEL FIXED 6.25	5,000,000.00	6,554,200.00	
	イスラエルシュケル 小計		19,300,000.00	22,305,536.00	
				(741,201,808)	
合計				162,158,985,055	
				(162,158,985,055)	

（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	43.9%	44.4%

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	40.6%	41.0%
英ポンド	国債証券	42銘柄	6.4%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	9銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	2.1%	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%
イスラエルシュケル	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

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2020年 4月13日現在）	（2021年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	460,340,439	353,667,650
コール・ローン	320,005,783	183,291,158
国債証券	-	220,025,960
特殊債券	1,854,685,360	1,517,370,344
未収利息	5,508,528	3,234,062
前払費用	1,425,751	-
流動資産合計	2,641,965,861	2,277,589,174
資産合計	2,641,965,861	2,277,589,174
負債の部		
流動負債		
未払解約金	470,000	1,200,000
未払利息	867	502
その他未払費用	79,949	4,950
流動負債合計	550,816	1,205,452
負債合計	550,816	1,205,452
純資産の部		
元本等		
元本	2,617,198,028	2,257,314,469
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	24,217,017	19,069,253
元本等合計	2,641,415,045	2,276,383,722

純資産合計	2,641,415,045	2,276,383,722
負債純資産合計	2,641,965,861	2,277,589,174

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 　金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 　金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 　直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2020年 4月13日現在）	（2021年 4月13日現在）
1．　当計算期間の末日における受益権の総数	2,617,198,028口	2,257,314,469口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0093円 (10,000口当たりの純資産額　10,093円)	1口当たり純資産額　1.0084円 (10,000口当たりの純資産額　10,084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14日 至 2021年 4月13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、特殊債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
３.金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。
４.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2021年 4月13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、特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 4月14日 至 2021年 4月13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13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	2,470,784,621円
同期中における追加設定元本額	1,387,344,474円
同期中における一部解約元本額	1,240,931,067円
2020年 4月13日現在における元本の内訳	
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	13,868,252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）	94,104,342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）	75,050,091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）	17,362,669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）	22,920,681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）	12,836,318円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	27,309,935円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	782,308,395円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	468,868,961円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,102,171,872円
合計	2,617,198,028円

（2021年 4月13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	2,617,198,028円
同期中における追加設定元本額	1,166,758,748円
同期中における一部解約元本額	1,526,642,307円
2021年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	100,839,042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）	116,052,823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）	47,825,996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）	32,545,911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）	20,369,659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）	38,075,492円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	890,895,719円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	164,438,276円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	845,875,039円
合計	2,257,314,469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９６９回国庫短期証券	20,000,000	20,001,460	
	第９７０回国庫短期証券	100,000,000	100,009,300	
	第９７６回国庫短期証券	100,000,000	100,015,200	
国債証券合計		220,000,000	220,025,960	
特殊債券	第１４回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	201,678,000	
	第１５回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,396,000	
	第１３５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,146,000	
	第１３７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,518,000	
	第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,658,000	
	第１４２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,600,000	210,415,344	
	第１５２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,790,000	
	第２５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,412,000	
	第３０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,600,000	
	第１９回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,757,000	
特殊債券合計		1,509,600,000	1,517,370,344	
合計			1,737,396,304	

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。

【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14期中間計算期間（2021年 4月14日から2021年10月13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。

【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）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2021年 4月13日現在）	第14期中間計算期間 （2021年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	894,163	48,778
コール・ローン	463,407	1,363,408
親投資信託受益証券	192,391,161	198,753,555
未収入金	2,410,000	-
流動資産合計	196,158,731	200,165,741
資産合計	196,158,731	200,165,741
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,324,116	-
未払受託者報酬	32,348	32,653
未払委託者報酬	194,038	195,883
未払利息	1	-
その他未払費用	5,331	5,428
流動負債合計	2,555,834	233,964
負債合計	2,555,834	233,964
純資産の部		
元本等		
元本	146,803,656	150,776,704
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	46,799,241	49,155,073
（分配準備積立金）	17,610,652	16,452,200
元本等合計	193,602,897	199,931,777
純資産合計	193,602,897	199,931,777
負債純資産合計	196,158,731	200,165,741

