

【表紙】

| | |
|--|--------------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2022年1月20日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友D S アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 猿田 隆 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区虎ノ門一丁目17番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 土屋 裕子 |
| 【電話番号】 | 03-6205-1649 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060 |
| 【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】 | 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060

以下「当ファンド」といいます。また、「<2060>」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「TYF60」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2022年1月21日から2022年7月21日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ お申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

ニ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ホ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。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】

2020年1月24日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

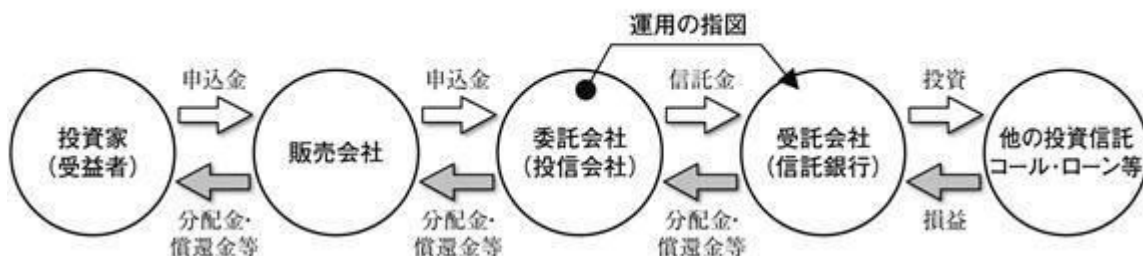
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2021年11月30日現在)

(ロ) 会社の沿革

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

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

（八）大株主の状況

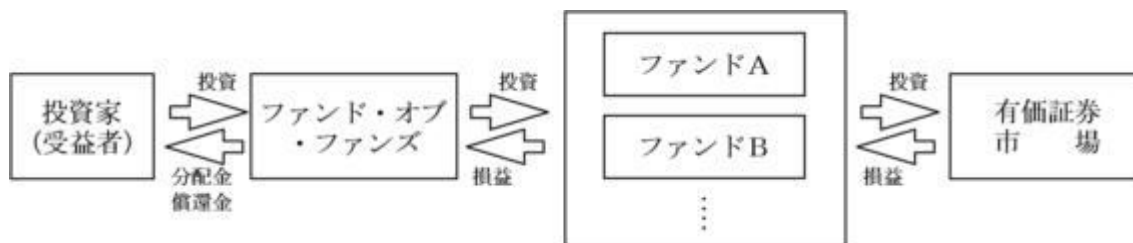
（2021年11月30日現在）

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

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



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の異なる「三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050（以下、「<2050>」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、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資することにより、安定性と収益性のバランスを重視し、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

・主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、

国内債券、先進国債券(除く日本)、新興国債券の8つの資産に投資します。

- ・基本資産配分は、西暦2060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収益性を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い安定性を重視します。
- ・ターゲットイヤー到達後は、信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
- ・基本資産配分の調整は原則として年1回の決算時に行います。
- ・家計調査のデータや各資産の期待収益率等を勘案し、ターゲットイヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率となるように、一定期間毎に検証を行い、基本資産配分を必要に応じて見直します。
- ・基本資産配分における資産は、将来の市場構造等の変化によって見直される場合があります。

(ロ) 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、資産毎に必要なに応じて調整を行うものとします。

(ハ) 実質外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。

(ニ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。

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

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

■投資対象とする投資信託の投資方針等

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶株式

国内株式

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主として東京証券取引所第1部に上場している株式 [※] に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。 *2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ●有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ●その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08% |

先進国株式(除く日本)

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 外国株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ●主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ●有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ●その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

新興国株式

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | エマージング株式インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ●主として新興国の株式、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券等に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ●有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ●その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

▶ 債券

国内債券

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 国内債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ● 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ● その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03% |

先進国債券(除く日本)

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | 外国債券パッシブ・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> ● 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 ● その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1% |

新興国債券

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託(米ドル建て) |
| 運用会社 | ザ・バンガード・グループ・インク |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 管理報酬等*1 | 年0.25%程度 |
| 購入の可否*2 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |
| ファンド名 | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF |
| 形態 | 米国籍外国投資信託(米ドル建て) |
| 運用会社 | ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。 |
| 管理報酬等*1 | 年0.39%程度 |
| 購入の可否*2 | 日本において一般投資者の購入が可能です。 |

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

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

▶ リート

国内リート

| | |
|---------|--|
| ファンド名 | Jリート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

外国リート

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | 外国リート・インデックス・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | <ul style="list-style-type: none"> S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)などを主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15% |

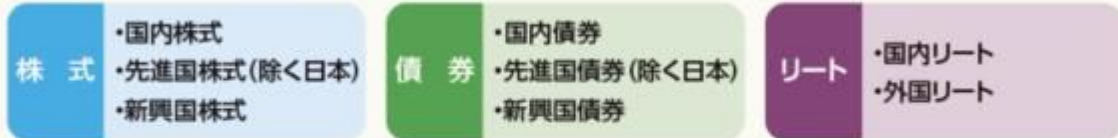
▶ 短期金融資産

| | |
|---------|---|
| ファンド名 | マネープール・マザーファンド |
| 形態 | 国内籍親投資信託 |
| 運用会社 | 三井住友DSアセットマネジメント株式会社 |
| 運用の基本方針 | 主として、円貨建て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。 |
| 信託報酬 | ありません。 |
| その他の費用 | <ul style="list-style-type: none"> 有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等を負担します。 その他の費用・手数料については、ファンドの運営状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。 |
| 信託財産留保額 | ありません。 |

ファンドの特色

1 世界各国の株式、債券および不動産投資信託（リート）に投資します。

□以下の8つの資産に投資します。



2 ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど収益性を重視した運用を行い、ターゲットイヤーに近づくにしたがい信託財産の安定性を重視した運用を行います。
ターゲットイヤー到達後は、信託財産の安定的な成長を目指した運用を行います。

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

□ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



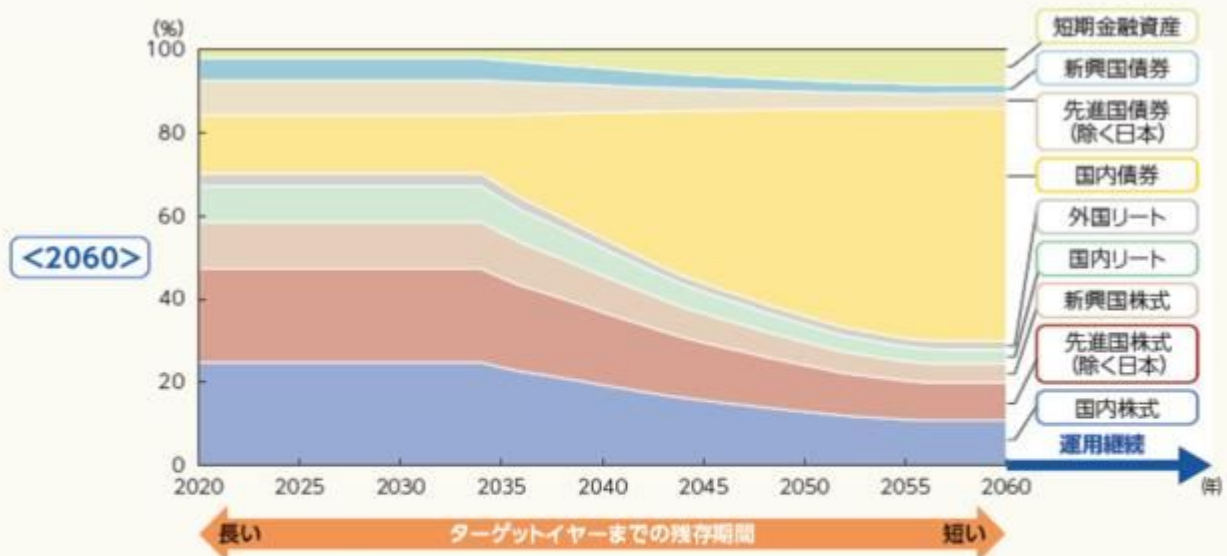
※販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

基本資産配分

▶ 2021年4月現在の基本資産配分

| | 国内株式 | 先進国株式 (除く日本) | 新興国株式 | 国内リート | 外国リート | 国内債券 | 先進国債券 (除く日本) | 新興国債券 | 短期 金融資産 |
|--------|-------|-----------------|-------|-------|-------|-------|-----------------|-------|------------|
| <2060> | 24.8% | 22.5% | 11.2% | 8.6% | 3.1% | 14.0% | 8.4% | 5.3% | 2.1% |

▶ ターゲットイヤーまでの基本資産配分のイメージ



- ※基本資産配分の調整は原則として年1回の決算時に行い、ターゲットイヤー到達後は、信託財産の安定的な成長を目指します。
- ※家計調査のデータや各資産の期待収益率等を勘案し、ターゲットイヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率となるように、一定期間毎に検証を行い、基本資産配分を必要に応じて見直します。
- ※組入資産の時価変動により生じる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要なに応じて調整を行います。
- ※基本資産配分における資産は、将来の市場構造等の変化によって見直される場合があります。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。））ならびに投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。））または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

ます。)

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

ハ 投資対象とする金融商品

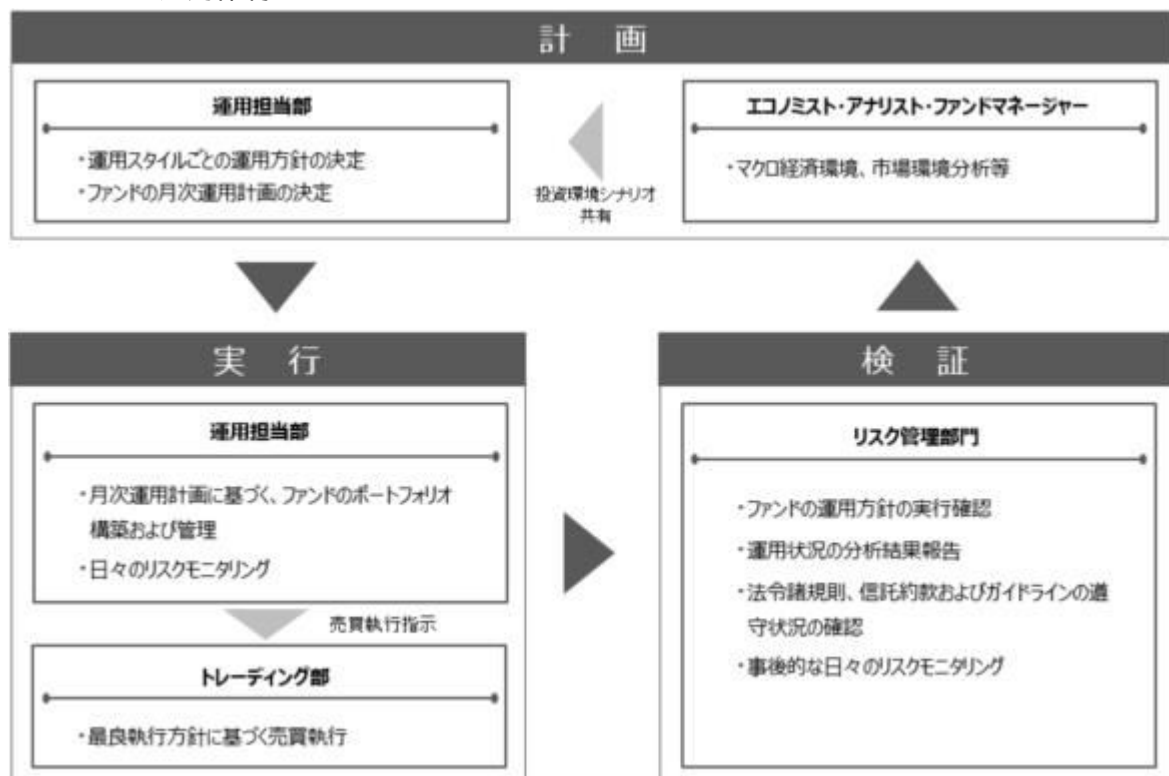
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年４月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

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

金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状

況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

(ニ) 信用リスク

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

(ホ) 為替変動リスク

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

(ヘ) カントリーリスク

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

(ト) 市場流動性リスク

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 換金制限等に関する留意点

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、換金申込みの受け付けが中止となる

可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

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

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

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移 〕

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

〔 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。

■<2060>



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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.が発行した指数で、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.が発行した指数で、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により編成されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。 |
| 新興国債 | JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが発行、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。 |

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

| | | | | | |
|--|--|---|---------|--------|--------|
| ファンド | 純資産総額に以下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。 信託報酬率およびその実質的配分は以下の通りです。 | | | | |
| | | 信託報酬率 | 配分(税抜き) | | |
| | | | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
| | 2036年の決算日まで | 年0.396% (税抜き0.36%) | 年0.17% | 年0.16% | 年0.03% |
| | 2036年の決算翌日以降 2061年の決算日まで | 年0.374% (税抜き0.34%) | 年0.16% | 年0.15% | 年0.03% |
| | 2061年の決算翌日以降 | 年0.33% (税抜き0.30%) | 年0.14% | 年0.13% | 年0.03% |
| | 上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。 | | | | |
| | 支払先 | 役務の内容 | | | |
| | 委託会社 | 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 | 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 | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価 | | | | |
| 投資対象とする投資信託 | 年0.02067%程度* 管理報酬等は年度によって異なります。 | | | | |
| 実質的な負担 | ファンドの純資産総額に対して年0.41667%(税抜き0.38067%)程度* 2036年の決算日までの、ファンドの信託報酬率で計算した料率です。 | | | | |
| 上記は直近の基本資産配分および管理報酬等の率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の調整および実際の組入状況等により変動します。 新興国債券の費用は、管理報酬等の率がより高いETFの数値を用いて試算しています。 | | | | | |

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

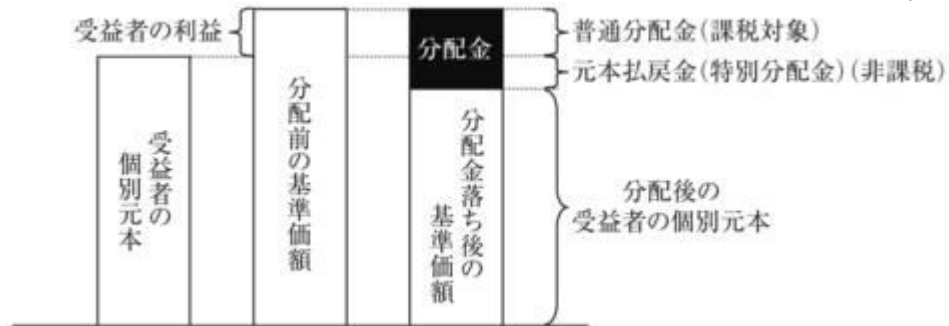
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年11月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-------------|-------------|
| 投資証券 | アメリカ | 2,690,410 | 5.04 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 49,715,070 | 93.08 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 1,008,268 | 1.88 |
| 合計（純資産総額） | | 53,413,748 | 100.00 |

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060

イ 主要投資銘柄

2021年11月30日現在

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

| | | | | | | | | |
|------|-------------------|---|-----------|-----------|------------|-----------|------------|-------|
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号) | 4,018,342 | 3.1826 | 12,788,628 | 3.2212 | 12,943,883 | 24.23 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国株式イン デックス・マ ザーファンド | 2,093,613 | 5.1445 | 10,770,564 | 5.8337 | 12,213,510 | 22.87 |
| 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 | 5,951,529 | 1.2802 | 7,619,326 | 1.2821 | 7,630,455 | 14.29 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド | 3,488,528 | 1.7405 | 6,071,709 | 1.6743 | 5,840,842 | 10.94 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド | 2,299,105 | 1.9399 | 4,459,934 | 1.9840 | 4,561,424 | 8.54 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | Jリート・イン デックス・マ ザーファンド | 1,714,624 | 2.6723 | 4,582,024 | 2.6385 | 4,524,035 | 8.47 |
| アメリカ | 投資証 券 | iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF | 220 | 12,681.84 | 2,790,005 | 12,229.14 | 2,690,410 | 5.04 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | 外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド | 593,880 | 2.3894 | 1,419,046 | 2.8144 | 1,671,415 | 3.13 |
| 日本 | 親投資 信託受 益証券 | マネープール・ マザーファンド | 329,342 | 1.0010 | 329,671 | 1.0005 | 329,506 | 0.62 |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 投資証券 | 5.04 |
| 親投資信託受益証券 | 93.08 |
| 合計 | 98.11 |

【投資不動産物件】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| 年月日 | 純資産総額 (円) | | 1万口当たりの 純資産額(円) | |
|-------------------|--------------|------------|--------------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第1期 (2020年 4月27日) | 25,658,045 | 25,658,045 | 8,553 | 8,553 |
| 第2期 (2021年 4月26日) | 42,896,603 | 42,896,603 | 11,196 | 11,196 |
| 2020年11月末日 | 34,583,405 | - | 10,075 | - |
| 12月末日 | 35,558,805 | - | 10,309 | - |
| 2021年 1月末日 | 36,261,974 | - | 10,487 | - |
| 2月末日 | 37,868,499 | - | 10,714 | - |
| 3月末日 | 42,489,144 | - | 11,143 | - |
| 4月末日 | 43,240,196 | - | 11,252 | - |
| 5月末日 | 45,575,608 | - | 11,372 | - |
| 6月末日 | 46,566,963 | - | 11,551 | - |
| 7月末日 | 48,802,806 | - | 11,460 | - |
| 8月末日 | 49,765,267 | - | 11,620 | - |
| 9月末日 | 52,266,438 | - | 11,613 | - |
| 10月末日 | 53,618,736 | - | 11,884 | - |
| 11月末日 | 53,413,748 | - | 11,640 | - |

【分配の推移】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| | 計算期間 | 1万口当たり分配金(円) |
|-----|-------------------------|--------------|
| 第1期 | 2020年 1月24日～2020年 4月27日 | - |
| 第2期 | 2020年 4月28日～2021年 4月26日 | - |

【収益率の推移】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

| | 収益率(%) |
|----------|--------|
| 第1期 | 14.5 |
| 第2期 | 30.9 |
| 第3期(中間期) | 6.2 |

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060

| | 設定口数（口） | 解約口数（口） |
|----------|------------|-----------|
| 第1期 | 30,000,000 | - |
| 第2期 | 8,314,969 | - |
| 第3期（中間期） | 8,659,297 | 2,114,738 |

（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11月30日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 株式 | 日本 | 192,569,963,990 | 97.72 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 4,484,355,762 | 2.28 |
| 合計（純資産総額） | | 197,054,319,752 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 売建 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率 （％） |
|----------|----------|------|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 4,815,840,000 | 2.44 |
| 合計 | 買建 | - | 4,815,840,000 | 2.44 |

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|-------|---------|-----------------|-------------|
| 株式 | アメリカ | 240,992,682,497 | 68.11 |
| | イギリス | 13,606,340,116 | 3.85 |
| | カナダ | 12,179,019,694 | 3.44 |
| | スイス | 11,311,330,095 | 3.20 |
| | フランス | 10,634,812,213 | 3.01 |
| | ドイツ | 8,881,824,981 | 2.51 |
| | オランダ | 6,875,515,504 | 1.94 |
| | アイルランド | 6,398,502,149 | 1.81 |
| | オーストラリア | 5,937,256,578 | 1.68 |
| | スウェーデン | 3,533,652,800 | 1.00 |
| | デンマーク | 2,729,313,359 | 0.77 |
| | スペイン | 2,319,148,033 | 0.66 |

| | | | |
|---------------------|------------|-----------------|--------|
| | 香港 | 2,172,666,053 | 0.61 |
| | イタリア | 1,816,938,337 | 0.51 |
| | ジャージー | 1,330,566,184 | 0.38 |
| | フィンランド | 1,252,791,358 | 0.35 |
| | シンガポール | 906,932,517 | 0.26 |
| | バミューダ | 833,860,206 | 0.24 |
| | ベルギー | 808,919,151 | 0.23 |
| | イスラエル | 651,304,563 | 0.18 |
| | ノルウェー | 649,762,216 | 0.18 |
| | ケイマン諸島 | 627,989,297 | 0.18 |
| | ニュージーランド | 328,110,783 | 0.09 |
| | ルクセンブルグ | 298,278,896 | 0.08 |
| | オランダ領キュラソー | 247,747,213 | 0.07 |
| | オーストリア | 230,234,552 | 0.07 |
| | ポルトガル | 164,453,730 | 0.05 |
| | パナマ | 99,493,339 | 0.03 |
| | リベリア | 94,541,971 | 0.03 |
| | マン島 | 76,383,648 | 0.02 |
| | パプアニューギニア | 33,570,037 | 0.01 |
| | 小計 | 338,023,942,070 | 95.54 |
| 投資証券 | アメリカ | 6,866,548,098 | 1.94 |
| | オーストラリア | 761,167,513 | 0.22 |
| | イギリス | 228,328,018 | 0.06 |
| | 香港 | 162,478,398 | 0.05 |
| | フランス | 143,437,672 | 0.04 |
| | シンガポール | 141,270,629 | 0.04 |
| | カナダ | 35,412,974 | 0.01 |
| | 小計 | 8,338,643,302 | 2.36 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 7,455,651,420 | 2.10 |
| 合計(純資産総額) | | 353,818,236,792 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率 (%) |
|----------|----------|---------|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | イギリス | 323,504,820 | 0.09 |
| 合計 | 買建 | - | 323,504,820 | 0.09 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | ドイツ | 1,138,863,153 | 0.32 |
| 合計 | 買建 | - | 1,138,863,153 | 0.32 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 5,899,958,610 | 1.67 |
| 合計 | 買建 | - | 5,899,958,610 | 1.67 |
| 株価指数先物取引 | 買建 | オーストラリア | 249,231,075 | 0.07 |
| 合計 | 買建 | - | 249,231,075 | 0.07 |

| 種類 | 買建 売建 | 国 / 地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|----------|--------|---------------|-------------|
| 為替予約取引 | 買建 | 日本 | 1,264,474,782 | 0.36 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|-----------|----------------|-------------|
| 株式 | ケイマン諸島 | 2,465,682,267 | 14.05 |
| | 台湾 | 1,762,664,017 | 10.04 |
| | 韓国 | 1,438,809,536 | 8.20 |
| | インド | 1,423,299,239 | 8.11 |
| | 中国 | 743,057,714 | 4.23 |
| | ブラジル | 454,999,692 | 2.59 |
| | 南アフリカ | 342,175,794 | 1.95 |
| | タイ | 191,212,227 | 1.09 |
| | インドネシア | 177,331,680 | 1.01 |
| | メキシコ | 158,643,380 | 0.90 |
| | マレーシア | 153,794,392 | 0.88 |
| | 香港 | 130,390,873 | 0.74 |
| | フィリピン | 81,761,634 | 0.47 |
| | ポーランド | 76,264,657 | 0.43 |
| | バミューダ | 67,607,439 | 0.39 |
| | チリ | 50,572,369 | 0.29 |
| | アメリカ | 39,929,422 | 0.23 |
| | ハンガリー | 28,884,899 | 0.16 |
| | トルコ | 28,084,737 | 0.16 |
| | ルクセンブルグ | 26,446,004 | 0.15 |
| | ギリシャ | 24,022,217 | 0.14 |
| | コロンビア | 18,034,407 | 0.10 |
| | チェコ | 13,905,313 | 0.08 |
| | エジプト | 9,685,693 | 0.06 |
| | マン島 | 4,068,107 | 0.02 |
| | シンガポール | 2,829,001 | 0.02 |
| ペルー | 2,316,698 | 0.01 | |
| アルゼンチン | 1,015,110 | 0.01 | |
| 小計 | | 9,917,488,518 | 56.51 |
| 新株予約権証券 | タイ | 15,617 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | 香港 | 609,236,472 | 3.47 |
| 投資証券 | アメリカ | 1,083,748,570 | 6.18 |
| | メキシコ | 52,681,189 | 0.30 |
| | ブラジル | 20,445,284 | 0.12 |
| | 南アフリカ | 3,827,710 | 0.02 |
| | 小計 | 1,160,702,753 | 6.61 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 5,861,193,861 | 33.41 |
| 合計(純資産総額) | | 17,548,637,221 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率 （％） |
|----------|----------|--------|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 5,988,815,824 | 34.13 |
| 合計 | 買建 | - | 5,988,815,824 | 34.13 |

| 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 | 3,329,667,903 | 18.97 |
| 為替予約取引 | 買建 | 日本 | 8,071,411,706 | 45.99 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|---------------------|--------|---------------|-------------|
| 投資証券 | 日本 | 8,552,350,950 | 98.68 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | - | 114,430,924 | 1.32 |
| 合計（純資産総額） | | 8,666,781,874 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 買建 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率 （％） |
|----------|----------|--------|------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 40,050,000 | 0.46 |
| 合計 | 買建 | - | 40,050,000 | 0.46 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 （円） | 投資比率 （％） |
|-------|----------|----------------|-------------|
| 投資証券 | アメリカ | 13,445,604,364 | 75.39 |
| | オーストラリア | 1,187,213,137 | 6.66 |
| | イギリス | 976,904,600 | 5.48 |
| | シンガポール | 581,248,838 | 3.26 |
| | カナダ | 334,183,017 | 1.87 |
| | フランス | 303,246,173 | 1.70 |
| | 香港 | 248,703,182 | 1.39 |
| | ベルギー | 235,866,884 | 1.32 |
| | スペイン | 72,203,806 | 0.40 |
| | ニュージーランド | 63,082,786 | 0.35 |
| | ドイツ | 51,324,090 | 0.29 |
| | 韓国 | 30,350,182 | 0.17 |
| | オランダ | 28,164,993 | 0.16 |
| | ガーンジー | 27,673,561 | 0.16 |
| | アイルランド | 17,965,768 | 0.10 |

| | | | |
|---------------------|-------|----------------|--------|
| | イスラエル | 12,970,856 | 0.07 |
| | イタリア | 4,009,104 | 0.02 |
| | 小計 | 17,620,715,341 | 98.81 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 213,027,923 | 1.19 |
| 合計(純資産総額) | | 17,833,743,264 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 国債証券 | 日本 | 110,333,187,740 | 81.54 |
| 地方債証券 | 日本 | 9,310,022,900 | 6.88 |
| 特殊債券 | 日本 | 9,936,326,264 | 7.34 |
| 社債券 | 日本 | 4,648,134,300 | 3.44 |
| | フランス | 201,046,000 | 0.15 |
| | 小計 | 4,849,180,300 | 3.58 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 887,238,903 | 0.66 |
| 合計(純資産総額) | | 135,315,956,107 | 100.00 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|-------|-------------|----------------|-------------|
| 国債証券 | アメリカ | 74,700,988,936 | 46.42 |
| | フランス | 15,742,034,456 | 9.78 |
| | イタリア | 14,282,328,029 | 8.88 |
| | ドイツ | 11,579,902,147 | 7.20 |
| | イギリス | 9,768,351,409 | 6.07 |
| | スペイン | 9,331,272,390 | 5.80 |
| | ベルギー | 3,627,062,246 | 2.25 |
| | カナダ | 3,146,976,400 | 1.96 |
| | オランダ | 3,010,384,072 | 1.87 |
| | オーストラリア | 2,746,045,255 | 1.71 |
| | オーストリア | 2,283,317,920 | 1.42 |
| | アイルランド | 1,314,957,693 | 0.82 |
| | メキシコ | 1,038,827,896 | 0.65 |
| | フィンランド | 932,112,652 | 0.58 |
| | デンマーク | 805,998,844 | 0.50 |
| | ポーランド | 791,062,892 | 0.49 |
| | イスラエル | 751,730,558 | 0.47 |
| マレーシア | 749,247,227 | 0.47 | |

| | | | |
|---------------------|--------|-----------------|--------|
| | シンガポール | 688,095,193 | 0.43 |
| | スウェーデン | 454,627,468 | 0.28 |
| | ノルウェー | 381,175,143 | 0.24 |
| | 中国 | 341,448,732 | 0.21 |
| | 小計 | 158,467,947,558 | 98.48 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 2,441,902,297 | 1.52 |
| 合計(純資産総額) | | 160,909,849,855 | 100.00 |

マネープール・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 国債証券 | 日本 | 18,652,887,900 | 5.48 |
| 地方債証券 | 日本 | 70,471,050,282 | 20.72 |
| 特殊債券 | 日本 | 13,118,596,884 | 3.86 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | - | 237,853,953,926 | 69.94 |
| 合計(純資産総額) | | 340,096,488,992 | 100.00 |

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|----|-------------------|--------|-----------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3,691,100 | 1,426.77 | 5,266,336,091 | 2,001.00 | 7,385,891,100 | 3.75 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 456,500 | 9,832.15 | 4,488,375,098 | 13,825.00 | 6,311,112,500 | 3.20 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 66,000 | 53,933.11 | 3,559,585,584 | 70,330.00 | 4,641,780,000 | 2.36 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 537,400 | 4,721.95 | 2,537,574,039 | 6,901.00 | 3,708,597,400 | 1.88 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 4,609,100 | 455.27 | 2,098,401,221 | 601.40 | 2,771,912,740 | 1.41 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 46,200 | 37,463.08 | 1,730,794,088 | 59,840.00 | 2,764,608,000 | 1.40 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 836,500 | 2,494.50 | 2,086,648,036 | 3,125.00 | 2,614,062,500 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 429,100 | 7,293.80 | 3,129,770,230 | 6,030.00 | 2,587,473,000 | 1.31 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 142,300 | 14,014.68 | 1,994,289,470 | 18,020.00 | 2,564,246,000 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | 日本電産 | 電気機器 | 188,900 | 13,233.44 | 2,499,796,108 | 13,000.00 | 2,455,700,000 | 1.25 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 350,500 | 4,092.78 | 1,434,521,003 | 6,688.00 | 2,344,144,000 | 1.19 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 122,600 | 17,343.66 | 2,126,332,456 | 19,000.00 | 2,329,400,000 | 1.18 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 92,900 | 23,645.25 | 2,196,643,538 | 23,150.00 | 2,150,635,000 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 41,200 | 59,264.62 | 2,441,702,452 | 50,100.00 | 2,064,120,000 | 1.05 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|-----------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 497,600 | 3,075.25 | 1,530,245,665 | 3,703.00 | 1,842,612,800 | 0.94 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 537,700 | 2,681.65 | 1,441,924,619 | 3,391.00 | 1,823,340,700 | 0.93 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 214,000 | 9,123.44 | 1,952,416,660 | 8,380.00 | 1,793,320,000 | 0.91 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 573,800 | 2,896.18 | 1,661,825,286 | 3,101.00 | 1,779,353,800 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 572,500 | 3,738.56 | 2,140,327,531 | 3,031.00 | 1,735,247,500 | 0.88 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 521,600 | 3,023.34 | 1,576,975,414 | 3,300.00 | 1,721,280,000 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 1,083,900 | 1,389.29 | 1,505,851,798 | 1,562.50 | 1,693,593,750 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 501,700 | 2,787.16 | 1,398,319,581 | 3,260.00 | 1,635,542,000 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 572,500 | 3,641.81 | 2,084,934,764 | 2,824.50 | 1,617,026,250 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | S M C | 機械 | 21,300 | 66,395.84 | 1,414,231,344 | 72,650.00 | 1,547,445,000 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 82,300 | 17,770.83 | 1,462,539,166 | 17,840.00 | 1,468,232,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 557,000 | 1,817.71 | 1,012,465,970 | 2,557.00 | 1,424,249,000 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 64,000 | 25,328.45 | 1,621,020,788 | 22,245.00 | 1,423,680,000 | 0.72 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 236,700 | 5,211.43 | 1,233,545,717 | 5,708.00 | 1,351,083,600 | 0.69 |
| 日本 | 株式 | デンソー | 輸送用機器 | 160,500 | 5,080.71 | 815,454,019 | 8,331.00 | 1,337,125,500 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 919,400 | 1,339.33 | 1,231,380,732 | 1,402.00 | 1,288,998,800 | 0.65 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|----------|---------|
| 株式(国内) | 水産・農林業 | 0.09 |
| | 鉱業 | 0.22 |
| | 建設業 | 2.13 |
| | 食料品 | 3.18 |
| | 繊維製品 | 0.45 |
| | パルプ・紙 | 0.20 |
| | 化学 | 6.64 |
| | 医薬品 | 4.71 |
| | 石油・石炭製品 | 0.40 |
| | ゴム製品 | 0.64 |
| | ガラス・土石製品 | 0.76 |
| | 鉄鋼 | 0.70 |
| | 非鉄金属 | 0.68 |
| | 金属製品 | 0.62 |
| | 機械 | 5.24 |
| | 電気機器 | 19.35 |
| | 輸送用機器 | 7.89 |
| | 精密機器 | 2.95 |
| その他製品 | 2.13 | |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 電気・ガス業 | 1.05 |
| | 陸運業 | 2.92 |
| | 海運業 | 0.42 |
| | 空運業 | 0.37 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.16 |
| | 情報・通信業 | 8.42 |
| | 卸売業 | 4.98 |
| | 小売業 | 4.10 |
| | 銀行業 | 4.55 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.72 |
| | 保険業 | 1.87 |
| | その他金融業 | 1.10 |
| | 不動産業 | 1.83 |
| | サービス業 | 6.27 |
| 合計 | | 97.72 |

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|----|----------------------------|--------------------|---------|-------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 892,929 | 13,404.29 | 11,969,081,063 | 18,230.50 | 16,278,546,420 | 4.60 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 382,865 | 24,935.46 | 9,546,914,169 | 38,298.40 | 14,663,115,039 | 4.14 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 小売 | 24,297 | 366,563.66 | 8,906,397,313 | 405,199.82 | 9,845,139,999 | 2.78 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 43,870 | 69,623.81 | 3,054,396,416 | 129,355.35 | 5,674,819,305 | 1.60 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 16,111 | 208,282.24 | 3,355,635,100 | 331,140.10 | 5,334,998,146 | 1.51 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CLASS C | メディア・娯楽 | 15,603 | 208,693.87 | 3,256,250,478 | 332,467.80 | 5,187,495,014 | 1.47 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 133,564 | 15,737.54 | 2,101,968,515 | 37,971.88 | 5,071,675,539 | 1.43 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 128,402 | 31,875.80 | 4,092,915,927 | 38,457.67 | 4,938,042,141 | 1.40 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 161,884 | 14,048.19 | 2,274,177,974 | 18,343.14 | 2,969,460,406 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 57,104 | 31,779.10 | 1,814,713,480 | 46,283.91 | 2,642,996,476 | 0.75 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|------------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 50,662 | 38,859.11 | 1,968,680,330 | 51,424.04 | 2,605,244,714 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 141,374 | 16,535.52 | 2,337,692,471 | 18,174.76 | 2,569,438,166 | 0.73 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 154,736 | 12,704.69 | 1,965,873,347 | 14,802.33 | 2,290,452,561 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 71,257 | 26,627.09 | 1,897,366,570 | 32,096.79 | 2,287,121,136 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 家庭用品・パーソナル用品 | 131,539 | 15,776.34 | 2,075,204,074 | 16,954.01 | 2,230,112,916 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 414,347 | 3,387.32 | 1,403,524,747 | 5,186.77 | 2,149,124,370 | 0.61 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 22,544 | 48,812.61 | 1,100,431,539 | 90,503.37 | 2,040,307,928 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | ソフトウェア・サービス | 90,892 | 24,029.63 | 2,184,101,199 | 22,331.91 | 2,029,792,263 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | ADOBE INC | ソフトウェア・サービス | 25,702 | 54,913.14 | 1,411,377,500 | 78,215.74 | 2,010,300,880 | 0.57 |
| アメリカ | 株式 | NETFLIX INC | メディア・娯楽 | 23,852 | 56,531.70 | 1,348,393,998 | 75,525.08 | 1,801,424,131 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 301,201 | 4,290.34 | 1,292,254,746 | 5,961.55 | 1,795,624,219 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | SALESFORCE.COM INC | ソフトウェア・サービス | 52,257 | 28,061.29 | 1,466,399,058 | 33,760.11 | 1,764,202,057 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC - A | ソフトウェア・サービス | 47,560 | 38,654.05 | 1,838,386,644 | 36,748.85 | 1,747,775,196 | 0.49 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 37,796 | 37,637.02 | 1,422,528,823 | 44,061.88 | 1,665,362,627 | 0.47 |
| アメリカ | 株式 | WALT DISNEY CO/THE | メディア・娯楽 | 97,683 | 16,871.24 | 1,648,033,286 | 16,816.34 | 1,642,670,901 | 0.46 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 227,812 | 4,716.80 | 1,074,544,534 | 7,007.09 | 1,596,300,166 | 0.45 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|------------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 21,163 | 52,161.23 | 1,103,888,034 | 73,810.56 | 1,562,052,942 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP | 食品・生活必需品小売り | 23,846 | 44,558.32 | 1,062,537,780 | 63,128.70 | 1,505,366,922 | 0.43 |
| アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CLASS A | メディア・娯楽 | 246,863 | 5,911.36 | 1,459,296,549 | 5,862.57 | 1,447,251,148 | 0.41 |
| アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 226,938 | 4,933.30 | 1,119,552,623 | 6,343.82 | 1,439,652,733 | 0.41 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|-------------|------------------------|---------|
| 株式(外国) | エネルギー | 3.22 |
| | 素材 | 3.96 |
| | 資本財 | 5.89 |
| | 商業・専門サービス | 1.24 |
| | 運輸 | 1.86 |
| | 自動車・自動車部品 | 2.54 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.90 |
| | 消費者サービス | 1.69 |
| | 小売 | 5.73 |
| | 食品・生活必需品小売り | 1.43 |
| | 食品・飲料・タバコ | 3.56 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.65 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 4.46 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.69 |
| | 銀行 | 5.76 |
| | 各種金融 | 4.61 |
| | 保険 | 2.81 |
| | 不動産 | 0.37 |
| | ソフトウェア・サービス | 12.36 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.12 |
| 半導体・半導体製造装置 | 5.51 | |
| 電気通信サービス | 1.42 | |
| 公益事業 | 2.73 | |
| メディア・娯楽 | 7.00 | |
| 投資証券 | - | 2.36 |
| 合計 | | 97.89 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2021年11月30日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・ 半導体製 造装置 | 330,000 | 2,075.10 | 684,783,770 | 2,428.10 | 801,272,274 | 4.57 |
| 香港 | 投資信 託受益 証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | - | 691,400 | 919.8580 | 635,989,840 | 881.1635 | 609,236,472 | 3.47 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディ ア・娯楽 | 77,100 | 8,617.58 | 664,415,687 | 6,746.42 | 520,148,673 | 2.96 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器 | 63,941 | 6,740.39 | 430,987,417 | 6,926.34 | 442,877,105 | 2.52 |
| アメリカ | 投資証 券 | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | - | 86,125 | 4,232.24 | 364,502,014 | 5,068.45 | 436,520,557 | 2.49 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 小売 | 203,300 | 3,194.92 | 649,526,870 | 1,896.70 | 385,599,110 | 2.20 |
| アメリカ | 投資証 券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | - | 83,970 | 3,672.95 | 308,417,500 | 4,498.47 | 377,736,173 | 2.15 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 小売 | 54,000 | 4,428.11 | 239,118,106 | 3,574.55 | 193,025,700 | 1.10 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネル ギー | 38,050 | 2,986.22 | 113,625,800 | 3,735.50 | 142,135,584 | 0.81 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフト ウェア・ サービス | 45,640 | 1,749.17 | 79,832,232 | 2,595.42 | 118,454,763 | 0.68 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | JD.COM INC-ADR | 小売 | 11,657 | 10,012.07 | 116,710,686 | 10,001.52 | 116,587,726 | 0.66 |
| アメリカ | 投資証 券 | ISHARES MSCI UAE ETF | - | 58,146 | 1,417.26 | 82,408,173 | 1,850.47 | 107,597,373 | 0.61 |
| インド | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 銀行 | 23,102 | 3,533.29 | 81,626,044 | 4,152.11 | 95,922,137 | 0.55 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 1,288,000 | 89.29 | 115,006,550 | 73.97 | 95,275,034 | 0.54 |
| アメリカ | 投資証 券 | ISHARES MSCI QATAR ETF | - | 38,065 | 2,038.76 | 77,605,338 | 2,296.22 | 87,405,610 | 0.50 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・ 半導体製 造装置 | 20,000 | 3,046.26 | 60,925,191 | 4,217.44 | 84,348,760 | 0.48 |
| ケイマン 諸島 | 株式 | NIO INC - ADR | 自動車・ 自動車部 品 | 18,231 | 5,694.42 | 103,815,057 | 4,603.13 | 83,919,739 | 0.48 |

| | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------------------|------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|------------|------|
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 7,310 | 10,057.95 | 73,523,586 | 11,112.80 | 81,234,568 | 0.46 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 53,100 | 1,715.60 | 91,098,124 | 1,410.05 | 74,873,694 | 0.43 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 68,018 | 768.53 | 52,274,166 | 1,099.15 | 74,762,120 | 0.43 |
| ケイマン諸島 | 株式 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 48,000 | 1,250.13 | 60,006,079 | 1,552.38 | 74,514,048 | 0.42 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI KUWAIT ETF | - | 18,439 | 3,067.08 | 56,553,831 | 3,931.21 | 72,487,554 | 0.41 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 167,800 | 356.98 | 59,901,250 | 423.79 | 71,112,146 | 0.41 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 11,017 | 6,104.38 | 67,251,910 | 6,303.64 | 69,447,201 | 0.40 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 85,500 | 1,328.02 | 113,545,890 | 810.47 | 69,295,569 | 0.39 |
| ケイマン諸島 | 株式 | NETEASE INC-ADR | メディア・娯楽 | 5,421 | 10,898.47 | 59,080,615 | 12,528.35 | 67,916,198 | 0.39 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 12,472 | 4,196.61 | 52,340,166 | 5,358.06 | 66,825,724 | 0.38 |
| ケイマン諸島 | 株式 | BAIDU INC - SPON ADR | メディア・娯楽 | 3,680 | 17,638.11 | 64,908,262 | 17,098.49 | 62,922,455 | 0.36 |
| 韓国 | 株式 | NAVER CORP | メディア・娯楽 | 1,649 | 28,571.58 | 47,114,541 | 37,026.70 | 61,057,028 | 0.35 |
| ケイマン諸島 | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 192,200 | 389.84 | 74,928,170 | 281.59 | 54,121,021 | 0.31 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|------------|---------|
| 株式(外国) | エネルギー | 2.25 |
| | 素材 | 4.11 |
| | 資本財 | 1.45 |
| | 商業・専門サービス | 0.04 |
| | 運輸 | 1.02 |
| | 自動車・自動車部品 | 2.60 |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.05 |

| | | |
|--|----------------------------|-------|
| | 消費者サービス | 0.66 |
| | 小売 | 5.20 |
| | 食品・生活必需品小売り | 0.71 |
| | 食品・飲料・タバコ | 1.69 |
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.60 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 0.57 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエ ンス | 2.09 |
| | 銀行 | 6.65 |
| | 各種金融 | 1.34 |
| | 保険 | 1.63 |
| | 不動産 | 1.10 |
| | ソフトウェア・サービス | 1.84 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.56 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 6.51 |
| | 電気通信サービス | 1.49 |
| | 公益事業 | 1.35 |
| | メディア・娯楽 | 4.99 |
| | 新株予約権証券 | - |
| | 投資信託受益証券 | - |
| | 投資証券 | - |
| | 合計 | 66.60 |