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自　2020年 4月14日 至　2020年10月13日	第14期中間計算期間 自　2021年 4月14日 至　2021年10月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,559,934	1,312,394
営業収益合計	4,559,934	1,312,394
営業費用		
支払利息	352	433
受託者報酬	34,079	32,653
委託者報酬	204,405	195,883
その他費用	5,819	5,483
営業費用合計	244,655	234,452
営業利益又は営業損失（△）	4,315,279	1,077,942
経常利益又は経常損失（△）	4,315,279	1,077,942
中間純利益又は中間純損失（△）	4,315,279	1,077,942
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（△）	211,103	39,326
期首剰余金又は期首欠損金（△）	42,450,868	46,799,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,192,995	4,538,374
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,192,995	4,538,374
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,810,025	3,221,158
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,810,025	3,221,158
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	45,938,014	49,155,073

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第14期中間計算期間 自 2021年4月14日 至 2021年10月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項　目	第13期 （2021年4月13日現在）	第14期中間計算期間 （2021年10月13日現在）
１．当中間計算期間の末日における受益権の総数	146,803,656口	150,776,704口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.3188円 （１万口当たりの純資産額13,188円）	1口当たり純資産額　1.3260円 （１万口当たりの純資産額13,260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14期中間計算期間 （2021年10月13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13期 （2021年4月13日現在）	第14期中間計算期間 （2021年10月13日現在）
期首元本額	160,588,854円	146,803,656円
期中追加設定元本額	16,974,194円	14,074,340円
期中一部解約元本額	30,759,392円	10,101,292円

(参考)

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要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。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,169,715,889	118,602,529
コール・ローン	605,779,870	3,315,071,351
株式	191,803,100,950	192,366,916,710
派生商品評価勘定	5,553,800	7,019,800
未収入金	1,085,600	-
未収配当金	1,738,508,396	1,630,582,121
前払金	7,000,000	151,501,000
差入委託証拠金	3,460,000	217,800,000
流動資産合計	195,334,204,505	197,807,493,511
資産合計	195,334,204,505	197,807,493,511
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,745,200	161,257,700
未払金	-	2,829,300
未払解約金	62,155,249	5,884,074
未払利息	1,659	-
その他未払費用	15,207	48,962
流動負債合計	74,917,315	170,020,036
負債合計	74,917,315	170,020,036

純資産の部		
元本等		
元本	60,307,285,983	59,950,367,113
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	134,952,001,207	137,687,106,362
元本等合計	195,259,287,190	197,637,473,475
純資産合計	195,259,287,190	197,637,473,475
負債純資産合計	195,334,204,505	197,807,493,511

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2021年10月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
１．担保資産	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券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　3,402,800,000円	――――――
２．当計算期間の末日における受益権の総数	60,307,285,983口	59,950,367,113口

３．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　3.2377円 （１万口当たりの純資産額32,377円）	1口当たり純資産額　3.2967円 （１万口当たりの純資産額32,967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13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）

（2021年4月13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				
	TOPIX先物	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
	小計	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
合　計		3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400

（2021年10月13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				
	TOPIX 先物 0312月	5,360,317,900	-	5,206,080,000	△154,237,900
	小計	5,360,317,900	-	5,206,080,000	△154,237,900
合　計		5,360,317,900	-	5,206,080,000	△154,237,900

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物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）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おります。

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。

（その他の注記）

（2021年4月13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	66,999,567,497円
同期中における追加設定元本額	10,234,596,277円
同期中における一部解約元本額	16,926,877,791円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,403,817,844円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	874,307,630円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,236,443,718円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,147,333,103円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	140,818,938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）	4,731,866円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	21,315,752円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	62,804,297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）	128,333,283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）	101,569,258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）	197,544,642円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,143,235,519円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	15,940,892,855円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	453,355,694円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	484,073,352円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	312,771,346円
イオン・バランス戦略ファンド	55,063,082円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	22,865,709円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	126,712,529円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	108,999,096円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	355,046,751円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	180,069,347円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	206,194,976円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	23,499,186円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	215,426,585円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,380,243円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	50,121,313円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	46,060,070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）	3,060,853,074円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,670,796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＞	2,117,411,933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＞	783,916,156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＞	882,228,687円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	687,469,840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＞	367,759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＞	35,682,955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＞	134,126,377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＞	72,459,636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＞	291,264,191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＞	735,634,579円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	74,013,645円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	20,287,354円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６ー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＞	429,758,704円
合　計	60,307,285,983円