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|------|---------------------------|-------|-------------|-------------|------------------|-------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 884 | 702,369.74 | 620,894,850 | 700,000.00 | 618,800,000 | 7.14 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアル エステイト投資 法人 | 780 | 661,442.39 | 515,925,068 | 655,000.00 | 510,900,000 | 5.89 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジス リート投資法人 | 1,235 | 376,905.28 | 465,478,024 | 369,500.00 | 456,332,500 | 5.27 |
| 日本 | 投資証券 | G L P 投資法人 | 2,525 | 190,929.08 | 482,095,931 | 180,300.00 | 455,257,500 | 5.25 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マス ターファンド投 資法人 | 2,521 | 167,097.81 | 421,253,585 | 161,400.00 | 406,889,400 | 4.69 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファン ド投資法人 | 3,935 | 106,555.95 | 419,297,679 | 97,800.00 | 384,843,000 | 4.44 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリー ト投資法人 | 1,171 | 316,594.15 | 370,731,747 | 323,500.00 | 378,818,500 | 4.37 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動 産投資法人 | 1,554 | 195,225.71 | 303,380,756 | 180,500.00 | 280,497,000 | 3.24 |

| | | | | | | | | |
|----|------|---------------------|-------|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 780 | 360,885.61 | 281,490,778 | 348,500.00 | 271,830,000 | 3.14 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,757 | 151,644.64 | 266,439,631 | 144,600.00 | 254,062,200 | 2.93 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 1,107 | 210,820.62 | 233,378,428 | 202,800.00 | 224,499,600 | 2.59 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 512 | 401,013.37 | 205,318,844 | 404,500.00 | 207,104,000 | 2.39 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 2,370 | 91,447.37 | 216,730,278 | 82,500.00 | 195,525,000 | 2.26 |
| 日本 | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 416 | 451,082.48 | 187,650,311 | 432,000.00 | 179,712,000 | 2.07 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 956 | 190,624.00 | 182,236,545 | 187,200.00 | 178,963,200 | 2.06 |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 290 | 608,757.88 | 176,539,786 | 583,000.00 | 169,070,000 | 1.95 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 269 | 657,081.54 | 176,754,935 | 620,000.00 | 166,780,000 | 1.92 |
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 241 | 763,432.85 | 183,987,317 | 689,000.00 | 166,049,000 | 1.92 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 509 | 337,470.69 | 171,772,579 | 314,000.00 | 159,826,000 | 1.84 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2,393 | 63,276.04 | 151,419,572 | 58,600.00 | 140,229,800 | 1.62 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 919 | 149,886.57 | 137,745,761 | 152,000.00 | 139,688,000 | 1.61 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 919 | 156,084.91 | 143,442,031 | 150,400.00 | 138,217,600 | 1.59 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 273 | 477,646.82 | 130,397,583 | 497,000.00 | 135,681,000 | 1.57 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 3,439 | 40,934.29 | 140,773,009 | 38,050.00 | 130,853,950 | 1.51 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 728 | 182,515.00 | 132,870,923 | 166,700.00 | 121,357,600 | 1.40 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人 | 164 | 760,911.22 | 124,789,440 | 714,000.00 | 117,096,000 | 1.35 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 1,044 | 117,651.63 | 122,828,305 | 109,400.00 | 114,213,600 | 1.32 |
| 日本 | 投資証券 | N T T 都市開発リート投資法人 | 748 | 153,228.11 | 114,614,628 | 150,200.00 | 112,349,600 | 1.30 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 352 | 341,668.07 | 120,267,162 | 319,000.00 | 112,288,000 | 1.30 |

| | | | | | | | | |
|----|------|-------------------------|-----|------------|-------------|------------|-------------|------|
| 日本 | 投資証券 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 534 | 225,458.39 | 120,394,779 | 206,100.00 | 110,057,400 | 1.27 |
|----|------|-------------------------|-----|------------|-------------|------------|-------------|------|

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.68 |
| 合計 | 98.68 |

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 投資比率(%) |
|---------|------|------------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 71,376 | 15,010.34 | 1,071,377,998 | 17,438.67 | 1,244,702,195 | 6.98 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 8,642 | 93,236.80 | 805,752,456 | 93,291.40 | 806,224,278 | 4.52 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 31,898 | 15,293.16 | 487,821,133 | 18,196.37 | 580,427,931 | 3.25 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 14,681 | 36,235.52 | 531,973,707 | 37,759.13 | 554,341,718 | 3.11 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 27,474 | 18,327.84 | 503,539,199 | 19,203.24 | 527,589,769 | 2.96 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 53,234 | 7,796.68 | 415,048,339 | 7,941.15 | 422,738,966 | 2.37 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 40,869 | 9,613.87 | 392,909,428 | 9,333.69 | 381,458,609 | 2.14 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 13,382 | 25,351.59 | 339,254,911 | 27,393.54 | 366,580,360 | 2.06 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 162,179 | 1,869.12 | 303,131,608 | 1,995.67 | 323,655,683 | 1.81 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL | 32,661 | 9,340.99 | 305,086,168 | 9,809.25 | 320,379,894 | 1.80 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 13,440 | 23,247.83 | 312,450,894 | 23,352.43 | 313,856,661 | 1.76 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 12,843 | 20,356.12 | 261,433,672 | 23,101.00 | 296,686,123 | 1.66 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 11,272 | 21,339.42 | 240,537,997 | 23,891.70 | 269,307,242 | 1.51 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 55,256 | 4,562.82 | 252,123,396 | 4,695.29 | 259,442,828 | 1.45 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 11,109 | 22,397.76 | 248,816,739 | 22,384.25 | 248,666,605 | 1.39 |
| イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC | 114,661 | 1,937.01 | 222,099,120 | 2,148.36 | 246,333,449 | 1.38 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 6,234 | 36,058.58 | 224,789,201 | 39,421.31 | 245,752,415 | 1.38 |

| | | | | | | | | |
|------|------|------------------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ | 投資証券 | DUKE REALTY CORP | 36,138 | 5,693.90 | 205,766,011 | 6,763.63 | 244,423,934 | 1.37 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 38,290 | 6,215.84 | 238,004,382 | 5,588.38 | 213,979,162 | 1.20 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 51,620 | 3,994.75 | 206,209,206 | 3,875.01 | 200,027,820 | 1.12 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 198,400 | 1,058.91 | 210,088,267 | 1,002.33 | 198,862,867 | 1.12 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 60,235 | 3,353.48 | 201,996,741 | 3,200.35 | 192,773,088 | 1.08 |
| アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST | 9,640 | 16,409.54 | 158,187,966 | 19,210.06 | 185,185,021 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 26,971 | 5,967.55 | 160,950,798 | 6,538.36 | 176,346,158 | 0.99 |
| アメリカ | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC | 13,850 | 13,014.64 | 180,252,752 | 12,553.38 | 173,864,337 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 16,873 | 9,388.46 | 158,411,441 | 9,649.97 | 162,823,967 | 0.91 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 60,030 | 2,484.61 | 149,151,408 | 2,648.57 | 158,993,392 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 17,737 | 8,731.95 | 154,878,630 | 8,959.39 | 158,912,656 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 28,370 | 5,226.29 | 148,269,712 | 5,331.26 | 151,247,908 | 0.85 |
| アメリカ | 投資証券 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 56,657 | 2,300.19 | 130,321,790 | 2,444.92 | 138,521,679 | 0.78 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.81 |
| 合計 | 98.81 |

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11月30日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----------|----------|-----------------|---------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 国債 証券 | 4 2 7 2 年国債 | 3,300,000,000 | 100.28 | 3,309,170,500 | 100.23 | 3,307,425,000 | 0.005 | 2023/08/01 | 2.44 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 6 5 年国債 | 2,030,000,000 | 100.91 | 2,048,440,000 | 100.85 | 2,047,336,200 | 0.100 | 2025/12/20 | 1.51 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 7 5 年国債 | 1,700,000,000 | 100.51 | 1,708,623,500 | 100.47 | 1,708,058,000 | 0.005 | 2026/03/20 | 1.26 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 3 1 0年国債 | 1,340,000,000 | 100.76 | 1,350,183,600 | 100.57 | 1,347,638,000 | 0.100 | 2031/06/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 0 1 0年国債 | 1,285,000,000 | 102.18 | 1,312,961,600 | 101.68 | 1,306,588,000 | 0.800 | 2023/09/20 | 0.97 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----------|-----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 5 5 年国債 | 1,140,000,000 | 100.95 | 1,150,830,000 | 100.82 | 1,149,359,400 | 0.100 | 2025/09/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 0 1 0年国債 | 1,110,000,000 | 100.51 | 1,115,661,000 | 101.01 | 1,121,244,300 | 0.100 | 2030/09/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 8 1 0年国債 | 1,100,000,000 | 100.70 | 1,107,744,000 | 101.21 | 1,113,277,000 | 0.100 | 2030/03/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 7 1 0年国債 | 1,070,000,000 | 100.89 | 1,079,483,500 | 101.25 | 1,083,407,100 | 0.100 | 2029/12/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 9 1 0年国債 | 1,070,000,000 | 100.68 | 1,077,275,600 | 101.11 | 1,081,919,800 | 0.100 | 2030/06/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 8 5 年国債 | 1,070,000,000 | 100.53 | 1,075,722,300 | 100.50 | 1,075,371,400 | 0.005 | 2026/06/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債 証券 | 6 9 2 0 年国債 | 1,020,000,000 | 106.29 | 1,084,137,600 | 105.12 | 1,072,193,400 | 2.100 | 2024/03/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債 証券 | 6 4 2 0 年国債 | 1,025,000,000 | 104.72 | 1,073,421,000 | 103.67 | 1,062,597,000 | 1.900 | 2023/09/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債 証券 | 6 5 2 0 年国債 | 1,020,000,000 | 105.22 | 1,073,244,000 | 104.17 | 1,062,493,200 | 1.900 | 2023/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 4 1 0年国債 | 1,050,000,000 | 100.35 | 1,053,672,000 | 100.44 | 1,054,599,000 | 0.100 | 2031/09/20 | 0.78 |
| 日本 | 国債 証券 | 4 2 5 2 年国債 | 1,040,000,000 | 100.23 | 1,042,398,000 | 100.20 | 1,042,100,800 | 0.005 | 2023/06/01 | 0.77 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 1 1 0年国債 | 990,000,000 | 100.38 | 993,762,000 | 100.86 | 998,504,100 | 0.100 | 2030/12/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 6 1 0年国債 | 980,000,000 | 100.92 | 989,016,000 | 101.29 | 992,681,200 | 0.100 | 2029/09/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 4 5 年国債 | 980,000,000 | 100.89 | 988,722,000 | 100.78 | 987,683,200 | 0.100 | 2025/06/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 6 2 1 0年国債 | 930,000,000 | 100.25 | 932,280,800 | 100.74 | 936,900,600 | 0.100 | 2031/03/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債 証券 | 8 4 2 0 年国債 | 850,000,000 | 109.69 | 932,373,500 | 108.59 | 922,998,000 | 2.000 | 2025/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 2 9 1 0年国債 | 890,000,000 | 101.93 | 907,177,000 | 101.44 | 902,789,300 | 0.800 | 2023/06/20 | 0.67 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 3 0 年国債 | 692,000,000 | 128.05 | 886,112,920 | 127.17 | 880,016,400 | 2.400 | 2034/03/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債 証券 | 7 0 2 0 年国債 | 780,000,000 | 107.78 | 840,660,600 | 106.46 | 830,395,800 | 2.400 | 2024/06/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 3 1 0年国債 | 815,000,000 | 102.08 | 831,927,550 | 101.67 | 828,618,650 | 0.600 | 2024/03/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 8 8 2 0 年国債 | 742,000,000 | 112.20 | 832,501,740 | 111.00 | 823,590,320 | 2.300 | 2026/06/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 5 5 1 0年国債 | 810,000,000 | 100.88 | 817,128,000 | 101.33 | 820,756,800 | 0.100 | 2029/06/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 3 8 1 0年国債 | 805,000,000 | 102.01 | 821,204,650 | 101.72 | 818,862,100 | 0.400 | 2025/03/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 3 4 4 1 0年国債 | 811,000,000 | 101.02 | 819,231,650 | 100.97 | 818,826,150 | 0.100 | 2026/09/20 | 0.61 |
| 日本 | 国債 証券 | 1 4 9 5 年国債 | 810,000,000 | 100.45 | 813,667,500 | 100.48 | 813,904,200 | 0.005 | 2026/09/20 | 0.60 |

□ 種別別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 81.54 |
| 地方債証券 | 6.88 |
| 特殊債券 | 7.34 |
| 社債券 | 3.58 |
| 合計 | 99.34 |

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|--------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|---------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 14,950,000 | 11,922.18 | 1,782,366,328 | 11,623.20 | 1,737,668,142 | 1.625 | 2026/05/15 | 1.08 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 13,300,000 | 12,213.39 | 1,624,380,952 | 11,927.08 | 1,586,301,367 | 2.250 | 2026/03/31 | 0.99 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 9,000,000 | 12,944.72 | 1,165,024,923 | 12,429.37 | 1,118,643,525 | 2.875 | 2028/05/15 | 0.70 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,500,000 | 12,314.93 | 1,046,768,930 | 12,035.61 | 1,023,027,235 | 2.500 | 2026/02/28 | 0.64 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,500,000 | 10,829.87 | 920,538,668 | 11,025.45 | 937,163,309 | 1.125 | 2031/02/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,800,000 | 11,081.20 | 975,145,424 | 10,581.86 | 931,203,809 | 0.625 | 2030/08/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 8,000,000 | 11,367.22 | 909,377,835 | 11,320.46 | 905,636,504 | 0.125 | 2023/08/15 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,700,000 | 11,402.78 | 878,013,757 | 11,356.07 | 874,417,106 | 0.250 | 2023/06/15 | 0.54 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,700,000 | 11,314.09 | 871,184,559 | 11,265.39 | 867,435,155 | 0.125 | 2024/02/15 | 0.54 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,800,000 | 11,185.87 | 872,497,579 | 10,793.02 | 841,855,450 | 0.375 | 2027/09/30 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,100,000 | 11,725.39 | 832,502,802 | 11,493.84 | 816,062,767 | 1.375 | 2026/08/31 | 0.51 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,500,000 | 11,113.02 | 833,476,357 | 10,608.14 | 795,610,675 | 0.625 | 2030/05/15 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,200,000 | 10,982.85 | 790,765,472 | 10,906.79 | 785,288,778 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.49 |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,800,000 | 13,210.70 | 766,220,792 | 13,322.54 | 772,707,175 | 0.000 | 2030/08/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,500,000 | 12,096.06 | 786,244,030 | 11,769.39 | 765,010,527 | 2.125 | 2024/03/31 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,400,000 | 14,909.20 | 805,096,960 | 14,024.77 | 757,337,537 | 3.000 | 2048/08/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 7,000,000 | 10,941.66 | 765,916,415 | 10,798.71 | 755,909,496 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,700,000 | 10,904.85 | 730,625,251 | 10,978.81 | 735,579,935 | 0.750 | 2028/01/31 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 6,200,000 | 11,989.08 | 743,323,121 | 11,681.33 | 724,242,754 | 1.750 | 2024/06/30 | 0.45 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|--------------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,400,000 | 16,410.80 | 722,075,112 | 15,738.83 | 692,508,452 | 3.500 | 2030/03/01 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 12,265.83 | 699,152,203 | 11,885.78 | 677,489,428 | 2.500 | 2024/05/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,600,000 | 12,265.83 | 686,886,375 | 11,873.38 | 664,909,196 | 2.375 | 2024/08/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,800,000 | 10,686.42 | 619,812,133 | 11,337.86 | 657,596,060 | 1.875 | 2051/02/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,900,000 | 11,204.13 | 661,043,519 | 11,085.41 | 654,039,041 | 1.000 | 2028/07/31 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,700,000 | 11,361.89 | 647,627,728 | 11,304.98 | 644,384,064 | 0.125 | 2023/10/15 | 0.40 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE OAT. | 4,800,000 | 13,124.59 | 629,980,487 | 13,052.62 | 626,525,744 | 0.000 | 2024/03/25 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,100,000 | 12,298.71 | 627,234,455 | 11,919.57 | 607,898,025 | 2.750 | 2024/02/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,100,000 | 12,260.42 | 625,281,626 | 11,854.72 | 604,590,731 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4,800,000 | 13,042.66 | 626,047,867 | 12,326.18 | 591,656,789 | 2.750 | 2028/02/15 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 5,000,000 | 12,369.82 | 618,491,053 | 11,824.00 | 591,200,116 | 2.000 | 2026/11/15 | 0.37 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.48 |
| 合計 | 98.48 |