（2021年10月13日現在）

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	60,307,285,983円
同期中における追加設定元本額	5,175,819,504円
同期中における一部解約元本額	5,532,738,374円
2021年10月13日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,428,532,258円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	891,970,232円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,247,031,852円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,228,005,862円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	166,236,968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）	4,560,768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）	20,314,364円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	62,321,606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）	138,972,200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）	117,696,146円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	215,133,814円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,370,903,899円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	17,717,087,922円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	197,868,947円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	248,309,687円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	166,055,513円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	28,367,994円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	150,469,435円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	137,139,470円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	456,061,979円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	239,515,269円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	271,353,689円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	31,065,063円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	407,996,024円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	13,939,443円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	67,617,788円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	65,931,697円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,924,049円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	27,940,910円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	1,444,089円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,867,299,556円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	15,887,702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＞	108,824,691円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,881,732,739円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,644,673,815円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,331,331,381円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	41,040,556円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	166,358,728円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	734,397,237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＞	44,845,419円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	259,277,705円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	838,309,870円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	603,057,669円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,898,722,676円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	362,979円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	42,261,700円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	47,977,824円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	33,571,985円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	16,372,056円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	116,831,131円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	250,266,977円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	64,043,908円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	39,574,438円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	7,257,195円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	45,511,926円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	615,764,141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）	179,678,902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＞	237,022,466円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	114,606,601円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	293,857,380円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	68,313,365円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	23,411,291円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６ー０４＜適格機関投資家限定＞	47,795,087円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	51,927,891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＞	94,429,189円
合　計	59,950,367,113円

外国株式インデックス・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,980,401,795	4,811,576,085
金銭信託	1,160,138,477	7,632,548
コール・ローン	601,251,271	213,338,125
株式	283,975,881,503	314,244,322,646
投資証券	6,632,679,127	7,669,802,784
派生商品評価勘定	67,211,947	4,706,299
未収入金	383,008	-
未収配当金	312,896,444	237,253,060
差入委託証拠金	1,307,692,251	2,334,791,361
流動資産合計	296,038,535,823	329,523,422,908
資産合計	296,038,535,823	329,523,422,908
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,068,399	157,527,647
前受金	65,838,580	-
未払解約金	390,760,813	99,095,376
未払利息	1,647	-
その他未払費用	3,865	7,580
流動負債合計	459,673,304	256,630,603
負債合計	459,673,304	256,630,603
純資産の部		
元本等		
元本	58,211,745,190	59,393,372,607
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	237,367,117,329	269,873,419,698
元本等合計	295,578,862,519	329,266,792,305
純資産合計	295,578,862,519	329,266,792,305
負債純資産合計	296,038,535,823	329,523,422,908

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2021年10月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式、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。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	58,211,745,190口	59,393,372,607口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　5.0776円 （１万口当たりの純資産額50,776円）	1口当たり純資産額　5.5438円 （１万口当たりの純資産額55,438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13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）
（2021年4月13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				
	SPMINI 2106	4,592,481,363	-	4,650,475,482	57,994,119
	SPI200 2106	186,653,370	-	188,352,645	1,699,275
	FTSE 2106	287,848,728	-	288,833,521	984,793
	DJ EUR 2106	980,286,606	-	985,446,999	5,160,393
	小計	6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580
合　計		6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580

（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				
	アメリカ・ドル	1,819,250,400	-	1,817,899,629	△1,350,771
	イギリス・ポンド	67,749,720	-	67,760,180	10,460
	イスラエル・シュケル	8,338,970	-	8,307,350	△31,620
	オーストラリア・ドル	50,940,280	-	50,873,685	△66,595
	カナダ・ドル	52,331,760	-	52,277,628	△54,132
	シンガポール・ドル	4,086,300	-	4,086,865	565
	スイス・フラン	55,755,930	-	55,771,231	15,301
	スウェーデン・クローナ	14,174,700	-	14,174,700	-
	デンマーク・クローネ	11,576,750	-	11,576,400	△350

	ニュージーランド・ドル	768,530	-	768,580	50
	ノルウェー・クローネ	3,742,570	-	3,741,000	△1,570
	ユーロ	294,957,980	-	294,752,440	△205,540
	香港・ドル	29,055,840	-	29,045,010	△10,830
	小計	2,412,729,730	-	2,411,034,698	△1,695,032
合　計		2,412,729,730	-	2,411,034,698	△1,695,032