マネープール・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年11月30日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|-------|----------------|----------------|---------|----------------|----------|----------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 1033 国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 100.03 | 10,002,900,000 | 100.02 | 10,002,490,000 | 0.000 | 2022/01/31 | 2.94 |
| 日本 | 国債証券 | 1024 国庫短期証券 | 8,650,000,000 | 100.02 | 8,651,868,400 | 100.00 | 8,650,397,900 | 0.000 | 2021/12/20 | 2.54 |
| 日本 | 地方債証券 | 140 大阪府5年 | 6,564,000,000 | 99.99 | 6,563,632,416 | 100.00 | 6,564,288,816 | 0.001 | 2022/07/28 | 1.93 |
| 日本 | 地方債証券 | 70 神奈川県5年 | 4,220,000,000 | 99.99 | 4,219,666,620 | 100.00 | 4,219,936,700 | 0.010 | 2022/03/18 | 1.24 |
| 日本 | 地方債証券 | 141 大阪府5年 | 3,464,000,000 | 99.99 | 3,463,816,408 | 100.00 | 3,463,937,648 | 0.001 | 2022/08/30 | 1.02 |

| | | | | | | | | | | |
|----|---------------|----------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 地方 債証 券 | 7 1 2 東京都公 債 | 3,400,000,000 | 100.72 | 3,424,568,400 | 100.62 | 3,421,114,000 | 0.770 | 2022/09/20 | 1.01 |
| 日本 | 特殊 債証 券 | 1 5 7 政保道路 機構 | 2,967,000,000 | 100.35 | 2,977,345,929 | 100.23 | 2,973,708,387 | 0.900 | 2022/02/28 | 0.87 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 7 1 神 奈川県5 年 | 2,900,000,000 | 99.99 | 2,899,770,900 | 100.00 | 2,899,956,500 | 0.010 | 2022/03/18 | 0.85 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 7 0 3 東京都公 債 | 2,800,000,000 | 100.18 | 2,804,967,200 | 100.05 | 2,801,324,400 | 0.990 | 2021/12/20 | 0.82 |
| 日本 | 特殊 債証 券 | 3 5 政保 地方公共 団 | 2,200,000,000 | 100.53 | 2,211,653,400 | 100.40 | 2,208,703,200 | 0.977 | 2022/04/22 | 0.65 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 4 9 川 崎市5年 | 2,004,000,000 | 99.99 | 2,003,841,684 | 100.00 | 2,003,969,940 | 0.010 | 2022/03/18 | 0.59 |
| 日本 | 特殊 債証 券 | 1 8 0 政保道路 機構 | 1,939,000,000 | 100.93 | 1,957,110,260 | 100.83 | 1,955,130,541 | 0.734 | 2022/12/28 | 0.57 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 2 4 - 9 愛知 県公債 | 1,800,000,000 | 100.81 | 1,814,625,000 | 100.70 | 1,812,621,600 | 0.849 | 2022/09/28 | 0.53 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 1 8 6 神奈川県 公債 | 1,717,600,000 | 100.19 | 1,720,817,064 | 100.05 | 1,718,412,424 | 1.040 | 2021/12/20 | 0.51 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 1 9 0 神奈川県 公債 | 1,400,000,000 | 100.60 | 1,408,422,400 | 100.50 | 1,406,958,000 | 0.880 | 2022/06/20 | 0.41 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 4 6 横 浜市5年 | 1,400,000,000 | 100.00 | 1,400,036,400 | 100.00 | 1,399,983,200 | 0.010 | 2022/04/25 | 0.41 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 2 9 - 2 静岡 県5年 | 1,400,000,000 | 99.99 | 1,399,889,400 | 100.00 | 1,399,979,000 | 0.010 | 2022/03/18 | 0.41 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 7 0 7 東京都公 債 | 1,300,000,000 | 100.37 | 1,304,807,400 | 100.26 | 1,303,326,700 | 0.870 | 2022/03/18 | 0.38 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 2 3 - 8 福岡 県公債 | 1,300,000,000 | 100.20 | 1,302,563,600 | 100.06 | 1,300,742,300 | 1.040 | 2021/12/22 | 0.38 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 2 9 - 4 静岡 県5年 | 1,200,000,000 | 99.99 | 1,199,905,200 | 100.00 | 1,199,982,000 | 0.010 | 2022/03/18 | 0.35 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 2 4 - 2 京都 府公債 | 1,176,700,000 | 100.62 | 1,184,014,367 | 100.51 | 1,182,664,692 | 0.910 | 2022/06/20 | 0.35 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 7 0 5 東京都公 債 | 1,170,000,000 | 100.44 | 1,175,192,210 | 100.32 | 1,173,690,180 | 1.060 | 2022/03/18 | 0.35 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 3 6 1 大阪府公 債 | 1,076,000,000 | 100.65 | 1,083,007,988 | 100.54 | 1,081,771,664 | 0.920 | 2022/06/28 | 0.32 |

| | | | | | | | | | | |
|----|---------------|--------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 地方 債証 券 | 191 神奈川県 公債 | 1,002,000,000 | 100.57 | 1,007,725,428 | 100.47 | 1,006,685,352 | 0.830 | 2022/06/20 | 0.30 |
| 日本 | 特殊 債券 | 175 政保道路 機構 | 963,000,000 | 100.86 | 971,252,910 | 100.76 | 970,322,652 | 0.791 | 2022/10/31 | 0.29 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 363 大阪府公 債 | 942,000,000 | 100.67 | 948,339,660 | 100.58 | 947,422,152 | 0.770 | 2022/08/30 | 0.28 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 24- 8 愛知 県公債 | 900,000,000 | 100.73 | 906,592,500 | 100.63 | 905,632,200 | 0.835 | 2022/08/29 | 0.27 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 704 東京都公 債 | 900,000,000 | 100.18 | 901,596,600 | 100.05 | 900,425,700 | 0.970 | 2021/12/20 | 0.26 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 24- 4 埼玉 県公債 | 800,000,000 | 100.65 | 805,214,400 | 100.55 | 804,417,600 | 0.840 | 2022/07/25 | 0.24 |
| 日本 | 地方 債証 券 | 706 東京都公 債 | 802,000,000 | 100.41 | 805,286,596 | 100.29 | 804,292,116 | 0.960 | 2022/03/18 | 0.24 |

□ 種類別投資比率

2021年11月30日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 5.48 |
| 地方債証券 | 20.72 |
| 特殊債券 | 3.86 |
| 合計 | 30.06 |

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマーシング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネープール・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2021年11月30日現在

| 種類 | 地域 | 取引所等 | 名称 | 買建 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|----|-----------|---|----------|-----|------|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数 先物取引 | 日本 | 大阪取引 所 | TOPI X 先 物 0312 月 2021年 12月 | 買建 | 254 | 日本・円 | 5,076,959,400 | 4,815,840,000 | 2.44 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 種類 | 地域 | 取引 所 等 | 名称 | 買建 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価 (円) | 評価額 | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------------------|---------------------|---------------------------|--|----------|-----|----------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 株価 指数 先物 取引 | イギ リス | IC E- EU | F T S E 1 0 O I D X F U T D E C 2 1 2021年12 月 | 買建 | 30 | イギリ ス・ポ ンド | 2,171,290.00 | 329,080,712 | 2,134,500.00 | 323,504,820 | 0.09 |
| | ドイ ツ | EU RE X | EUR O S T O X X 5 0 D E C 2 1 2021年12 月 | 買建 | 216 | ユーロ | 9,227,192.00 | 1,184,863,724 | 8,868,960.00 | 1,138,863,153 | 0.32 |
| | アメ リカ | シカ ゴ商 品取 引所 | S & P 5 0 0 E M I N I F U T D E C 2 1 2021年12 月 | 買建 | 223 | アメリ カ・ド ル | 51,636,869.00 | 5,874,726,586 | 51,858,650.00 | 5,899,958,610 | 1.67 |
| | オー スト ラリ ア | シド ニー 先物 取引 所 | S P I 2 0 0 F U T U R E S D E C 2 1 2021 年12月 | 買建 | 17 | オー スト ラリ ア・ド ル | 3,131,101.50 | 254,527,240 | 3,065,950.00 | 249,231,075 | 0.07 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年11月30日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|-------------|----------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ド ル | 買建 | 8,370,000.00 | 952,169,526 | 952,205,922 | 0.27 |
| | ユーロ | 買建 | 1,060,000.00 | 136,120,067 | 136,120,617 | 0.04 |

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

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 種類 | 地域 | 取引所等 | 名称 | 買建 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 | 簿価 (円) | 評価額 | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------------------|----------|-------------------|--------------------------------------|----------|-----|-----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 株価 指数 先物 取引 | アメリ カ | I C E - U S | M S C I E 2 1 1 2 2021 年12月 | 買建 | 869 | アメリ カ・ド ル | 56,088,304.00 | 6,381,166,346 | 52,639,675.00 | 5,988,815,824 | 34.13 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年11月30日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|-------------|----------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ ドル | 売建 | 29,276,953.35 | 3,329,000,000 | 3,329,667,903 | 18.97 |
| | アメリカ・ ドル | 買建 | 70,960,672.20 | 7,983,376,975 | 8,071,411,706 | 45.99 |

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 種類 | 地域 | 取引所等 | 名称 | 買建 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|----|-----------|---|----------|----|------|------------|------------|-----------------|
| 株価指数 先物取引 | 日本 | 大阪取引 所 | T R E I T 先 物 0 3 1 2 月 2 0 2 1 年 1 2 月 | 買建 | 20 | 日本・円 | 42,968,400 | 40,050,000 | 0.46 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在

| 種類 | 資産の名称 | 買建 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------|----------------|----------|------------|------------|------------|-----------------|
| 為替予約 取引 | アメリカ・ ドル | 買建 | 606,541.15 | 69,000,000 | 69,002,662 | 0.39 |
| | オーストラ リア・ドル | 買建 | 59,127.86 | 4,800,000 | 4,806,426 | 0.03 |
| | イギリス・ ポンド | 買建 | 28,347.68 | 4,300,000 | 4,296,374 | 0.02 |
| | ユーロ | 買建 | 24,919.17 | 3,200,000 | 3,199,987 | 0.02 |
| | シンガポー ル・ドル | 買建 | 27,698.53 | 2,300,000 | 2,304,664 | 0.01 |
| | カナダ・ド ル | 買建 | 16,803.75 | 1,500,000 | 1,499,857 | 0.01 |

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネープール・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日: 2021年11月30日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移



| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2021年4月 | 0円 |
| 2020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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■<2060>

資産別構成

| 資産の種類 | 国・地域 | 比率(%) |
|---------------------|------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 93.08 |
| 投資証券 | アメリカ | 5.04 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1.88 |
| 合計(純資産総額) | | 100.00 |

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 比率(%) |
|------|---------------|--|-------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド(旧号) | 24.23 |
| 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 | 22.87 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内債券バッシブ・マザーファンド | 14.29 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | エマージング株式 インデックス・マザーファンド | 10.94 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国債券バッシブ・マザーファンド | 8.54 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | リート・インデックス・マザーファンド | 8.47 |
| アメリカ | 投資証券 | iシェアーズ J.P.モルガン・ミッドル種エ マージング・マーケット債券ETF | 5.04 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 3.13 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | マネー・プールマザーファンド | 0.62 |

※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)」は総入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

▶投資対象とする投資信託の現況

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

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

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

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

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 比率(%) |
|--------|--------------|-------------------------------|--------------------|-------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 4.57 |
| 香港 | 投資信託 受益証券 | CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY | — | 3.47 |
| ケイマン諸島 | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 2.96 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2.52 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI RUSSIA ETF | — | 2.49 |
| ケイマン諸島 | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 小売 | 2.20 |
| アメリカ | 投資証券 | ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | — | 2.15 |
| ケイマン諸島 | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 小売 | 1.10 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 0.81 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 0.68 |

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、指数先物取引の興建で(34.13%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|------|-----------|-------|------------|-------|
| 日本 | 国債証券 | 427 2年国債 | 0.005 | 2023/08/01 | 2.44 |
| 日本 | 国債証券 | 146 5年国債 | 0.100 | 2025/12/20 | 1.51 |
| 日本 | 国債証券 | 147 5年国債 | 0.005 | 2026/03/20 | 1.26 |
| 日本 | 国債証券 | 363 10年国債 | 0.100 | 2031/06/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 330 10年国債 | 0.800 | 2023/09/20 | 0.97 |
| 日本 | 国債証券 | 145 5年国債 | 0.100 | 2025/09/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 360 10年国債 | 0.100 | 2030/09/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 358 10年国債 | 0.100 | 2030/03/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 357 10年国債 | 0.100 | 2029/12/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 359 10年国債 | 0.100 | 2030/06/20 | 0.80 |

■外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する割合の比率です。

■リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

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

■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

■マネープール・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

| 国・地域 | 種類 | 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 比率(%) |
|------|-------|------------|-------|------------|-------|
| 日本 | 国債証券 | 1033国庫短期証券 | 0.000 | 2022/01/31 | 2.94 |
| 日本 | 国債証券 | 1024国庫短期証券 | 0.000 | 2021/12/20 | 2.54 |
| 日本 | 地方債証券 | 140 大阪府5年 | 0.001 | 2022/07/28 | 1.93 |
| 日本 | 地方債証券 | 70 神奈川県5年 | 0.010 | 2022/03/18 | 1.24 |
| 日本 | 地方債証券 | 141 大阪府5年 | 0.001 | 2022/08/30 | 1.02 |
| 日本 | 地方債証券 | 712 東京都公債 | 0.770 | 2022/09/20 | 1.01 |
| 日本 | 特殊債券 | 157 政保道路機構 | 0.900 | 2022/02/28 | 0.87 |
| 日本 | 地方債証券 | 71 神奈川県5年 | 0.010 | 2022/03/18 | 0.85 |
| 日本 | 地方債証券 | 703 東京都公債 | 0.990 | 2021/12/20 | 0.82 |
| 日本 | 特殊債券 | 35政保地方公共団 | 0.977 | 2022/04/22 | 0.65 |

※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)



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、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

2【換金(解約)手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の

仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

□ 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、「TYF60」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(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】

2020年1月24日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年4月27日から翌年4月26日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- 八 信託約款の変更等
- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併

合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(2020年4月28日から2021年4月26日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第1期 (2020年 4月27日現在) | 第2期 (2021年 4月26日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 15,089 | 32,087 |
| 金銭信託 | 108,511 | 178,733 |
| コール・ローン | 111,244 | 410,147 |
| 投資証券 | 1,327,966 | 2,163,992 |
| 親投資信託受益証券 | 24,023,048 | 40,186,403 |
| 未収入金 | 100,000 | - |
| 流動資産合計 | 25,685,858 | 42,971,362 |
| 資産合計 | 25,685,858 | 42,971,362 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 2,283 | 6,146 |
| 未払委託者報酬 | 25,098 | 67,443 |
| 未払利息 | - | 1 |
| その他未払費用 | 432 | 1,169 |
| 流動負債合計 | 27,813 | 74,759 |
| 負債合計 | 27,813 | 74,759 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 30,000,000 | 38,314,969 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 4,341,955 | 4,581,634 |
| 元本等合計 | 25,658,045 | 42,896,603 |
| 純資産合計 | 25,658,045 | 42,896,603 |
| 負債純資産合計 | 25,685,858 | 42,971,362 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第1期 | | 第2期 | |
|---|-----|------------------------------|-----|------------------------------|
| | 自 | 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 | 自 | 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 15,089 | | 60,076 |
| 有価証券売買等損益 | | 4,300,685 | | 8,815,455 |
| 為替差損益 | | 19,964 | | 9,591 |
| 営業収益合計 | | 4,305,560 | | 8,885,122 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 23 | | 150 |
| 受託者報酬 | | 2,283 | | 10,948 |
| 委託者報酬 | | 25,098 | | 120,214 |
| その他費用 | | 8,991 | | 13,753 |
| 営業費用合計 | | 36,395 | | 145,065 |
| 営業利益又は営業損失() | | 4,341,955 | | 8,740,057 |
| 経常利益又は経常損失() | | 4,341,955 | | 8,740,057 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 4,341,955 | | 8,740,057 |
| 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() | | - | | - |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | - | | 4,341,955 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | | 183,532 |
| 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 | | - | | 183,532 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | - |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | - | | - |
| 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() | | 4,341,955 | | 4,581,634 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 第2期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> <p>(2) 計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、2020年 4月28日から2021年 4月26日までとなっております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(表示方法の変更)

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

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた1,327,966円は、「投資証券」1,327,966円として組替えております。

（貸借対照表に関する注記）

| 項 目 | 第1期 (2020年 4月27日現在) | | 第2期 (2021年 4月26日現在) | |
|--------------------------------------|--------------------------------|-------------------|--------------------------------|--------------------|
| | 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | | 30,000,000口 | |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 | 4,341,955円 | 元本の欠損 | |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 0.8553円 8,553円 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 1.1196円 11,196円 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項 目 | 第1期 自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日 | | 第2期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 | |
|-----|---------------------------------------|--|---------------------------------------|---|
| | 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（164,045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（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は164,045円（1万口当たり54.68円）であります、分配を行っておりません。 | | 計算期間末における費用控除後の配当等収益（663,774円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,570,283円）、収益調整金（183,532円）、および分配準備積立金（164,045円）より、分配対象収益は4,581,634円（1万口当たり1,195.76円）であります、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 第2期 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 | |
|---------------------|---------------------------------------|---|
| | 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係る | (1) 金融商品の内容 | |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| | |
|----|--------------------------------|
| 項目 | <p>第2期 (2021年 4月26日現在)</p> |
|----|--------------------------------|

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2020年 1月24日 至 2020年 4月27日)

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 233,733円 |
| 親投資信託受益証券 | 3,972,015円 |
| 合計 | 4,205,748円 |

第2期(自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日)

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 投資証券 | 182,100円 |
| 親投資信託受益証券 | 8,442,200円 |
| 合計 | 8,624,300円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期

自 2020年 4月28日

至 2021年 4月26日

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

(その他の注記)

| 項 目 | 第1期 (2020年 4月27日現在) | 第2期 (2021年 4月26日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 期首元本額 | 30,000,000円 | 30,000,000円 |
| 期中追加設定元本額 | -円 | 8,314,969円 |
| 期中一部解約元本額 | -円 | -円 |

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------|-----|--|-----------|--------------------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF | 180 | 20,057.40 | |
| | | 米ドル 小計 | 180 | 20,057.40 (2,163,992) | |
| 投資証券合計 | | | | 2,163,992 (2,163,992) | |
| 親投資信託 受益証券 | 日本円 | 国内株式インデックス・マザーファンド(B号) | 3,257,418 | 10,328,620 | |
| | | 外国株式インデックス・マザーファンド | 1,957,599 | 9,951,454 | |
| | | 外国債券パッシブ・マザーファンド | 1,832,778 | 3,535,978 | |
| | | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 4,679,578 | 5,988,923 | |

| | | | | |
|-------------|------------------------|------------|------------|-------------|
| | Ｊリート・インデックス・マザーファンド | 1,448,736 | 3,830,892 | |
| | 外国リート・インデックス・マザーファンド | 583,824 | 1,381,094 | |
| | マネーブル・マザーファンド | 329,342 | 329,671 | |
| | エマージング株式インデックス・マザーファンド | 2,767,956 | 4,839,771 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | 16,857,231 | 40,186,403 | |
| 合計 | | | 42,350,395 | (2,163,992) |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-----|----------|----------------|------------|
| 米ドル | 投資証券 1銘柄 | 5.0% | 100.0% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Ｊリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーブル・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位：円)

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 652,035,892 | 727,633,001 |
| コール・ローン | 667,623,445 | 1,668,590,743 |
| 株式 | 152,354,149,040 | 187,837,731,440 |
| 派生商品評価勘定 | 128,163,700 | 1,611,200 |
| 未収配当金 | 1,981,191,957 | 1,741,114,046 |
| 前払金 | - | 83,065,000 |
| 差入委託証拠金 | 62,380,000 | 13,270,000 |
| 流動資産合計 | 155,845,544,034 | 192,073,015,430 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産合計 | 155,845,544,034 | 192,073,015,430 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 1,797,600 | 84,886,300 |
| 前受金 | 126,530,000 | - |
| 未払解約金 | 75,208,007 | 497,729,231 |
| 未払利息 | 1,925 | 4,829 |
| その他未払費用 | 132,811 | 57,245 |
| 流動負債合計 | 203,670,343 | 582,677,605 |
| 負債合計 | 203,670,343 | 582,677,605 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 66,420,614,464 | 60,391,040,010 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 89,221,259,227 | 131,099,297,815 |
| 元本等合計 | 155,641,873,691 | 191,490,337,825 |
| 純資産合計 | 155,641,873,691 | 191,490,337,825 |
| 負債純資産合計 | 155,845,544,034 | 192,073,015,430 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （2020年 4月27日現在） | （2021年 4月26日現在） |
|-----------------------|--|--|
| 1. 担保資産 | 代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 株式 2,663,600,000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 3,306,000,000円 |
| 2. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 66,420,614,464口 | 60,391,040,010口 |
| 3. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.3433円 (10,000口当たりの純資産額 23,433円) | 1口当たり純資産額 3.1708円 (10,000口当たりの純資産額 31,708円) |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|--|
| 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

（その他の注記）

| |
|-----------------|
| （2020年 4月27日現在） |
|-----------------|

| | |
|--------------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 62,955,891,614円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 9,131,832,058円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 5,667,109,208円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,930,085,411円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 1,002,421,458円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 4,651,519,341円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 3,204,800,316円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 82,255,976円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ） | 7,056,016円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ） | 25,925,290円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ） | 71,999,208円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ） | 121,550,280円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ） | 84,468,752円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ） | 183,080,997円 |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX） | 1,807,172,658円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド | 12,989,825,879円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定型） | 348,878,578円 |
| アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） | 402,912,826円 |
| アセットアロケーション・ファンド（成長型） | 297,633,454円 |
| 三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050 | 14,913,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） | 90,110,330円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） | 73,374,401円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） | 225,263,505円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） | 109,513,205円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） | 133,932,515円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 17,244,259円 |
| 三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド | 20,155,703円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型） | 628,342円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型） | 2,812,060円 |
| 三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型） | 1,964,032円 |
| 三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,752,764円 |
| S M A M ・ 国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 3,916,736,716円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 22,951,358円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 220,267,664円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 3,203,480,644円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 2,413,624,299円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 8,994,664,617円 |
| S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 57,396,433円 |
| S M A M ・ 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 |
| S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 898,124,937円 |
| S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 58,124,475円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 405,907,028円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 1,106,480,802円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 936,340,998円 |
| S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 2,882,119,746円 |

| | |
|--|-----------------|
| S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 > | 1,225,167円 |
| S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 > | 66,011,486円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 > | 80,438,386円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 > | 48,200,904円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 23,412,935円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 > | 209,289,501円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 > | 402,959,759円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 115,926,629円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 55,415,739円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 10,193,913円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 71,756,055円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 968,188,755円 |
| S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用) | 191,083,859円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 22,115,210円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 > | 929,127,958円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 > | 189,817,826円 |
| S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 > | 1,542,313,109円 |
| S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 > | 112,200,588円 |
| S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 > | 10,043,124円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 > | 14,237,375円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 15,653,159円 |
| S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 101,389,039円 |
| 合計 | 66,420,614,464円 |