（2021年10月13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				
	S&P 500 EMINI FUT DEC21	7,117,028,548	-	6,995,370,389	△121,658,159
	SPI 200 FUTURES DEC21	260,805,894	-	256,500,318	△4,305,576
	FTSE 100 IDX FUT DEC21	412,246,738	-	416,545,193	4,298,455
	EURO STOXX 50 DEC21	1,444,664,070	-	1,413,420,570	△31,243,500
	小計	9,234,745,250	-	9,081,836,470	△152,908,780
合　計		9,234,745,250	-	9,081,836,470	△152,908,780

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物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）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おります。

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。

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	1,217,615,721	-	1,217,682,247	66,526
	カナダ・ドル	61,900,332	-	61,904,140	3,808
	オーストラリア・ドル	61,629,050	-	61,626,090	△2,960
	香港・ドル	16,916,280	-	16,912,800	△3,480

	シンガポール・ドル	7,530,012	-	7,530,651	639
	ニュージーランド・ドル	1,573,428	-	1,573,448	20
	イギリス・ポンド	75,583,725	-	75,584,411	686
	イスラエル・シュケル	3,515,160	-	3,510,860	△4,300
	スイス・フラン	58,566,864	-	58,573,248	6,384
	デンマーク・クローネ	14,789,040	-	14,792,400	3,360
	ノルウェー・クローネ	2,654,920	-	2,655,700	780
	スウェーデン・クローナ	9,444,010	-	9,446,200	2,190
	ユーロ	170,294,150	-	170,307,930	13,780
	小計	1,702,012,692	-	1,702,100,125	87,433
合　計		1,702,012,692	-	1,702,100,125	87,433

（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います。

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13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	58,474,870,859円
同期中における追加設定元本額	16,974,480,468円
同期中における一部解約元本額	17,237,606,137円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	28,675,405,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	283,051,086円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,207,524,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	838,459,709円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	70,282,809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）	6,549,259円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	20,430,761円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	51,182,329円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	48,571,646円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５（４資産タイプ）	96,727,490円
外国株式指数ファンド	587,742,940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	9,008,165,638円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	264,170,743円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	278,944,246円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	174,748,649円
イオン・バランス戦略ファンド	62,925,621円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	13,540,485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）	79,483,815円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	251,680,503円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	124,835,202円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	142,461,893円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	31,309,522円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	182,400,691円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	3,651,079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）	11,796,950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）	28,095,372円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	784,383,935円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,116,828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＞	931,142,266円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,030,755,411円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	4,447,927,100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＞	602,644,828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＞	48,753,013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＞	587,698,333円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	443,142,590円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,029,197,056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）	252,196,472円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	91,962,063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＞	9,927,876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＞	29,806,757円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	77,183,276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＞	196,801,861円

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	82,054,599円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	2,543,269,267円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	160,265,042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＞	1,441,122,783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ー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＞	410,194,343円
合　計	58,211,745,190円

（2021年10月13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	58,211,745,190円
同期中における追加設定元本額	6,515,402,440円
同期中における一部解約元本額	5,333,775,023円

2021年10月13日現在の元本の内訳

三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	31,169,206,420円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	274,441,164円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,135,062,674円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	804,167,145円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	66,426,746円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	1,226,514円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	6,295,092円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	18,525,110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）	49,118,836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）	51,071,456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）	98,129,599円
外国株式指数ファンド	725,734,108円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・全海外株インデックスファンド	11,386,915,709円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	80,086,183円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	124,047,874円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	81,866,192円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	15,569,978円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	113,605,623円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	98,304,475円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	327,311,611円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	165,067,976円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	189,467,345円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	37,723,446円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	439,751,545円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	4,318,540円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	17,877,059円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	15,831,256円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,149,431円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	93,706,963円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	2,295,692円

日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	25,927,673円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	5,016,531円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	641,039,582円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	4,450,805円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	32,980,346円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	774,939,622円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	897,068,226円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,867,291,724円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	12,951,367円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	67,127,256円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	518,702,947円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	42,750,063円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	110,157,562円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	530,244,129円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	376,243,901円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	884,728,483円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	232,559円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	231,557,128円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	80,398,249円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	9,862,293円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	8,314,514円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	4,471,755円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	23,692,015円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	65,817,406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＞	147,811,617円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	68,493,967円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	971,409,893円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	133,441,405円
ＳＭＡＭ・外国株式インデックスファンドＳＡ＜適格機関投資家限定＞	1,044,221,401円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	15,868,060円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６ー０４＜適格機関投資家限定＞	33,420,807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＞	36,162,559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＞	131,275,000円
合　計	59,393,372,607円