(2021年 4月26日現在)

| | |
|--------------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 66,420,614,464円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,321,155,755円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,350,730,209円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,377,992,498円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 882,687,081円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,279,019,277円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,170,940,243円 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型) | 121,064,129円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 4,744,492円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 20,265,196円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 59,910,031円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 126,034,866円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 99,406,160円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 198,180,525円 |
| 国内株式指数ファンド (T O P I X) | 1,201,230,099円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド | 16,039,342,551円 |

| | |
|--|----------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,754,988円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 464,864,383円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 302,064,707円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 48,431,067円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050 | 23,321,027円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 134,683,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 112,157,344円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 371,384,457円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 185,233,234円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 216,782,444円 |
| 三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド | 24,448,491円 |
| 三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド | 223,855,528円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 11,130,956円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 50,852,277円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 47,513,827円 |
| 三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060 | 3,257,418円 |
| S M A M・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 3,065,048,127円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定> | 18,087,538円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定> | 129,489,749円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 2,117,958,002円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 1,802,540,670円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 6,769,935,339円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定> | 42,846,949円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定> | 175,681,640円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用> | 800,989,888円 |
| S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定> | 49,447,751円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 279,517,682円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 888,393,536円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用> | 684,285,651円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用> | 2,094,565,514円 |
| S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定> | 373,938円 |
| S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定> | 45,653,025円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用> | 54,101,733円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用> | 35,991,493円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用> | 17,007,263円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用> | 132,156,315円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用> | 271,614,480円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 72,269,436円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用> | 43,489,672円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 7,479,610円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用> | 50,100,640円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用> | 670,876,217円 |
| S M A M・国内株式インデックスファンド・V A(適格機関投資家専用) | 175,567,216円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定> | 280,176,797円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定> | 127,955,140円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定> | 692,837,428円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定> | 74,013,645円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定> | 20,287,354円 |

| | |
|--|-----------------|
| S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 > | 50,751,185円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 42,473,420円 |
| S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 382,523,535円 |
| 合計 | 60,391,040,010円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

| 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------|---------|----------|-------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 3,500 | 2,933.00 | 10,265,500 | |
| 日本水産 | 89,900 | 501.00 | 45,039,900 | |
| マルハニチロ | 15,000 | 2,451.00 | 36,765,000 | |
| 雪国まいたけ | 6,100 | 1,954.00 | 11,919,400 | |
| カネコ種苗 | 4,700 | 1,595.00 | 7,496,500 | |
| サカタのタネ | 11,500 | 3,925.00 | 45,137,500 | |
| ホクト | 8,100 | 2,000.00 | 16,200,000 | |
| 日鉄鉱業 | 2,300 | 6,670.00 | 15,341,000 | |
| I N P E X | 356,900 | 730.00 | 260,537,000 | |
| 石油資源開発 | 12,600 | 2,016.00 | 25,401,600 | |
| K & O エナジーグループ | 5,800 | 1,437.00 | 8,334,600 | |
| ヒノキヤグループ | 3,300 | 2,598.00 | 8,573,400 | |
| ショーボンドホールディングス | 13,900 | 4,730.00 | 65,747,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 32,000 | 1,772.00 | 56,704,000 | |
| タマホーム | 6,300 | 2,534.00 | 15,964,200 | |
| ベステラ | 3,200 | 1,675.00 | 5,360,000 | |
| スペースバリューホールディングス | 14,200 | 750.00 | 10,650,000 | |
| 安藤・間 | 61,900 | 851.00 | 52,676,900 | |
| 東急建設 | 30,800 | 569.00 | 17,525,200 | |
| コムシスホールディングス | 34,200 | 3,400.00 | 116,280,000 | |
| ピーアールホールディングス | 13,600 | 562.00 | 7,643,200 | |
| 高松コンストラクショングループ | 6,300 | 2,071.00 | 13,047,300 | |

| | | | | |
|---------------|---------|-----------|-------------|--|
| 東建コーポレーション | 2,900 | 10,240.00 | 29,696,000 | |
| オリエンタル白石 | 39,700 | 299.00 | 11,870,300 | |
| 大成建設 | 69,400 | 4,105.00 | 284,887,000 | |
| 大林組 | 222,000 | 996.00 | 221,112,000 | |
| 清水建設 | 208,200 | 894.00 | 186,130,800 | |
| 飛鳥建設 | 9,400 | 1,097.00 | 10,311,800 | |
| 長谷工コーポレーション | 72,500 | 1,495.00 | 108,387,500 | |
| 松井建設 | 11,800 | 715.00 | 8,437,000 | |
| 銭高組 | 1,700 | 4,530.00 | 7,701,000 | |
| 鹿島建設 | 163,000 | 1,509.00 | 245,967,000 | |
| 不動テトラ | 6,900 | 1,849.00 | 12,758,100 | |
| 大末建設 | 7,100 | 956.00 | 6,787,600 | |
| 鉄建建設 | 6,500 | 1,866.00 | 12,129,000 | |
| 西松建設 | 16,600 | 2,879.00 | 47,791,400 | |
| 三井住友建設 | 54,500 | 471.00 | 25,669,500 | |
| 大豊建設 | 5,200 | 4,010.00 | 20,852,000 | |
| 前田建設工業 | 58,300 | 939.00 | 54,743,700 | |
| 奥村組 | 12,400 | 2,779.00 | 34,459,600 | |
| 東鉄工業 | 8,800 | 2,519.00 | 22,167,200 | |
| 浅沼組 | 3,200 | 4,475.00 | 14,320,000 | |
| 戸田建設 | 94,900 | 788.00 | 74,781,200 | |
| 熊谷組 | 10,200 | 2,997.00 | 30,569,400 | |
| 北野建設 | 2,400 | 2,451.00 | 5,882,400 | |
| 矢作建設工業 | 12,100 | 807.00 | 9,764,700 | |
| ピーエス三菱 | 10,400 | 646.00 | 6,718,400 | |
| 日本ハウスホールディングス | 22,100 | 317.00 | 7,005,700 | |
| 大東建託 | 24,500 | 11,840.00 | 290,080,000 | |
| 新日本建設 | 10,500 | 836.00 | 8,778,000 | |
| N I P P O | 17,500 | 2,931.00 | 51,292,500 | |
| 東亜道路工業 | 1,900 | 4,485.00 | 8,521,500 | |
| 前田道路 | 14,500 | 2,106.00 | 30,537,000 | |
| 日本道路 | 2,300 | 7,960.00 | 18,308,000 | |
| 東亜建設工業 | 6,800 | 2,435.00 | 16,558,000 | |
| 日本国土開発 | 22,200 | 589.00 | 13,075,800 | |
| 若築建設 | 6,500 | 1,278.00 | 8,307,000 | |
| 東洋建設 | 26,200 | 577.00 | 15,117,400 | |

| | | | |
|------------|---------|----------|-------------|
| 五洋建設 | 96,800 | 860.00 | 83,248,000 |
| 世紀東急工業 | 13,300 | 876.00 | 11,650,800 |
| 福田組 | 2,800 | 4,965.00 | 13,902,000 |
| 住友林業 | 53,000 | 2,515.00 | 133,295,000 |
| バコーボレーション | 15,200 | 375.00 | 5,700,000 |
| 大和ハウス工業 | 207,100 | 3,292.00 | 681,773,200 |
| ライト工業 | 12,200 | 1,772.00 | 21,618,400 |
| 積水ハウス | 243,300 | 2,260.00 | 549,858,000 |
| ユアテック | 13,900 | 781.00 | 10,855,900 |
| 日本リーテック | 5,400 | 1,813.00 | 9,790,200 |
| 中電工 | 7,900 | 2,348.00 | 18,549,200 |
| 関電工 | 32,600 | 978.00 | 31,882,800 |
| きんでん | 47,100 | 1,830.00 | 86,193,000 |
| 東京エネシス | 8,900 | 907.00 | 8,072,300 |
| トーエネック | 2,900 | 3,890.00 | 11,281,000 |
| 住友電設 | 6,400 | 2,391.00 | 15,302,400 |
| 日本電設工業 | 11,200 | 1,920.00 | 21,504,000 |
| 協和エクシオ | 33,200 | 2,914.00 | 96,744,800 |
| 新日本空調 | 6,400 | 2,224.00 | 14,233,600 |
| 九電工 | 15,900 | 3,895.00 | 61,930,500 |
| 三機工業 | 15,400 | 1,396.00 | 21,498,400 |
| 日揮ホールディングス | 75,500 | 1,260.00 | 95,130,000 |
| 中外炉工業 | 4,300 | 2,241.00 | 9,636,300 |
| ヤマト | 9,400 | 665.00 | 6,251,000 |
| 太平電業 | 5,400 | 2,663.00 | 14,380,200 |
| 高砂熱学工業 | 19,300 | 1,655.00 | 31,941,500 |
| 朝日工業社 | 2,500 | 2,852.00 | 7,130,000 |
| 明星工業 | 15,900 | 771.00 | 12,258,900 |
| 大気社 | 10,600 | 3,015.00 | 31,959,000 |
| ダイダン | 5,000 | 2,760.00 | 13,800,000 |
| 日比谷総合設備 | 7,800 | 1,892.00 | 14,757,600 |
| レイズネクスト | 12,500 | 1,172.00 | 14,650,000 |
| ニッポン | 18,800 | 1,562.00 | 29,365,600 |
| 日清製粉グループ本社 | 80,600 | 1,771.00 | 142,742,600 |
| 昭和産業 | 5,400 | 2,981.00 | 16,097,400 |
| 鳥越製粉 | 8,500 | 816.00 | 6,936,000 |