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13日現在）	（2021年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	45,981,282	65,820,027
金銭信託	228,213,133	10,251,936
コール・ローン	118,273,326	286,552,892
国債証券	162,158,985,055	159,037,510,919

派生商品評価勘定	-	2,525
未収利息	1,125,045,179	1,044,333,955
前払費用	21,150,614	32,229,618
流動資産合計	163,697,648,589	160,476,701,872
資産合計	163,697,648,589	160,476,701,872
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	124,100
未払解約金	9,011,993	293,402,405
未払利息	324	-
その他未払費用	3,950	10,892
流動負債合計	9,016,267	293,537,397
負債合計	9,016,267	293,537,397
純資産の部		
元本等		
元本	84,438,755,498	80,968,356,022
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	79,249,876,824	79,214,808,453
元本等合計	163,688,632,322	160,183,164,475
純資産合計	163,688,632,322	160,183,164,475
負債純資産合計	163,697,648,589	160,476,701,872

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2021年10月13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13日現在）	（2021年10月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	84,438,755,498口	80,968,356,022口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9385円 （１万口当たりの純資産額19,385円）	1口当たり純資産額　1.9783円 （１万口当たりの純資産額19,783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13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13日現在）

該当事項はありません。

（2021年10月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契約額等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	251,160,047	-	251,194,002	△33,955
	イギリス・ポンド	29,000,252	-	28,997,727	2,525
	ユーロ	228,645,064	-	228,735,209	△90,145
	小計	508,805,363	-	508,926,938	△121,575
合　計		508,805,363	-	508,926,938	△121,575

（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います。

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13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	84,556,952,355円
同期中における追加設定元本額	11,304,078,309円
同期中における一部解約元本額	11,422,275,166円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	23,568,244,950円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	727,323,151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）	31,877,472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）	102,070,891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）	114,686,398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）	24,554,885円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	124,954,775円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	43,978,309円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	12,865,502円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	68,983,578円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	45,540,068円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	104,193,059円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	33,020,764円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	21,739,889円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	79,084,232円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	124,065,397円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	9,459,055円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	23,768,100円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	15,321,018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＞	2,341,294,117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＞	737,710,826円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	120,185,798円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,100,173,191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＞	1,679,976,562円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	5,272,263,603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＞	8,795,241,360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）	345,889,060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＞	110,155,429円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	454,726,492円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	120,646,991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＞	1,117,480,487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＞	793,807,908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＞	1,093,960,390円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	3,262,823,790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＞	52,198,733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ー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＞	837,661,929円
合　計	84,438,755,498円

（2021年10月13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	84,438,755,498円
同期中における追加設定元本額	4,029,145,921円
同期中における一部解約元本額	7,499,545,397円

2021年10月13日現在の元本の内訳

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	61,827,485円

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	45,801,161円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	108,173,497円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	30,472,337円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	15,019,126円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	105,129,423円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	206,320,600円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	12,105,900円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	33,037,411円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	22,659,256円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,248,880円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	7,994,540円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	3,363,143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＞	2,401,028,272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＞	44,105,389円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	7,686,163,675円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,662,135,140円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	10,797,838,885円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	35,392,217円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	93,650,011円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	726,938,426円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	117,631,749円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,068,564,548円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,431,714,372円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,591,548,923円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	5,006,251,721円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	622,437円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	8,405,511,194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）	338,329,765円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	150,359,802円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	84,688,309円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	34,472,321円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,926,289円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	101,237,873円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	436,390,472円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	112,773,770円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	40,181,590円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,263,229円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	1,073,075,999円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（標準型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	678,957,301円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（債券重視型）ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	999,642,200円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,363,095,353円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	431,327,205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＞	1,271,634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＞	96,394,462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＞	262,660,918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＞	284,345,711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＞	171,352,184円
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	24,446,060,031円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	764,239,328円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,130,657,396円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,130,128,398円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	114,066,579円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	7,016,735円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	31,266,962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）	101,905,491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）	212,968,747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）	143,536,043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）	245,007,206円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	25,220,928円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	60,371,045円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	81,937,511円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	56,724,347円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	16,253,170円
合　計	80,968,356,022円

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	271,148,043	15,409,318
コール・ローン	140,524,695	430,707,401
国債証券	105,477,475,540	109,948,309,520
地方債証券	8,542,550,820	9,892,588,909
特殊債券	11,582,718,565	10,992,818,283
社債券	4,045,168,000	5,544,516,800
未収入金	-	373,657,600
未収利息	230,194,166	220,739,828
前払費用	3,090,887	4,054,325
流動資産合計	130,292,870,716	137,422,801,984
資産合計	130,292,870,716	137,422,801,984
負債の部		
流動負債		
未払金	52,732,500	-
未払解約金	3,455,246	162,485,745
未払利息	384	-
その他未払費用	5,597	11,180
流動負債合計	56,193,727	162,496,925
負債合計	56,193,727	162,496,925

純資産の部		
元本等		
元本	102,034,101,931	107,307,766,856
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	28,202,575,058	29,952,538,203
元本等合計	130,236,676,989	137,260,305,059
純資産合計	130,236,676,989	137,260,305,059
負債純資産合計	130,292,870,716	137,422,801,984

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2021年10月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	102,034,101,931口	107,307,766,856口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2764円 （１万口当たりの純資産額12,764円）	1口当たり純資産額　1.2791円 （１万口当たりの純資産額12,791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13日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 　これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

　該当事項はありません。

（その他の注記）

（2021年4月13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	102,757,947,265円
同期中における追加設定元本額	23,130,574,048円
同期中における一部解約元本額	23,854,419,382円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	6,094,869,774円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	10,799,784,589円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,409,904,423円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	650,911,787円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	43,319,205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）	200,477,835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）	430,298,494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）	542,880,234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）	237,927,219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）	394,951,809円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	139,859,405円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,262,690,529円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	398,901,014円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,590,257円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	32,881,227円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,220,630,022円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	398,613,032円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	568,525,120円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	118,550,076円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	33,192,378円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	90,202,755円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	79,038,998円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	126,731,002円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	35,039,983円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,679,578円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,615,752,867円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	14,461,969,440円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,723,802,531円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	16,890,224,082円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	330,039,962円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	596,483,349円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	264,477,800円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	120,304,219円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,898,851,071円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,189,946,035円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,559,318,640円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	9,289,850,382円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	948,903円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,263,341,710円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	469,017,209円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	595,459,501円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	180,178,556円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,116,807円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,639,537,473円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,264,897,999円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	808,518,064円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	216,345,674円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	18,836,644円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	299,035,679円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,582,241,420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＞	344,315,421円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６ー０４＜適格機関投資家限定＞	907,783,289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＞	758,516,436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＞	3,372,540,023円
合　計	102,034,101,931円

（2021年10月13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	102,034,101,931円
同期中における追加設定元本額	10,812,702,254円
同期中における一部解約元本額	5,539,037,329円

2021年10月13日現在の元本の内訳

三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	6,414,431,017円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	11,365,248,611円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,580,691,605円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	662,451,662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）	44,501,518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）	197,157,579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）	470,371,090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）	679,073,726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）	320,519,128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）	462,518,938円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	146,124,168円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,523,302,649円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,185,930,120円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	490,449,639円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	41,485,741円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,666,534,828円

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	555,642,487円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	836,809,220円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	186,312,449円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	68,936,969円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	122,117,929円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	100,894,426円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	173,895,052円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	50,663,397円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,771,707円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,566,774,702円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	13,416,597,561円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,595,857,150円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	16,532,764,118円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	329,650,159円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	575,348,553円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	270,461,209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＞	119,571,982円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,869,233,651円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,201,700,349円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,430,959,271円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	8,921,401,325円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	964,528円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,243,309,282円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	464,224,085円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	565,882,895円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	178,863,776円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,132,304円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,514,920,347円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,208,912,524円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	741,492,749円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	205,849,205円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	19,071,373円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	283,836,316円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,448,025,652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＞	431,316,340円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６ー０４＜適格機関投資家限定＞	815,754,081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＞	884,607,526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＞	6,075,448,188円
合　計	107,307,766,856円