| | | | | |
|--------------------------|---------|----------|-------------|--|
| 中部飼料 | 8,700 | 1,400.00 | 12,180,000 | |
| フィード・ワン | 10,500 | 863.00 | 9,061,500 | |
| 日本甜菜製糖 | 5,100 | 1,597.00 | 8,144,700 | |
| D M三井製糖ホールディングス | 5,300 | 1,819.00 | 9,640,700 | |
| 日新製糖 | 4,200 | 1,785.00 | 7,497,000 | |
| 森永製菓 | 16,900 | 3,740.00 | 63,206,000 | |
| 中村屋 | 2,700 | 3,820.00 | 10,314,000 | |
| 江崎グリコ | 19,600 | 4,150.00 | 81,340,000 | |
| 名糖産業 | 5,800 | 1,500.00 | 8,700,000 | |
| 井村屋グループ | 4,500 | 2,420.00 | 10,890,000 | |
| 不二家 | 5,100 | 2,166.00 | 11,046,600 | |
| 山崎製パン | 53,600 | 1,701.00 | 91,173,600 | |
| モロゾフ | 1,700 | 5,520.00 | 9,384,000 | |
| 亀田製菓 | 3,900 | 4,635.00 | 18,076,500 | |
| 寿スピリッツ | 6,900 | 6,680.00 | 46,092,000 | |
| カルビー | 32,800 | 2,622.00 | 86,001,600 | |
| 森永乳業 | 13,200 | 5,730.00 | 75,636,000 | |
| 六甲バター | 5,900 | 1,612.00 | 9,510,800 | |
| ヤクルト本社 | 49,200 | 5,380.00 | 264,696,000 | |
| 明治ホールディングス | 46,900 | 6,760.00 | 317,044,000 | |
| 雪印メグミルク | 17,100 | 2,215.00 | 37,876,500 | |
| プリマハム | 9,400 | 3,435.00 | 32,289,000 | |
| 日本ハム | 27,200 | 4,860.00 | 132,192,000 | |
| 丸大食品 | 6,700 | 1,675.00 | 11,222,500 | |
| S Foods | 6,200 | 3,285.00 | 20,367,000 | |
| 柿安本店 | 3,000 | 2,508.00 | 7,524,000 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 40,200 | 700.00 | 28,140,000 | |
| サッポロホールディングス | 24,800 | 2,176.00 | 53,964,800 | |
| アサヒグループホールディングス | 156,800 | 4,641.00 | 727,708,800 | |
| キリンホールディングス | 304,100 | 2,073.00 | 630,399,300 | |
| 宝ホールディングス | 53,000 | 1,414.00 | 74,942,000 | |
| オエノンホールディングス | 24,500 | 394.00 | 9,653,000 | |
| 養命酒製造 | 3,700 | 1,869.00 | 6,915,300 | |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 55,400 | 1,740.00 | 96,396,000 | |
| サントリー食品インターナショナル | 47,500 | 3,765.00 | 178,837,500 | |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|--|
| ダイドーグループホールディングス | 3,900 | 5,220.00 | 20,358,000 | |
| 伊藤園 | 21,700 | 6,220.00 | 134,974,000 | |
| キーコーヒー | 7,000 | 2,068.00 | 14,476,000 | |
| 日清オイリオグループ | 8,700 | 3,090.00 | 26,883,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 17,600 | 2,860.00 | 50,336,000 | |
| かどや製油 | 1,400 | 4,175.00 | 5,845,000 | |
| J - オイルミルズ | 6,400 | 1,862.00 | 11,916,800 | |
| キッコーマン | 51,500 | 6,560.00 | 337,840,000 | |
| 味の素 | 171,400 | 2,216.50 | 379,908,100 | |
| キューピー | 39,800 | 2,597.00 | 103,360,600 | |
| ハウス食品グループ本社 | 26,700 | 3,425.00 | 91,447,500 | |
| カゴメ | 29,300 | 3,275.00 | 95,957,500 | |
| 焼津水産化学工業 | 4,800 | 991.00 | 4,756,800 | |
| アリアケジャパン | 6,700 | 6,340.00 | 42,478,000 | |
| ニチレイ | 34,000 | 2,769.00 | 94,146,000 | |
| 東洋水産 | 36,700 | 4,510.00 | 165,517,000 | |
| イトアンドホールディングス | 4,300 | 1,844.00 | 7,929,200 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 5,300 | 864.00 | 4,579,200 | |
| 日清食品ホールディングス | 28,000 | 7,920.00 | 221,760,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 4,300 | 2,235.00 | 9,610,500 | |
| 一正蒲鉾 | 4,000 | 1,255.00 | 5,020,000 | |
| フジッコ | 7,400 | 1,911.00 | 14,141,400 | |
| ロック・フィールド | 7,500 | 1,602.00 | 12,015,000 | |
| 日本たばこ産業 | 384,200 | 2,074.00 | 796,830,800 | |
| ケンコーマヨネーズ | 5,400 | 1,736.00 | 9,374,400 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 5,600 | 1,943.00 | 10,880,800 | |
| なとり | 5,500 | 1,960.00 | 10,780,000 | |
| ピククルスコーポレーション | 2,000 | 3,525.00 | 7,050,000 | |
| 北の達人コーポレーション | 24,800 | 514.00 | 12,747,200 | |
| ユーグレナ | 31,000 | 956.00 | 29,636,000 | |
| ミヨシ油脂 | 4,700 | 1,211.00 | 5,691,700 | |
| 理研ビタミン | 8,100 | 1,415.00 | 11,461,500 | |
| 片倉工業 | 10,600 | 1,433.00 | 15,189,800 | |
| ゲンゼ | 5,100 | 3,920.00 | 19,992,000 | |
| 東洋紡 | 29,100 | 1,350.00 | 39,285,000 | |
| ユニチカ | 24,200 | 386.00 | 9,341,200 | |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|--|
| 富士紡ホールディングス | 3,700 | 4,615.00 | 17,075,500 | |
| 倉敷紡績 | 6,900 | 1,844.00 | 12,723,600 | |
| シキボウ | 6,300 | 974.00 | 6,136,200 | |
| 日本毛織 | 22,500 | 976.00 | 21,960,000 | |
| 帝国繊維 | 8,300 | 2,142.00 | 17,778,600 | |
| 帝人 | 65,500 | 1,790.00 | 117,245,000 | |
| 東レ | 508,300 | 696.70 | 354,132,610 | |
| 住江織物 | 2,700 | 2,075.00 | 5,602,500 | |
| アツギ | 11,300 | 544.00 | 6,147,200 | |
| ダイニック | 6,000 | 783.00 | 4,698,000 | |
| セーレン | 17,400 | 1,925.00 | 33,495,000 | |
| 小松マテーレ | 12,300 | 964.00 | 11,857,200 | |
| ワコールホールディングス | 18,300 | 2,397.00 | 43,865,100 | |
| ホギメディカル | 9,400 | 3,275.00 | 30,785,000 | |
| T S Iホールディングス | 28,900 | 323.00 | 9,334,700 | |
| マツオカコーポレーション | 2,900 | 1,850.00 | 5,365,000 | |
| ワールド | 10,200 | 1,424.00 | 14,524,800 | |
| オンワードホールディングス | 46,900 | 290.00 | 13,601,000 | |
| ゴールドウイン | 11,600 | 6,700.00 | 77,720,000 | |
| デサント | 12,400 | 1,838.00 | 22,791,200 | |
| 特種東海製紙 | 4,500 | 4,365.00 | 19,642,500 | |
| 王子ホールディングス | 313,200 | 715.00 | 223,938,000 | |
| 日本製紙 | 31,600 | 1,263.00 | 39,910,800 | |
| 北越コーポレーション | 50,800 | 557.00 | 28,295,600 | |
| 中越パルプ工業 | 5,400 | 1,223.00 | 6,604,200 | |
| 大王製紙 | 33,200 | 1,800.00 | 59,760,000 | |
| レンゴー | 72,800 | 913.00 | 66,466,400 | |
| トモク | 5,400 | 1,780.00 | 9,612,000 | |
| ザ・パック | 5,800 | 2,759.00 | 16,002,200 | |
| クラレ | 109,600 | 1,194.00 | 130,862,400 | |
| 旭化成 | 463,300 | 1,205.50 | 558,508,150 | |
| 昭和電工 | 53,000 | 3,190.00 | 169,070,000 | |
| 住友化学 | 547,500 | 554.00 | 303,315,000 | |
| 住友精化 | 3,600 | 3,965.00 | 14,274,000 | |
| 日産化学 | 38,500 | 5,840.00 | 224,840,000 | |
| ラサ工業 | 2,800 | 2,271.00 | 6,358,800 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|--|
| クレハ | 5,900 | 7,690.00 | 45,371,000 | |
| 多木化学 | 2,900 | 6,120.00 | 17,748,000 | |
| テイカ | 6,000 | 1,415.00 | 8,490,000 | |
| 石原産業 | 14,800 | 915.00 | 13,542,000 | |
| 日本曹達 | 9,800 | 3,300.00 | 32,340,000 | |
| 東ソー | 107,500 | 1,994.00 | 214,355,000 | |
| トクヤマ | 20,700 | 2,784.00 | 57,628,800 | |
| セントラル硝子 | 14,100 | 2,260.00 | 31,866,000 | |
| 東亜合成 | 43,400 | 1,228.00 | 53,295,200 | |
| 大阪ソーダ | 6,900 | 2,573.00 | 17,753,700 | |
| 関東電化工業 | 17,900 | 883.00 | 15,805,700 | |
| デンカ | 25,500 | 4,410.00 | 112,455,000 | |
| 信越化学工業 | 129,200 | 19,155.00 | 2,474,826,000 | |
| 堺化学工業 | 5,500 | 1,959.00 | 10,774,500 | |
| 第一稀元素化学工業 | 8,600 | 1,350.00 | 11,610,000 | |
| エア・ウォーター | 71,000 | 1,802.00 | 127,942,000 | |
| 日本酸素ホールディングス | 57,500 | 2,011.00 | 115,632,500 | |
| 日本化学工業 | 2,500 | 2,953.00 | 7,382,500 | |
| 日本パーカライズン | 36,600 | 1,097.00 | 40,150,200 | |
| 高压ガス工業 | 13,000 | 708.00 | 9,204,000 | |
| 四国化成工業 | 9,800 | 1,281.00 | 12,553,800 | |
| ステラ ケミファ | 4,000 | 3,130.00 | 12,520,000 | |
| 保土谷化学工業 | 2,200 | 4,580.00 | 10,076,000 | |
| 日本触媒 | 12,800 | 5,870.00 | 75,136,000 | |
| 大日精化工業 | 5,700 | 2,299.00 | 13,104,300 | |
| カネカ | 18,000 | 4,365.00 | 78,570,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 69,700 | 2,600.00 | 181,220,000 | |
| 三井化学 | 59,900 | 3,460.00 | 207,254,000 | |
| J S R | 70,200 | 3,430.00 | 240,786,000 | |
| 東京応化工業 | 12,100 | 7,500.00 | 90,750,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 6,400 | 4,290.00 | 27,456,000 | |
| 三菱ケミカルホールディングス | 468,100 | 813.10 | 380,612,110 | |
| K Hネオケム | 11,800 | 2,637.00 | 31,116,600 | |
| ダイセル | 94,200 | 834.00 | 78,562,800 | |
| 住友ベークライト | 11,200 | 4,465.00 | 50,008,000 | |
| 積水化学工業 | 146,400 | 2,088.00 | 305,683,200 | |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|---------------|
| 日本ゼオン | 63,200 | 1,653.00 | 104,469,600 |
| アイカ工業 | 19,500 | 3,990.00 | 77,805,000 |
| 宇部興産 | 35,000 | 2,251.00 | 78,785,000 |
| 積水樹脂 | 11,500 | 2,094.00 | 24,081,000 |
| タキロンシーアイ | 16,500 | 698.00 | 11,517,000 |
| 旭有機材 | 5,100 | 1,404.00 | 7,160,400 |
| ニチバン | 4,800 | 1,928.00 | 9,254,400 |
| リケンテクノス | 19,800 | 500.00 | 9,900,000 |
| 大倉工業 | 3,800 | 1,943.00 | 7,383,400 |
| 積水化成成品工業 | 12,000 | 586.00 | 7,032,000 |
| 群栄化学工業 | 2,600 | 2,413.00 | 6,273,800 |
| ダイキョーニシカワ | 15,400 | 733.00 | 11,288,200 |
| 森六ホールディングス | 4,600 | 2,083.00 | 9,581,800 |
| 日本化薬 | 44,600 | 1,025.00 | 45,715,000 |
| カーリットホールディングス | 8,700 | 720.00 | 6,264,000 |
| 日本精化 | 5,900 | 1,494.00 | 8,814,600 |
| 扶桑化学工業 | 5,300 | 4,035.00 | 21,385,500 |
| トリケミカル研究所 | 6,200 | 3,845.00 | 23,839,000 |
| A D E K A | 32,400 | 2,147.00 | 69,562,800 |
| 日油 | 26,100 | 5,890.00 | 153,729,000 |
| 新日本理化 | 15,000 | 285.00 | 4,275,000 |
| ハリマ化成グループ | 6,700 | 918.00 | 6,150,600 |
| 花王 | 171,000 | 7,090.00 | 1,212,390,000 |
| 第一工業製薬 | 2,700 | 3,665.00 | 9,895,500 |
| ニイタカ | 2,000 | 2,653.00 | 5,306,000 |
| 三洋化成工業 | 4,100 | 5,290.00 | 21,689,000 |
| 大日本塗料 | 10,100 | 869.00 | 8,776,900 |
| 日本ペイントホールディングス | 288,500 | 1,613.00 | 465,350,500 |
| 関西ペイント | 78,500 | 2,850.00 | 223,725,000 |
| 中国塗料 | 18,000 | 985.00 | 17,730,000 |
| 日本特殊塗料 | 6,500 | 1,035.00 | 6,727,500 |
| 藤倉化成 | 12,600 | 541.00 | 6,816,600 |
| 太陽ホールディングス | 5,100 | 5,770.00 | 29,427,000 |
| D I C | 29,400 | 2,821.00 | 82,937,400 |
| サカティンクス | 15,700 | 1,029.00 | 16,155,300 |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 13,500 | 2,030.00 | 27,405,000 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|--|
| T & K T O K A | 8,200 | 801.00 | 6,568,200 | |
| 富士フィルムホールディングス | 125,500 | 7,033.00 | 882,641,500 | |
| 資生堂 | 142,000 | 7,694.00 | 1,092,548,000 | |
| ライオン | 92,700 | 2,078.00 | 192,630,600 | |
| 高砂香料工業 | 4,900 | 2,679.00 | 13,127,100 | |
| マンダム | 15,400 | 2,014.00 | 31,015,600 | |
| ミルボン | 9,700 | 5,890.00 | 57,133,000 | |
| ファンケル | 26,000 | 3,605.00 | 93,730,000 | |
| コーセー | 13,400 | 16,260.00 | 217,884,000 | |
| コタ | 6,000 | 1,510.00 | 9,060,000 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 30,700 | 2,671.00 | 81,999,700 | |
| ノエビアホールディングス | 6,000 | 4,840.00 | 29,040,000 | |
| 新日本製薬 | 2,000 | 2,180.00 | 4,360,000 | |
| エステー | 5,400 | 1,876.00 | 10,130,400 | |
| アグロ カネショウ | 3,600 | 1,466.00 | 5,277,600 | |
| コニシ | 11,800 | 1,680.00 | 19,824,000 | |
| 長谷川香料 | 12,200 | 2,141.00 | 26,120,200 | |
| 小林製薬 | 19,900 | 9,910.00 | 197,209,000 | |
| 荒川化学工業 | 7,000 | 1,238.00 | 8,666,000 | |
| メック | 5,200 | 2,461.00 | 12,797,200 | |
| タカラバイオ | 18,600 | 2,827.00 | 52,582,200 | |
| J C U | 8,000 | 4,105.00 | 32,840,000 | |
| デクセリアルズ | 20,300 | 2,026.00 | 41,127,800 | |
| アース製薬 | 5,300 | 6,240.00 | 33,072,000 | |
| 北興化学工業 | 7,400 | 1,087.00 | 8,043,800 | |
| 大成ラミック | 3,200 | 2,823.00 | 9,033,600 | |
| クミアイ化学工業 | 30,500 | 951.00 | 29,005,500 | |
| 日本農薬 | 16,800 | 569.00 | 9,559,200 | |
| アキレス | 6,100 | 1,410.00 | 8,601,000 | |
| 有沢製作所 | 11,500 | 985.00 | 11,327,500 | |
| 日東電工 | 45,600 | 9,410.00 | 429,096,000 | |
| レック | 9,200 | 1,220.00 | 11,224,000 | |
| 三光合成 | 9,800 | 448.00 | 4,390,400 | |
| 藤森工業 | 6,000 | 4,250.00 | 25,500,000 | |
| 未来工業 | 3,600 | 1,811.00 | 6,519,600 | |
| J S P | 5,200 | 1,802.00 | 9,370,400 | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|--|
| エフピコ | 13,300 | 4,460.00 | 59,318,000 | |
| 天馬 | 6,000 | 2,275.00 | 13,650,000 | |
| 信越ポリマー | 11,200 | 1,012.00 | 11,334,400 | |
| 東リ | 26,000 | 250.00 | 6,500,000 | |
| ニフコ | 26,300 | 3,740.00 | 98,362,000 | |
| バルカー | 6,100 | 2,133.00 | 13,011,300 | |
| ユニ・チャーム | 151,500 | 4,333.00 | 656,449,500 | |
| 協和キリン | 71,400 | 3,320.00 | 237,048,000 | |
| 武田薬品工業 | 594,100 | 3,663.00 | 2,176,188,300 | |
| アステラス製薬 | 618,700 | 1,649.00 | 1,020,236,300 | |
| 大日本住友製薬 | 53,400 | 1,879.00 | 100,338,600 | |
| 塩野義製薬 | 89,800 | 5,714.00 | 513,117,200 | |
| 日本新薬 | 20,300 | 7,530.00 | 152,859,000 | |
| 中外製薬 | 223,000 | 4,242.00 | 945,966,000 | |
| 科研製薬 | 12,400 | 4,450.00 | 55,180,000 | |
| エーザイ | 79,200 | 7,320.00 | 579,744,000 | |
| ロート製薬 | 34,300 | 2,872.00 | 98,509,600 | |
| 小野薬品工業 | 164,300 | 2,823.50 | 463,901,050 | |
| 久光製薬 | 20,700 | 6,530.00 | 135,171,000 | |
| 持田製薬 | 10,200 | 3,920.00 | 39,984,000 | |
| 参天製薬 | 124,200 | 1,452.00 | 180,338,400 | |
| 扶桑薬品工業 | 3,300 | 2,452.00 | 8,091,600 | |
| 日本ケミファ | 2,500 | 2,439.00 | 6,097,500 | |
| ツムラ | 24,000 | 3,735.00 | 89,640,000 | |
| 日医工 | 20,800 | 935.00 | 19,448,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 13,400 | 2,268.00 | 30,391,200 | |
| 生化学工業 | 12,400 | 1,001.00 | 12,412,400 | |
| 栄研化学 | 12,700 | 2,201.00 | 27,952,700 | |
| 鳥居薬品 | 4,600 | 2,806.00 | 12,907,600 | |
| JCRファーマ | 20,400 | 3,000.00 | 61,200,000 | |
| 東和薬品 | 10,000 | 2,224.00 | 22,240,000 | |
| 富士製薬工業 | 6,500 | 1,208.00 | 7,852,000 | |
| ゼリア新薬工業 | 12,800 | 2,013.00 | 25,766,400 | |
| 第一三共 | 612,900 | 3,009.00 | 1,844,216,100 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 15,500 | 1,907.00 | 29,558,500 | |
| 大幸薬品 | 9,200 | 1,219.00 | 11,214,800 | |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|-------------|
| ダイト | 4,600 | 3,560.00 | 16,376,000 |
| 大塚ホールディングス | 148,200 | 4,312.00 | 639,038,400 |
| 大正製薬ホールディングス | 16,900 | 6,610.00 | 111,709,000 |
| ペプチドリーム | 36,400 | 4,885.00 | 177,814,000 |
| あすか製薬ホールディングス | 8,000 | 1,426.00 | 11,408,000 |
| サワイグループホールディングス | 15,600 | 5,200.00 | 81,120,000 |
| 日本コークス工業 | 75,400 | 103.00 | 7,766,200 |
| ニチレキ | 8,800 | 1,473.00 | 12,962,400 |
| ユシロ化学工業 | 7,200 | 1,102.00 | 7,934,400 |
| MORESCO | 5,800 | 1,110.00 | 6,438,000 |
| 出光興産 | 79,100 | 2,599.00 | 205,580,900 |
| ENEOSホールディングス | 1,075,700 | 462.20 | 497,188,540 |
| コスモエネルギーホールディングス | 22,700 | 2,348.00 | 53,299,600 |
| 横浜ゴム | 41,200 | 2,048.00 | 84,377,600 |
| TOYO TIRE | 38,000 | 2,070.00 | 78,660,000 |
| ブリヂストン | 189,900 | 4,467.00 | 848,283,300 |
| 住友ゴム工業 | 63,200 | 1,340.00 | 84,688,000 |
| オカモト | 4,400 | 4,065.00 | 17,886,000 |
| ニッタ | 7,200 | 2,638.00 | 18,993,600 |
| 住友理工 | 15,300 | 700.00 | 10,710,000 |
| 三ツ星ベルト | 9,000 | 1,714.00 | 15,426,000 |
| バンドー化学 | 14,700 | 745.00 | 10,951,500 |
| 日東紡績 | 10,800 | 3,880.00 | 41,904,000 |
| AGC | 65,500 | 4,925.00 | 322,587,500 |
| 日本板硝子 | 17,700 | 671.00 | 11,876,700 |
| 日本電気硝子 | 27,100 | 2,664.00 | 72,194,400 |
| オハラ | 3,600 | 1,626.00 | 5,853,600 |
| 住友大阪セメント | 13,400 | 3,535.00 | 47,369,000 |
| 太平洋セメント | 42,600 | 2,747.00 | 117,022,200 |
| 日本ヒューム | 11,000 | 710.00 | 7,810,000 |
| 日本コンクリート工業 | 24,200 | 389.00 | 9,413,800 |
| 三谷セキサン | 3,400 | 3,790.00 | 12,886,000 |
| アジアパイルホールディングス | 16,100 | 503.00 | 8,098,300 |
| 東海カーボン | 70,100 | 1,743.00 | 122,184,300 |
| 日本カーボン | 4,200 | 4,670.00 | 19,614,000 |
| 東洋炭素 | 5,100 | 2,173.00 | 11,082,300 |

| | | | |
|--------------------|---------|-----------|-------------|
| ノリタケカンパニーリミテド | 4,300 | 3,430.00 | 14,749,000 |
| TOTO | 51,000 | 6,250.00 | 318,750,000 |
| 日本碍子 | 78,700 | 1,953.00 | 153,701,100 |
| 日本特殊陶業 | 54,600 | 1,822.00 | 99,481,200 |
| MARUWA | 2,500 | 11,760.00 | 29,400,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 2,300 | 2,963.00 | 6,814,900 |
| 黒崎播磨 | 1,600 | 4,615.00 | 7,384,000 |
| 東京窯業 | 14,100 | 318.00 | 4,483,800 |
| フジインコーポレーテッド | 5,800 | 4,605.00 | 26,709,000 |
| ニチアス | 18,000 | 2,829.00 | 50,922,000 |
| ニチハ | 10,000 | 3,120.00 | 31,200,000 |
| 日本製鉄 | 337,300 | 1,877.00 | 633,112,100 |
| 神戸製鋼所 | 129,600 | 759.00 | 98,366,400 |
| 合同製鐵 | 4,600 | 2,046.00 | 9,411,600 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 203,100 | 1,401.00 | 284,543,100 |
| 東京製鐵 | 27,800 | 1,019.00 | 28,328,200 |
| 共英製鋼 | 8,900 | 1,558.00 | 13,866,200 |
| 大和工業 | 15,500 | 3,255.00 | 50,452,500 |
| 東京鐵鋼 | 3,400 | 1,902.00 | 6,466,800 |
| 大阪製鐵 | 5,000 | 1,281.00 | 6,405,000 |
| 淀川製鋼所 | 9,200 | 2,442.00 | 22,466,400 |
| 丸一鋼管 | 22,900 | 2,719.00 | 62,265,100 |
| モリ工業 | 2,800 | 2,475.00 | 6,930,000 |
| 大同特殊鋼 | 11,800 | 4,800.00 | 56,640,000 |
| 日本冶金工業 | 6,100 | 1,915.00 | 11,681,500 |
| 山陽特殊製鋼 | 9,000 | 1,636.00 | 14,724,000 |
| 愛知製鋼 | 4,200 | 3,490.00 | 14,658,000 |
| 日立金属 | 67,100 | 1,945.00 | 130,509,500 |
| 大平洋金属 | 5,400 | 2,137.00 | 11,539,800 |
| 新日本電工 | 48,600 | 365.00 | 17,739,000 |
| 栗本鐵工所 | 4,400 | 1,720.00 | 7,568,000 |
| 三菱製鋼 | 8,700 | 835.00 | 7,264,500 |
| 日本精線 | 1,500 | 3,680.00 | 5,520,000 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 10,900 | 955.00 | 10,409,500 |
| 日本輕金属ホールディングス | 19,500 | 2,078.00 | 40,521,000 |
| 三井金属鋳業 | 18,900 | 3,660.00 | 69,174,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| 東邦亜鉛 | 4,500 | 2,282.00 | 10,269,000 |
| 三菱マテリアル | 46,500 | 2,432.00 | 113,088,000 |
| 住友金属鉱山 | 90,200 | 4,672.00 | 421,414,400 |
| D O W A ホールディングス | 17,800 | 4,530.00 | 80,634,000 |
| 古河機械金属 | 11,800 | 1,233.00 | 14,549,400 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 10,100 | 897.00 | 9,059,700 |
| 東邦チタニウム | 13,500 | 989.00 | 13,351,500 |
| U A C J | 10,800 | 2,471.00 | 26,686,800 |
| C K サンエツ | 1,900 | 3,620.00 | 6,878,000 |
| 古河電気工業 | 22,100 | 2,851.00 | 63,007,100 |
| 住友電気工業 | 246,300 | 1,618.50 | 398,636,550 |
| フジクラ | 86,700 | 514.00 | 44,563,800 |
| 昭和電線ホールディングス | 7,200 | 1,627.00 | 11,714,400 |
| タツタ電線 | 13,500 | 604.00 | 8,154,000 |
| 平河ヒューテック | 5,100 | 1,304.00 | 6,650,400 |
| リョービ | 9,900 | 1,616.00 | 15,998,400 |
| アサヒホールディングス | 26,400 | 2,138.00 | 56,443,200 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 3,200 | 2,289.00 | 7,324,800 |
| トーカロ | 18,400 | 1,515.00 | 27,876,000 |
| アルファC o | 5,300 | 1,135.00 | 6,015,500 |
| S U M C O | 90,400 | 2,801.00 | 253,210,400 |
| 川田テクノロジーズ | 1,900 | 4,395.00 | 8,350,500 |
| R S Technologies | 2,400 | 6,710.00 | 16,104,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 45,900 | 1,270.00 | 58,293,000 |
| ホッカンホールディングス | 5,300 | 1,397.00 | 7,404,100 |
| 横河ブリッジホールディングス | 12,100 | 2,081.00 | 25,180,100 |
| 駒井ハルテック | 2,300 | 2,069.00 | 4,758,700 |
| 三和ホールディングス | 67,500 | 1,368.00 | 92,340,000 |
| 文化シャッター | 20,900 | 961.00 | 20,084,900 |
| 三協立山 | 11,300 | 819.00 | 9,254,700 |
| L I X I L | 97,500 | 3,120.00 | 304,200,000 |
| ノーリツ | 15,300 | 1,684.00 | 25,765,200 |
| 長府製作所 | 7,000 | 2,062.00 | 14,434,000 |
| リンナイ | 13,800 | 11,310.00 | 156,078,000 |
| 日東精工 | 13,100 | 566.00 | 7,414,600 |
| 岡部 | 17,800 | 750.00 | 13,350,000 |

| | | | |
|-------------|---------|-----------|-------------|
| ジーテクト | 9,400 | 1,401.00 | 13,169,400 |
| 東プレ | 13,800 | 1,440.00 | 19,872,000 |
| 高周波熱錬 | 19,000 | 553.00 | 10,507,000 |
| 東京製綱 | 6,000 | 1,082.00 | 6,492,000 |
| パイオラックス | 10,700 | 1,481.00 | 15,846,700 |
| エイチワン | 9,100 | 784.00 | 7,134,400 |
| 日本発條 | 71,700 | 783.00 | 56,141,100 |
| 立川ブラインド工業 | 3,800 | 1,317.00 | 5,004,600 |
| 三益半導体工業 | 5,500 | 2,895.00 | 15,922,500 |
| 日本製鋼所 | 21,900 | 2,630.00 | 57,597,000 |
| 三浦工業 | 30,500 | 5,730.00 | 174,765,000 |
| タクマ | 23,500 | 2,290.00 | 53,815,000 |
| ツガミ | 14,600 | 1,851.00 | 27,024,600 |
| オークマ | 8,300 | 6,020.00 | 49,966,000 |
| 芝浦機械 | 7,500 | 2,632.00 | 19,740,000 |
| アマダ | 102,800 | 1,200.00 | 123,360,000 |
| アイダエンジニアリング | 18,900 | 935.00 | 17,671,500 |
| F U J I | 27,700 | 2,950.00 | 81,715,000 |
| 牧野フライス製作所 | 8,400 | 4,170.00 | 35,028,000 |
| オーエスジー | 35,500 | 1,814.00 | 64,397,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 21,600 | 523.00 | 11,296,800 |
| D M G 森精機 | 45,200 | 1,742.00 | 78,738,400 |
| ソディック | 15,800 | 981.00 | 15,499,800 |
| ディスコ | 9,600 | 38,100.00 | 365,760,000 |
| 日東工器 | 4,300 | 1,976.00 | 8,496,800 |
| 日進工具 | 6,200 | 1,623.00 | 10,062,600 |
| 豊和工業 | 5,200 | 927.00 | 4,820,400 |
| 石川製作所 | 2,400 | 1,757.00 | 4,216,800 |
| 島精機製作所 | 10,300 | 2,242.00 | 23,092,600 |
| オプトラン | 9,100 | 2,978.00 | 27,099,800 |
| フリュー | 8,300 | 1,008.00 | 8,366,400 |
| ヤマシンフィルタ | 14,300 | 849.00 | 12,140,700 |
| 日阪製作所 | 10,600 | 855.00 | 9,063,000 |
| やまびこ | 13,800 | 1,206.00 | 16,642,800 |
| 平田機工 | 3,300 | 7,320.00 | 24,156,000 |
| マルマエ | 3,200 | 1,710.00 | 5,472,000 |

| | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|
| タツモ | 3,700 | 1,982.00 | 7,333,400 |
| ナブテスコ | 41,400 | 5,040.00 | 208,656,000 |
| 三井海洋開発 | 7,900 | 2,100.00 | 16,590,000 |
| レオン自動機 | 7,800 | 1,183.00 | 9,227,400 |
| S M C | 20,900 | 65,130.00 | 1,361,217,000 |
| ホソカワミクロン | 2,500 | 6,290.00 | 15,725,000 |
| ユニオンツール | 2,800 | 3,555.00 | 9,954,000 |
| オイレス工業 | 9,900 | 1,590.00 | 15,741,000 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 2,100 | 5,120.00 | 10,752,000 |
| サトーホールディングス | 9,500 | 2,723.00 | 25,868,500 |
| 技研製作所 | 6,300 | 4,760.00 | 29,988,000 |
| 日本エアージェット | 3,100 | 1,245.00 | 3,859,500 |
| 日精樹脂工業 | 7,400 | 1,003.00 | 7,422,200 |
| ワイエイシーホールディングス | 3,900 | 963.00 | 3,755,700 |
| 小松製作所 | 323,300 | 3,191.00 | 1,031,650,300 |
| 住友重機械工業 | 40,500 | 3,180.00 | 128,790,000 |
| 日立建機 | 33,500 | 3,285.00 | 110,047,500 |
| 日工 | 13,300 | 717.00 | 9,536,100 |
| 巴工業 | 3,700 | 2,145.00 | 7,936,500 |
| 井関農機 | 8,500 | 1,562.00 | 13,277,000 |
| T O W A | 7,000 | 2,191.00 | 15,337,000 |
| 北川鉄工所 | 3,700 | 1,518.00 | 5,616,600 |
| ローツェ | 3,100 | 10,240.00 | 31,744,000 |
| クボタ | 375,200 | 2,544.50 | 954,696,400 |
| 荏原実業 | 2,000 | 4,950.00 | 9,900,000 |
| 三菱化工機 | 2,600 | 2,763.00 | 7,183,800 |
| 月島機械 | 13,600 | 1,242.00 | 16,891,200 |
| 帝国電機製作所 | 6,200 | 1,354.00 | 8,394,800 |
| 新東工業 | 18,000 | 749.00 | 13,482,000 |
| 澁谷工業 | 6,200 | 3,385.00 | 20,987,000 |
| アイチ コーポレーション | 12,900 | 851.00 | 10,977,900 |
| 小森コーポレーション | 17,900 | 767.00 | 13,729,300 |
| 鶴見製作所 | 6,000 | 1,688.00 | 10,128,000 |
| 酒井重工業 | 2,200 | 2,097.00 | 4,613,400 |
| 荏原製作所 | 29,600 | 4,755.00 | 140,748,000 |
| 西島製作所 | 7,900 | 843.00 | 6,659,700 |

| | | | | |
|-----------------|--------|-----------|---------------|--|
| 北越工業 | 9,100 | 1,055.00 | 9,600,500 | |
| ダイキン工業 | 90,900 | 22,110.00 | 2,009,799,000 | |
| オルガノ | 2,200 | 7,530.00 | 16,566,000 | |
| トーヨーカネツ | 3,300 | 2,510.00 | 8,283,000 | |
| 栗田工業 | 38,500 | 4,975.00 | 191,537,500 | |
| 椿本チエイン | 9,800 | 2,899.00 | 28,410,200 | |
| 大同工業 | 4,300 | 961.00 | 4,132,300 | |
| 木村化工機 | 7,500 | 738.00 | 5,535,000 | |
| アネスト岩田 | 12,500 | 1,008.00 | 12,600,000 | |
| ダイフク | 39,100 | 11,010.00 | 430,491,000 | |
| サムコ | 2,000 | 3,400.00 | 6,800,000 | |
| 加藤製作所 | 6,000 | 1,036.00 | 6,216,000 | |
| タダノ | 36,100 | 1,172.00 | 42,309,200 | |
| フジテック | 24,900 | 2,436.00 | 60,656,400 | |
| C K D | 16,600 | 2,390.00 | 39,674,000 | |
| キトー | 7,200 | 1,799.00 | 12,952,800 | |
| 平和 | 19,900 | 1,831.00 | 36,436,900 | |
| 理想科学工業 | 6,500 | 1,320.00 | 8,580,000 | |
| S A N K Y O | 17,300 | 2,830.00 | 48,959,000 | |
| 日本金銭機械 | 10,100 | 579.00 | 5,847,900 | |
| マースグループホールディングス | 5,500 | 1,597.00 | 8,783,500 | |
| フクシマガリレイ | 5,000 | 4,025.00 | 20,125,000 | |
| 竹内製作所 | 11,700 | 2,964.00 | 34,678,800 | |
| アマノ | 18,900 | 2,732.00 | 51,634,800 | |
| J U K I | 10,400 | 864.00 | 8,985,600 | |
| 蛇の目ミシン工業 | 8,300 | 781.00 | 6,482,300 | |
| マックス | 9,800 | 1,604.00 | 15,719,200 | |
| グローリー | 18,700 | 2,336.00 | 43,683,200 | |
| 新晃工業 | 6,700 | 2,258.00 | 15,128,600 | |
| 大和冷機工業 | 11,800 | 1,108.00 | 13,074,400 | |
| セガサミーホールディングス | 64,800 | 1,600.00 | 103,680,000 | |
| リケン | 4,300 | 2,356.00 | 10,130,800 | |
| T P R | 9,900 | 1,540.00 | 15,246,000 | |
| ツバキ・ナカシマ | 13,500 | 1,582.00 | 21,357,000 | |
| ホシザキ | 22,500 | 9,970.00 | 224,325,000 | |
| 大豊工業 | 7,400 | 997.00 | 7,377,800 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|--|
| 日本精工 | 145,600 | 1,017.00 | 148,075,200 | |
| N T N | 169,200 | 317.00 | 53,636,400 | |
| ジェイテクト | 68,600 | 1,028.00 | 70,520,800 | |
| 不二越 | 6,600 | 4,355.00 | 28,743,000 | |
| 日本トムソン | 23,100 | 670.00 | 15,477,000 | |
| T H K | 44,500 | 3,800.00 | 169,100,000 | |
| ユーシン精機 | 6,400 | 898.00 | 5,747,200 | |
| 前澤給装工業 | 6,800 | 1,107.00 | 7,527,600 | |
| イーグル工業 | 9,700 | 1,186.00 | 11,504,200 | |
| 日本ピラー工業 | 7,500 | 1,769.00 | 13,267,500 | |
| キッツ | 23,000 | 693.00 | 15,939,000 | |
| マキタ | 92,800 | 5,250.00 | 487,200,000 | |
| 日立造船 | 56,700 | 813.00 | 46,097,100 | |
| 三菱重工業 | 112,400 | 3,225.00 | 362,490,000 | |
| I H I | 48,300 | 2,122.00 | 102,492,600 | |
| スター精密 | 11,400 | 1,653.00 | 18,844,200 | |
| 日清紡ホールディングス | 45,600 | 825.00 | 37,620,000 | |
| イビデン | 34,400 | 5,260.00 | 180,944,000 | |
| コニカミノルタ | 147,000 | 605.00 | 88,935,000 | |
| ブラザー工業 | 86,600 | 2,362.00 | 204,549,200 | |
| ミネベアミツミ | 122,500 | 2,758.00 | 337,855,000 | |
| 日立製作所 | 343,200 | 5,179.00 | 1,777,432,800 | |
| 東芝 | 105,000 | 4,465.00 | 468,825,000 | |
| 三菱電機 | 713,000 | 1,633.50 | 1,164,685,500 | |
| 富士電機 | 42,900 | 4,800.00 | 205,920,000 | |
| 安川電機 | 76,700 | 5,160.00 | 395,772,000 | |
| シンフォニアテクノロジー | 10,000 | 1,518.00 | 15,180,000 | |
| 明電舎 | 12,500 | 2,398.00 | 29,975,000 | |
| オリジン | 4,300 | 1,330.00 | 5,719,000 | |
| 山洋電気 | 3,700 | 5,880.00 | 21,756,000 | |
| デンヨー | 6,600 | 2,001.00 | 13,206,600 | |
| 東芝テック | 7,600 | 4,315.00 | 32,794,000 | |
| 芝浦メカトロニクス | 1,500 | 6,010.00 | 9,015,000 | |
| マブチモーター | 19,800 | 4,545.00 | 89,991,000 | |
| 日本電産 | 171,900 | 12,985.00 | 2,232,121,500 | |
| トレックス・セミコンダクター | 5,100 | 1,911.00 | 9,746,100 | |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|
| 東光高岳 | 4,500 | 1,526.00 | 6,867,000 |
| ダイヘン | 7,800 | 4,730.00 | 36,894,000 |
| ヤーマン | 11,900 | 1,523.00 | 18,123,700 |
| JVCケンウッド | 58,200 | 218.00 | 12,687,600 |
| ミマキエンジニアリング | 11,200 | 644.00 | 7,212,800 |
| I - P E X | 4,300 | 1,904.00 | 8,187,200 |
| 日新電機 | 16,900 | 1,208.00 | 20,415,200 |
| 大崎電気工業 | 18,300 | 581.00 | 10,632,300 |
| オムロン | 59,100 | 8,700.00 | 514,170,000 |
| 日東工業 | 10,600 | 1,948.00 | 20,648,800 |
| I D E C | 10,400 | 1,722.00 | 17,908,800 |
| 正興電機製作所 | 2,100 | 1,943.00 | 4,080,300 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 26,000 | 3,005.00 | 78,130,000 |
| メルコホールディングス | 2,800 | 3,965.00 | 11,102,000 |
| 日本電気 | 90,500 | 6,330.00 | 572,865,000 |
| 富士通 | 64,200 | 16,180.00 | 1,038,756,000 |
| 沖電気工業 | 30,800 | 1,160.00 | 35,728,000 |
| 電気興業 | 4,000 | 2,579.00 | 10,316,000 |
| サンケン電気 | 8,500 | 5,170.00 | 43,945,000 |
| アイホン | 5,100 | 1,735.00 | 8,848,500 |
| ルネサスエレクトロニクス | 308,000 | 1,251.00 | 385,308,000 |
| セイコーエプソン | 88,800 | 1,941.00 | 172,360,800 |
| ワコム | 52,700 | 711.00 | 37,469,700 |
| アルバック | 13,400 | 5,130.00 | 68,742,000 |
| E I Z O | 6,300 | 4,055.00 | 25,546,500 |
| 日本信号 | 17,700 | 945.00 | 16,726,500 |
| 京三製作所 | 19,700 | 408.00 | 8,037,600 |
| 能美防災 | 9,700 | 2,139.00 | 20,748,300 |
| ホーチキ | 6,300 | 1,310.00 | 8,253,000 |
| エレコム | 16,000 | 2,331.00 | 37,296,000 |
| パナソニック | 761,500 | 1,313.50 | 1,000,230,250 |
| シャープ | 82,700 | 1,831.00 | 151,423,700 |
| アンリツ | 43,000 | 2,364.00 | 101,652,000 |
| 富士通ゼネラル | 22,100 | 2,844.00 | 62,852,400 |
| ソニーグループ | 447,300 | 11,700.00 | 5,233,410,000 |
| T D K | 34,400 | 15,130.00 | 520,472,000 |

| | | | |
|---------------------|--------|-----------|---------------|
| 帝国通信工業 | 6,400 | 1,079.00 | 6,905,600 |
| タムラ製作所 | 28,100 | 513.00 | 14,415,300 |
| アルプスアルパイン | 59,700 | 1,289.00 | 76,953,300 |
| 鈴木 | 4,200 | 1,233.00 | 5,178,600 |
| 日本トリム | 2,100 | 3,845.00 | 8,074,500 |
| ローランド ディー . ジー . | 5,500 | 1,703.00 | 9,366,500 |
| フォスター電機 | 8,900 | 1,233.00 | 10,973,700 |
| S M K | 2,500 | 2,851.00 | 7,127,500 |
| ヨコオ | 5,400 | 2,690.00 | 14,526,000 |
| ホシデン | 19,500 | 1,073.00 | 20,923,500 |
| ヒロセ電機 | 11,000 | 17,960.00 | 197,560,000 |
| 日本航空電子工業 | 16,700 | 1,699.00 | 28,373,300 |
| T O A | 10,800 | 880.00 | 9,504,000 |
| マクセルホールディングス | 15,000 | 1,479.00 | 22,185,000 |
| 古野電気 | 10,500 | 1,109.00 | 11,644,500 |
| ユニデンホールディングス | 2,600 | 2,456.00 | 6,385,600 |
| スミダコーポレーション | 7,500 | 1,067.00 | 8,002,500 |
| アイコム | 3,500 | 2,649.00 | 9,271,500 |
| リオン | 3,500 | 2,815.00 | 9,852,500 |
| 船井電機 | 16,500 | 920.00 | 15,180,000 |
| 横河電機 | 71,700 | 2,014.00 | 144,403,800 |
| 新電元工業 | 3,400 | 3,420.00 | 11,628,000 |
| アズビル | 48,100 | 4,455.00 | 214,285,500 |
| 東亜ディーケーケー | 5,800 | 819.00 | 4,750,200 |
| 日本光電工業 | 29,800 | 3,300.00 | 98,340,000 |
| 共和電業 | 15,700 | 380.00 | 5,966,000 |
| 日本電子材料 | 3,100 | 2,131.00 | 6,606,100 |
| 堀場製作所 | 14,300 | 7,250.00 | 103,675,000 |
| アドバンテスト | 52,900 | 10,560.00 | 558,624,000 |
| エスベック | 7,000 | 1,872.00 | 13,104,000 |
| キーエンス | 70,100 | 52,140.00 | 3,655,014,000 |
| 日置電機 | 3,700 | 5,470.00 | 20,239,000 |
| シスメックス | 55,800 | 11,510.00 | 642,258,000 |
| 日本マイクロニクス | 12,900 | 1,752.00 | 22,600,800 |
| メガチップス | 7,500 | 3,800.00 | 28,500,000 |
| O B A R A G R O U P | 4,400 | 3,650.00 | 16,060,000 |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--|
| コーセル | 9,700 | 1,086.00 | 10,534,200 | |
| イリソ電子工業 | 6,200 | 5,020.00 | 31,124,000 | |
| オブテックスグループ | 12,400 | 1,685.00 | 20,894,000 | |
| 千代田インテグレ | 4,500 | 1,963.00 | 8,833,500 | |
| レーザーテック | 31,300 | 19,600.00 | 613,480,000 | |
| スタンレー電気 | 50,300 | 3,210.00 | 161,463,000 | |
| 岩崎電気 | 4,100 | 1,436.00 | 5,887,600 | |
| ウシオ電機 | 37,800 | 1,472.00 | 55,641,600 | |
| 日本セラミック | 7,700 | 2,595.00 | 19,981,500 | |
| 古河電池 | 5,600 | 1,663.00 | 9,312,800 | |
| 山一電機 | 5,500 | 1,587.00 | 8,728,500 | |
| 図研 | 5,000 | 2,896.00 | 14,480,000 | |
| 日本電子 | 13,100 | 6,360.00 | 83,316,000 | |
| カシオ計算機 | 57,900 | 1,927.00 | 111,573,300 | |
| ファナック | 62,700 | 25,780.00 | 1,616,406,000 | |
| 日本シイエムケイ | 20,300 | 450.00 | 9,135,000 | |
| エンプラス | 3,500 | 4,200.00 | 14,700,000 | |
| 大真空 | 3,000 | 2,350.00 | 7,050,000 | |
| ローム | 29,600 | 11,070.00 | 327,672,000 | |
| 浜松ホトニクス | 51,000 | 6,540.00 | 333,540,000 | |
| 三井ハイテック | 7,100 | 4,435.00 | 31,488,500 | |
| 新光電気工業 | 23,800 | 3,305.00 | 78,659,000 | |
| 京セラ | 108,800 | 7,145.00 | 777,376,000 | |
| 太陽誘電 | 31,700 | 4,995.00 | 158,341,500 | |
| 村田製作所 | 209,700 | 8,923.00 | 1,871,153,100 | |
| 双葉電子工業 | 14,200 | 882.00 | 12,524,400 | |
| 北陸電気工業 | 6,100 | 931.00 | 5,679,100 | |
| ニチコン | 23,100 | 1,090.00 | 25,179,000 | |
| 日本ケミコン | 5,200 | 1,705.00 | 8,866,000 | |
| K O A | 10,500 | 1,624.00 | 17,052,000 | |
| 市光工業 | 12,100 | 708.00 | 8,566,800 | |
| 小糸製作所 | 42,600 | 6,860.00 | 292,236,000 | |
| S C R E E Nホールディングス | 12,500 | 10,520.00 | 131,500,000 | |
| キヤノン電子 | 7,200 | 1,788.00 | 12,873,600 | |
| キヤノン | 355,200 | 2,652.00 | 941,990,400 | |
| リコー | 182,000 | 1,175.00 | 213,850,000 | |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| 象印マホービン | 19,600 | 1,750.00 | 34,300,000 | |
| 東京エレクトロン | 41,800 | 49,060.00 | 2,050,708,000 | |
| トヨタ紡織 | 21,000 | 1,806.00 | 37,926,000 | |
| ユニプレス | 13,000 | 1,030.00 | 13,390,000 | |
| 豊田自動織機 | 57,500 | 9,180.00 | 527,850,000 | |
| モリタホールディングス | 12,100 | 1,619.00 | 19,589,900 | |
| 三櫻工業 | 11,100 | 1,169.00 | 12,975,900 | |
| デンソー | 157,300 | 6,949.00 | 1,093,077,700 | |
| 東海理化電機製作所 | 19,400 | 1,822.00 | 35,346,800 | |
| 川崎重工業 | 55,900 | 2,504.00 | 139,973,600 | |
| 日本車輛製造 | 3,400 | 2,410.00 | 8,194,000 | |
| 三菱ロジスネクスト | 10,400 | 1,247.00 | 12,968,800 | |
| 日産自動車 | 843,900 | 555.30 | 468,617,670 | |
| いすゞ自動車 | 206,700 | 1,106.00 | 228,610,200 | |
| トヨタ自動車 | 723,500 | 8,265.00 | 5,979,727,500 | 代用有価証券 400,000株 |
| 日野自動車 | 90,100 | 896.00 | 80,729,600 | |
| 三菱自動車工業 | 267,600 | 295.00 | 78,942,000 | |
| 武蔵精密工業 | 16,500 | 1,944.00 | 32,076,000 | |
| 日産車体 | 11,000 | 734.00 | 8,074,000 | |
| 新明和工業 | 20,600 | 978.00 | 20,146,800 | |
| 極東開発工業 | 12,700 | 1,661.00 | 21,094,700 | |
| トピー工業 | 7,600 | 1,316.00 | 10,001,600 | |
| タチエス | 11,900 | 1,184.00 | 14,089,600 | |
| N O K | 35,600 | 1,409.00 | 50,160,400 | |
| フタバ産業 | 19,900 | 551.00 | 10,964,900 | |
| K Y B | 8,200 | 2,851.00 | 23,378,200 | |
| 大同メタル工業 | 21,000 | 560.00 | 11,760,000 | |
| プレス工業 | 39,600 | 317.00 | 12,553,200 | |
| 太平洋工業 | 15,900 | 1,216.00 | 19,334,400 | |
| 河西工業 | 16,400 | 425.00 | 6,970,000 | |
| アイシン | 51,900 | 3,855.00 | 200,074,500 | |
| マツダ | 225,100 | 856.00 | 192,685,600 | |
| 今仙電機製作所 | 8,900 | 716.00 | 6,372,400 | |
| 本田技研工業 | 562,200 | 3,290.00 | 1,849,638,000 | |
| スズキ | 141,800 | 4,316.00 | 612,008,800 | |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|
| S U B A R U | 205,400 | 2,070.00 | 425,178,000 |
| 安永 | 4,600 | 1,234.00 | 5,676,400 |
| ヤマハ発動機 | 100,700 | 2,752.00 | 277,126,400 |
| T B K | 13,100 | 412.00 | 5,397,200 |
| エクセディ | 10,000 | 1,637.00 | 16,370,000 |
| 豊田合成 | 23,200 | 2,740.00 | 63,568,000 |
| 愛三工業 | 14,200 | 687.00 | 9,755,400 |
| ヨロズ | 8,000 | 1,200.00 | 9,600,000 |
| エフ・シー・シー | 12,100 | 1,750.00 | 21,175,000 |
| シマノ | 26,800 | 26,100.00 | 699,480,000 |
| テイ・エス テック | 33,200 | 1,548.00 | 51,393,600 |
| ジャムコ | 8,200 | 939.00 | 7,699,800 |
| テルモ | 218,800 | 4,171.00 | 912,614,800 |
| 日機装 | 23,000 | 1,110.00 | 25,530,000 |
| 日本エム・ディ・エム | 4,600 | 2,148.00 | 9,880,800 |
| 島津製作所 | 91,500 | 4,040.00 | 369,660,000 |
| J M S | 7,300 | 978.00 | 7,139,400 |
| 長野計器 | 6,500 | 1,205.00 | 7,832,500 |
| ブイ・テクノロジー | 3,400 | 5,700.00 | 19,380,000 |
| 東京計器 | 6,400 | 1,021.00 | 6,534,400 |
| インターアクション | 3,800 | 2,577.00 | 9,792,600 |
| 東京精密 | 12,000 | 5,260.00 | 63,120,000 |
| マニー | 28,600 | 2,699.00 | 77,191,400 |
| ニコン | 109,900 | 1,023.00 | 112,427,700 |
| トプコン | 37,300 | 1,500.00 | 55,950,000 |
| オリンパス | 395,800 | 2,268.50 | 897,872,300 |
| 理研計器 | 6,200 | 2,863.00 | 17,750,600 |
| タムロン | 5,900 | 2,200.00 | 12,980,000 |
| H O Y A | 141,700 | 13,075.00 | 1,852,727,500 |
| ノーリツ鋼機 | 6,700 | 2,655.00 | 17,788,500 |
| エー・アンド・デイ | 6,700 | 1,349.00 | 9,038,300 |
| 朝日インテック | 75,300 | 2,996.00 | 225,598,800 |
| シチズン時計 | 90,800 | 365.00 | 33,142,000 |
| メニコン | 11,000 | 6,720.00 | 73,920,000 |
| 松風 | 4,200 | 2,006.00 | 8,425,200 |
| セイコーホールディングス | 10,100 | 1,901.00 | 19,200,100 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|-----------|---------------|
| ニプロ | 54,000 | 1,314.00 | 70,956,000 |
| スノーピーク | 4,300 | 3,985.00 | 17,135,500 |
| パラマウントベッドホールディングス | 13,800 | 2,189.00 | 30,208,200 |
| トランザクション | 5,100 | 1,229.00 | 6,267,900 |
| ニホンフラッシュ | 6,900 | 1,301.00 | 8,976,900 |
| 前田工織 | 7,700 | 3,350.00 | 25,795,000 |
| 永大産業 | 13,800 | 300.00 | 4,140,000 |
| アートネイチャー | 10,600 | 667.00 | 7,070,200 |
| バンダイナムコホールディングス | 59,100 | 8,100.00 | 478,710,000 |
| S H O E I | 6,200 | 4,390.00 | 27,218,000 |
| フランスベッドホールディングス | 11,700 | 916.00 | 10,717,200 |
| パイロットコーポレーション | 12,700 | 3,470.00 | 44,069,000 |
| 萩原工業 | 5,100 | 1,463.00 | 7,461,300 |
| トッパン・フォームズ | 12,600 | 1,134.00 | 14,288,400 |
| フジシールインターナショナル | 14,500 | 2,438.00 | 35,351,000 |
| タカラトミー | 32,100 | 952.00 | 30,559,200 |
| 廣済堂 | 6,800 | 983.00 | 6,684,400 |
| プロネクサス | 8,200 | 1,171.00 | 9,602,200 |
| 大建工業 | 5,500 | 2,039.00 | 11,214,500 |
| 凸版印刷 | 107,700 | 1,905.00 | 205,168,500 |
| 大日本印刷 | 86,100 | 2,244.00 | 193,208,400 |
| 共同印刷 | 2,600 | 2,838.00 | 7,378,800 |
| N I S S H A | 14,600 | 1,335.00 | 19,491,000 |
| T A K A R A & C O M P A N Y | 4,700 | 1,868.00 | 8,779,600 |
| アシックス | 64,000 | 1,774.00 | 113,536,000 |
| ローランド | 4,200 | 4,620.00 | 19,404,000 |
| ヤマハ | 42,400 | 6,130.00 | 259,912,000 |
| 河合楽器製作所 | 2,600 | 3,255.00 | 8,463,000 |
| ピジョン | 46,000 | 3,990.00 | 183,540,000 |
| オリバー | 2,000 | 2,623.00 | 5,246,000 |
| キングジム | 8,400 | 990.00 | 8,316,000 |
| リンテック | 15,400 | 2,421.00 | 37,283,400 |
| イトーキ | 18,200 | 381.00 | 6,934,200 |
| 任天堂 | 40,900 | 61,450.00 | 2,513,305,000 |
| 三菱鉛筆 | 11,500 | 1,540.00 | 17,710,000 |
| タカラスタンダード | 14,300 | 1,594.00 | 22,794,200 |