マネーインカム・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
資産の部		

流動資産		
金銭信託	353,667,650	17,090,578
コール・ローン	183,291,158	477,700,492
国債証券	220,025,960	-
特殊債券	1,517,370,344	1,574,371,080
未収利息	3,234,062	2,435,187
前払費用	-	21,945
流動資産合計	2,277,589,174	2,071,619,282
資産合計	2,277,589,174	2,071,619,282
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,200,000	-
未払利息	502	-
その他未払費用	4,950	13,021
流動負債合計	1,205,452	13,021
負債合計	1,205,452	13,021
純資産の部		
元本等		
元本	2,257,314,469	2,054,985,951
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	19,069,253	16,620,310
元本等合計	2,276,383,722	2,071,606,261
純資産合計	2,276,383,722	2,071,606,261
負債純資産合計	2,277,589,174	2,071,619,282

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2021年10月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2021年4月13日現在）	（2021年10月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	2,257,314,469口	2,054,985,951口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0084円 （１万口当たりの純資産額10,084円）	1口当たり純資産額　1.0081円 （１万口当たりの純資産額10,081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13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（特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（2021年4月13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	2,617,198,028円
同期中における追加設定元本額	1,166,758,748円
同期中における一部解約元本額	1,526,642,307円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	100,839,042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）	116,052,823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）	47,825,996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）	32,545,911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）	20,369,659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）	38,075,492円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	890,895,719円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	164,438,276円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	845,875,039円
合　計	2,257,314,469円

（2021年10月13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	**2,257,314,469円**
同期中における追加設定元本額	**557,186,875円**
同期中における一部解約元本額	**759,515,393円**
2021年10月13日現在の元本の内訳	
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	**14,876,525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）	**105,262,799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）	**161,611,658円**
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	**87,632,704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）	**39,607,382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）	**26,588,177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）	**44,353,462円**
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	**99,128円**
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	**297,384円**
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	**867,342,401円**
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	**707,314,331円**
合　計	**2,054,985,951円**

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）

2021年10月29日現在

Ⅰ　資産総額	**201,784,400円**
Ⅱ　負債総額	**20,769円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**201,763,631円**
Ⅳ　発行済口数	**151,584,215口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.3310円**
（１万口当たり純資産額）	**（13,310円）**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ　名義書換
該当事項はありません。
ロ　受益者名簿
作成しません。
ハ　受益者に対する特典
ありません。
ニ　受益権の譲渡および譲渡制限等
（イ）受益権の譲渡
ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
ｂ．上記ａの申請のある場合には、上記ａの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記ａの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
ｃ．上記ａの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件
譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
ホ　受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ　償還金

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

ト　質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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10月29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。

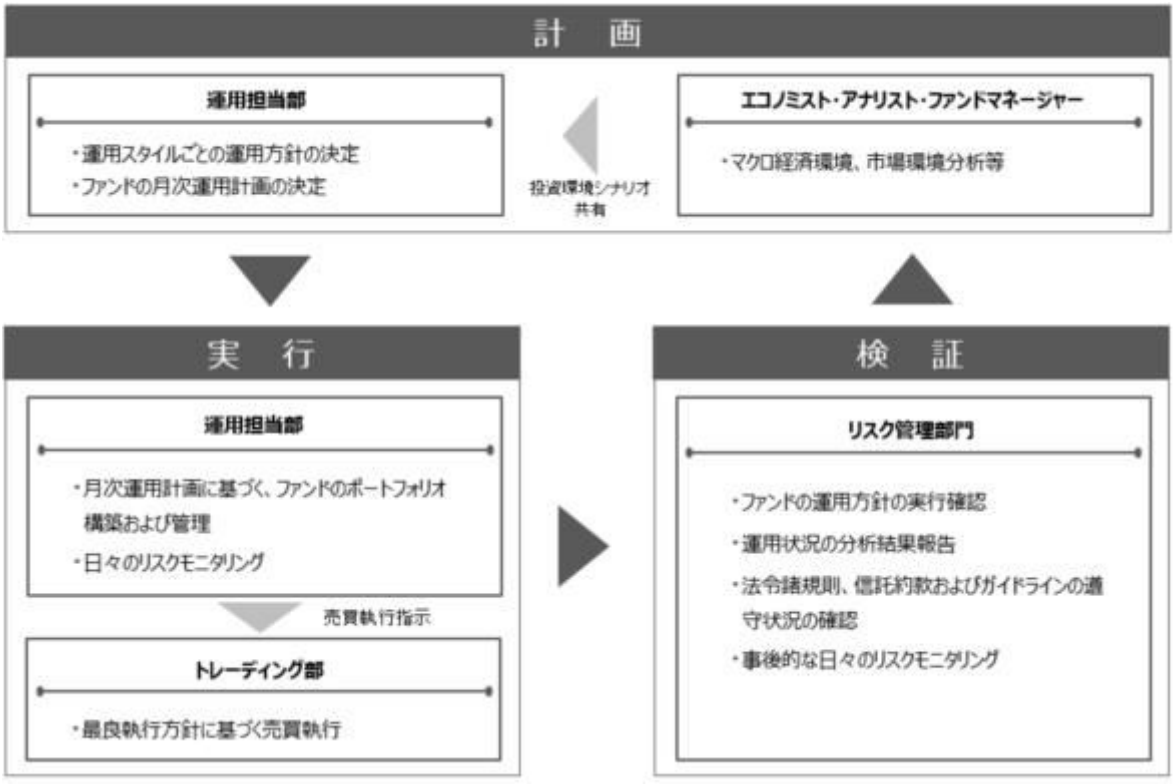
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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10月29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	739	9,622,767
単位型株式投資信託	104	568,472
追加型公社債投資信託	1	28,902
単位型公社債投資信託	190	434,766
合　計	1,034	10,654,909

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。

（単位：千円）

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

当事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

（単位：千円）

場所	用途	種類	減損損失
―	その他	のれん	28,097,346

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

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

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

※３　早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

※４　本社移転費用

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年４月１日　至 2020年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

２.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 2020年４月１日　至 2021年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	―	―	33,870,060株

２.剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

（借主側）

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

（単位：千円）

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

(金融商品関係)

１.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて１年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスクの管理

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

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

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

②市場リスクの管理

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

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

２.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれていません（（注２）参照）。

前事業年度（2020年３月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額

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

当事業年度（2021年３月31日）

（単位：千円）

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

(注１)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資　産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負　債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

(注２)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

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

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6)①その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2020年３月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2021年３月31日）

（単位：千円）

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,048,142	－	－	－
顧客分別金信託	300,036	－	－	－
未収委託者報酬	9,936,096	－	－	－
未収運用受託報酬	2,247,156	－	－	－
未収投資助言報酬	398,108	－	－	－
長期差入保証金	42,007	1,367,084	－	－
合計	45,971,548	1,367,084	－	－

(有価証券関係)

１.子会社株式

前事業年度（2020年３月31日）

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

当事業年度（2021年３月31日）

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

２.その他有価証券

前事業年度（2020年３月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2021年３月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,994,762	6,729,039	△265,723
小計	6,994,762	6,729,039	△265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

３.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年４月１日　至 2020年３月31日)

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

当事業年度(自 2020年４月１日　至 2021年３月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,978,622	162,941	34,473

（単位：千円）

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

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

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

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

(退職給付関係)

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
未認識数理計算上の差異	－	－
未認識過去勤務費用	－	－
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：千円）

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

(税効果会計関係)

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：千円）

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

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

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

	前事業年度 （2020年３月31日）	当事業年度 （2021年３月31日）
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため記載を省略しております。
（調整）		
評価性引当額の増減	3.5	
受取配当等永久に益金に算入されない項目	△13.9	
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	△0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	△3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2019年４月１日 至 2020年３月31日)

１.セグメント情報

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

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

２.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

(2)地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年４月１日 至2021年３月31日)

１.セグメント情報

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

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

２.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2)地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年４月１日　至 2020年３月31日)

１．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

（単位：千円）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2020年４月１日 至 2021年３月31日)

１．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

（単位：千円）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

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

(１株当たり情報)

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

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

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

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

	前事業年度 （自 2019年４月１日 至 2020年３月31日）	当事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）
１株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失（△）（千円）	578,811	△28,934,237
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失（△）（千円）	578,811	△28,934,237
期中平均株式数（株）	33,870,060	33,870,060

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	△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）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	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

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,269,607	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　　住友生命保険相互会社
（ロ）資本金の額　　639,000百万円（2021年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）
（ハ）事業の内容　　保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ　受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ　販売会社

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

3【資本関係】

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

第３【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である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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年5月25日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅 野　雅 子　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松 井　貴 志　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）の2020年4月14日から2021年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）の2021年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

―――

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

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	菅 野　雅 子　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松 井　貴 志　印

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」に掲げられている三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）の2021年4月14日から2021年10月13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、三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）の2021年10月13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14日から2021年10月13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、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。