| | | | | |
|--------------|---------|----------|-------------|--|
| コクヨ | 34,600 | 1,717.00 | 59,408,200 | |
| ナカバヤシ | 10,500 | 600.00 | 6,300,000 | |
| グロープライド | 3,500 | 4,470.00 | 15,645,000 | |
| オカムラ | 27,500 | 1,271.00 | 34,952,500 | |
| 美津濃 | 7,000 | 2,242.00 | 15,694,000 | |
| 東京電力ホールディングス | 603,000 | 318.00 | 191,754,000 | |
| 中部電力 | 218,200 | 1,297.00 | 283,005,400 | |
| 関西電力 | 271,500 | 1,086.00 | 294,849,000 | |
| 中国電力 | 101,800 | 1,247.00 | 126,944,600 | |
| 北陸電力 | 68,000 | 714.00 | 48,552,000 | |
| 東北電力 | 163,500 | 994.00 | 162,519,000 | |
| 四国電力 | 60,400 | 797.00 | 48,138,800 | |
| 九州電力 | 155,400 | 999.00 | 155,244,600 | |
| 北海道電力 | 68,700 | 456.00 | 31,327,200 | |
| 沖縄電力 | 13,800 | 1,441.00 | 19,885,800 | |
| 電源開発 | 56,700 | 1,731.00 | 98,147,700 | |
| エフオン | 5,300 | 1,064.00 | 5,639,200 | |
| イーレックス | 10,900 | 1,840.00 | 20,056,000 | |
| レノバ | 12,200 | 3,450.00 | 42,090,000 | |
| 東京瓦斯 | 138,200 | 2,257.50 | 311,986,500 | |
| 大阪瓦斯 | 128,100 | 2,037.00 | 260,939,700 | |
| 東邦瓦斯 | 35,000 | 6,360.00 | 222,600,000 | |
| 北海道瓦斯 | 5,900 | 1,522.00 | 8,979,800 | |
| 広島ガス | 22,700 | 375.00 | 8,512,500 | |
| 西部ガスホールディングス | 8,300 | 2,584.00 | 21,447,200 | |
| 静岡ガス | 20,300 | 930.00 | 18,879,000 | |
| メタウォーター | 8,300 | 2,274.00 | 18,874,200 | |
| SBSホールディングス | 5,200 | 2,695.00 | 14,014,000 | |
| 東武鉄道 | 73,500 | 2,884.00 | 211,974,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 25,100 | 2,340.00 | 58,734,000 | |
| 東急 | 178,600 | 1,408.00 | 251,468,800 | |
| 京浜急行電鉄 | 91,600 | 1,453.00 | 133,094,800 | |
| 小田急電鉄 | 113,800 | 2,956.00 | 336,392,800 | |
| 京王電鉄 | 39,700 | 7,080.00 | 281,076,000 | |
| 京成電鉄 | 53,500 | 3,470.00 | 185,645,000 | |
| 富士急行 | 9,800 | 5,420.00 | 53,116,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 新京成電鉄 | 3,300 | 2,188.00 | 7,220,400 | |
| 東日本旅客鉄道 | 125,900 | 7,577.00 | 953,944,300 | |
| 西日本旅客鉄道 | 64,100 | 6,052.00 | 387,933,200 | |
| 東海旅客鉄道 | 59,400 | 16,360.00 | 971,784,000 | |
| 西武ホールディングス | 87,200 | 1,171.00 | 102,111,200 | |
| 鴻池運輸 | 11,500 | 1,125.00 | 12,937,500 | |
| 西日本鉄道 | 20,200 | 2,870.00 | 57,974,000 | |
| ハマキョウレックス | 5,600 | 3,060.00 | 17,136,000 | |
| サカイ引越センター | 3,200 | 5,040.00 | 16,128,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 67,100 | 3,995.00 | 268,064,500 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 89,400 | 3,485.00 | 311,559,000 | |
| 南海電気鉄道 | 32,900 | 2,446.00 | 80,473,400 | |
| 京阪ホールディングス | 29,900 | 3,995.00 | 119,450,500 | |
| 神戸電鉄 | 2,800 | 3,565.00 | 9,982,000 | |
| 名古屋鉄道 | 54,800 | 2,549.00 | 139,685,200 | |
| 山陽電気鉄道 | 6,300 | 1,854.00 | 11,680,200 | |
| 日本通運 | 23,200 | 7,930.00 | 183,976,000 | |
| ヤマトホールディングス | 94,800 | 2,969.00 | 281,461,200 | |
| 山九 | 17,300 | 4,685.00 | 81,050,500 | |
| 丸全昭和運輸 | 5,300 | 3,180.00 | 16,854,000 | |
| センコーグループホールディングス | 36,100 | 1,004.00 | 36,244,400 | |
| トナミホールディングス | 1,900 | 5,290.00 | 10,051,000 | |
| ニッコンホールディングス | 23,200 | 2,234.00 | 51,828,800 | |
| 福山通運 | 8,500 | 4,285.00 | 36,422,500 | |
| セイノーホールディングス | 50,400 | 1,512.00 | 76,204,800 | |
| 神奈川中央交通 | 2,400 | 3,605.00 | 8,652,000 | |
| 日立物流 | 14,600 | 3,285.00 | 47,961,000 | |
| 丸和運輸機関 | 13,800 | 1,933.00 | 26,675,400 | |
| C & F ロジホールディングス | 7,000 | 1,732.00 | 12,124,000 | |
| 九州旅客鉄道 | 52,500 | 2,486.00 | 130,515,000 | |
| S Gホールディングス | 127,700 | 2,517.00 | 321,420,900 | |
| 日本郵船 | 55,700 | 4,090.00 | 227,813,000 | |
| 商船三井 | 39,800 | 4,150.00 | 165,170,000 | |
| 川崎汽船 | 20,800 | 2,869.00 | 59,675,200 | |
| N S ユナイテッド海運 | 4,500 | 2,154.00 | 9,693,000 | |
| 飯野海運 | 34,600 | 528.00 | 18,268,800 | |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|--|
| 乾汽船 | 6,500 | 1,194.00 | 7,761,000 | |
| 日本航空 | 164,600 | 2,302.00 | 378,909,200 | |
| A N Aホールディングス | 182,700 | 2,506.50 | 457,937,550 | |
| トランコム | 2,200 | 8,750.00 | 19,250,000 | |
| 日新 | 6,700 | 1,336.00 | 8,951,200 | |
| 三菱倉庫 | 23,700 | 3,180.00 | 75,366,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 7,500 | 2,167.00 | 16,252,500 | |
| 住友倉庫 | 23,600 | 1,401.00 | 33,063,600 | |
| 澁澤倉庫 | 4,500 | 2,108.00 | 9,486,000 | |
| 東陽倉庫 | 20,900 | 322.00 | 6,729,800 | |
| 日本トランスシティ | 18,000 | 512.00 | 9,216,000 | |
| 川西倉庫 | 4,000 | 1,181.00 | 4,724,000 | |
| 安田倉庫 | 7,600 | 931.00 | 7,075,600 | |
| 東洋埠頭 | 4,900 | 1,497.00 | 7,335,300 | |
| 上組 | 37,000 | 2,136.00 | 79,032,000 | |
| 近鉄エクスプレス | 12,700 | 2,551.00 | 32,397,700 | |
| エーアイティー | 6,800 | 1,026.00 | 6,976,800 | |
| N E C ネットエスアイ | 22,400 | 1,833.00 | 41,059,200 | |
| システナ | 24,800 | 2,221.00 | 55,080,800 | |
| デジタルアーツ | 4,100 | 8,930.00 | 36,613,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 10,200 | 3,515.00 | 35,853,000 | |
| キューブシステム | 5,100 | 1,158.00 | 5,905,800 | |
| コア | 4,500 | 1,505.00 | 6,772,500 | |
| ラクーンホールディングス | 5,900 | 2,949.00 | 17,399,100 | |
| ソリトンシステムズ | 4,300 | 1,807.00 | 7,770,100 | |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 3,200 | 2,546.00 | 8,147,200 | |
| T I S | 69,800 | 2,680.00 | 187,064,000 | |
| 電算システム | 3,400 | 3,285.00 | 11,169,000 | |
| グリー | 44,100 | 566.00 | 24,960,600 | |
| G M O ベパボ | 700 | 6,410.00 | 4,487,000 | |
| コーエーテクモホールディングス | 18,500 | 4,875.00 | 90,187,500 | |
| 三菱総合研究所 | 3,100 | 3,940.00 | 12,214,000 | |
| ファインデックス | 7,800 | 1,197.00 | 9,336,600 | |
| ブレインパッド | 2,100 | 5,370.00 | 11,277,000 | |
| K L a b | 14,300 | 835.00 | 11,940,500 | |

| | | | |
|------------------------|---------|-----------|-------------|
| ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス | 10,500 | 1,193.00 | 12,526,500 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 1,500 | 2,746.00 | 4,119,000 |
| ネクソン | 177,100 | 3,625.00 | 641,987,500 |
| アイスタイル | 13,900 | 475.00 | 6,602,500 |
| エムアップホールディングス | 2,200 | 2,903.00 | 6,386,600 |
| エイチーム | 6,600 | 1,724.00 | 11,378,400 |
| エニグモ | 7,400 | 1,300.00 | 9,620,000 |
| テクノスジャパン | 8,900 | 671.00 | 5,971,900 |
| コロプラ | 23,700 | 808.00 | 19,149,600 |
| ブロードリーフ | 36,500 | 546.00 | 19,929,000 |
| デジタルハーツホールディングス | 4,600 | 1,526.00 | 7,019,600 |
| システム情報 | 5,800 | 1,022.00 | 5,927,600 |
| メディアドゥ | 2,700 | 6,060.00 | 16,362,000 |
| じげん | 22,000 | 402.00 | 8,844,000 |
| ブイキューブ | 4,100 | 3,225.00 | 13,222,500 |
| サイバーリンクス | 2,700 | 1,621.00 | 4,376,700 |
| フィックスターズ | 9,500 | 990.00 | 9,405,000 |
| CARTA HOLDINGS | 4,000 | 1,473.00 | 5,892,000 |
| オブティム | 5,200 | 2,851.00 | 14,825,200 |
| セレス | 2,600 | 4,005.00 | 10,413,000 |
| SHIFT | 3,100 | 15,400.00 | 47,740,000 |
| ティーガイア | 7,100 | 1,901.00 | 13,497,100 |
| テクマトリックス | 11,400 | 2,156.00 | 24,578,400 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 17,400 | 2,183.00 | 37,984,200 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 14,900 | 13,780.00 | 205,322,000 |
| システムリサーチ | 3,000 | 1,981.00 | 5,943,000 |
| インターネットイニシアティブ | 18,900 | 2,518.00 | 47,590,200 |
| さくらインターネット | 10,300 | 799.00 | 8,229,700 |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 1,600 | 6,340.00 | 10,144,000 |
| SRAホールディングス | 4,700 | 2,628.00 | 12,351,600 |
| 朝日ネット | 7,500 | 752.00 | 5,640,000 |
| eBASE | 9,300 | 1,014.00 | 9,430,200 |
| アバント | 8,000 | 1,785.00 | 14,280,000 |
| アドソル日進 | 3,100 | 2,753.00 | 8,534,300 |
| フリービット | 6,000 | 924.00 | 5,544,000 |

| | | | |
|-----------------------|---------|----------|-------------|
| コムチュア | 6,300 | 2,656.00 | 16,732,800 |
| アステリア | 6,400 | 850.00 | 5,440,000 |
| アイル | 4,700 | 1,799.00 | 8,455,300 |
| マークラインズ | 3,700 | 3,030.00 | 11,211,000 |
| メディカル・データ・ビジョン | 8,300 | 2,045.00 | 16,973,500 |
| g u m i | 11,200 | 1,222.00 | 13,686,400 |
| テラスカイ | 2,600 | 3,045.00 | 7,917,000 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 4,400 | 2,182.00 | 9,600,800 |
| P C Iホールディングス | 4,000 | 1,433.00 | 5,732,000 |
| ネオジャパン | 2,100 | 1,698.00 | 3,565,800 |
| P R T I M E S | 1,700 | 3,405.00 | 5,788,500 |
| ダブルスタンダード | 1,400 | 3,875.00 | 5,425,000 |
| オープンドア | 4,900 | 1,966.00 | 9,633,400 |
| アカツキ | 2,900 | 4,155.00 | 12,049,500 |
| U b i c o mホールディングス | 2,100 | 3,360.00 | 7,056,000 |
| カナミックネットワーク | 8,500 | 707.00 | 6,009,500 |
| チェンジ | 9,900 | 3,575.00 | 35,392,500 |
| オークネット | 5,300 | 1,325.00 | 7,022,500 |
| エイトレッド | 2,000 | 2,732.00 | 5,464,000 |
| マクロミル | 16,700 | 879.00 | 14,679,300 |
| オロ | 2,500 | 3,590.00 | 8,975,000 |
| ユーザーローカル | 1,300 | 4,695.00 | 6,103,500 |
| プロトコーポレーション | 8,000 | 1,203.00 | 9,624,000 |
| 野村総合研究所 | 127,700 | 3,310.00 | 422,687,000 |
| サイバネットシステム | 6,700 | 874.00 | 5,855,800 |
| インテージホールディングス | 10,200 | 1,336.00 | 13,627,200 |
| ソースネクスト | 38,400 | 331.00 | 12,710,400 |
| インフォコム | 6,500 | 2,940.00 | 19,110,000 |
| HEROZ | 2,200 | 2,852.00 | 6,274,400 |
| ラクスル | 6,000 | 5,450.00 | 32,700,000 |
| I P S | 1,600 | 2,540.00 | 4,064,000 |
| イーソル | 5,100 | 1,229.00 | 6,267,900 |
| アルテリア・ネットワークス | 8,400 | 1,572.00 | 13,204,800 |
| E d u L a b | 900 | 7,390.00 | 6,651,000 |
| ギフトィ | 3,400 | 3,255.00 | 11,067,000 |
| ベース | 800 | 6,440.00 | 5,152,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| フォーカスシステムズ | 6,900 | 920.00 | 6,348,000 |
| クレスコ | 6,300 | 1,660.00 | 10,458,000 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 72,400 | 1,322.00 | 95,712,800 |
| オービック | 22,000 | 20,740.00 | 456,280,000 |
| ジャストシステム | 9,900 | 6,530.00 | 64,647,000 |
| TDCソフト | 7,700 | 1,052.00 | 8,100,400 |
| Zホールディングス | 964,800 | 517.60 | 499,380,480 |
| トレンドマイクロ | 37,500 | 5,330.00 | 199,875,000 |
| 日本オラクル | 14,200 | 10,300.00 | 146,260,000 |
| アルファシステムズ | 2,200 | 3,615.00 | 7,953,000 |
| フューチャー | 8,800 | 1,984.00 | 17,459,200 |
| CAC Holdings | 6,100 | 1,443.00 | 8,802,300 |
| S Bテクノロジー | 2,800 | 3,250.00 | 9,100,000 |
| オービックビジネスコンサルタント | 7,000 | 6,190.00 | 43,330,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 31,400 | 3,635.00 | 114,139,000 |
| アイティフォー | 11,200 | 793.00 | 8,881,600 |
| 大塚商会 | 37,700 | 5,370.00 | 202,449,000 |
| サイボウズ | 8,300 | 2,527.00 | 20,974,100 |
| 電通国際情報サービス | 8,700 | 4,000.00 | 34,800,000 |
| ACCESS | 9,900 | 888.00 | 8,791,200 |
| デジタルガレージ | 11,900 | 4,600.00 | 54,740,000 |
| EMシステムズ | 13,100 | 844.00 | 11,056,400 |
| ウェザーニューズ | 2,400 | 5,470.00 | 13,128,000 |
| C I J | 6,500 | 900.00 | 5,850,000 |
| WOWOW | 3,500 | 2,735.00 | 9,572,500 |
| スカラ | 8,600 | 801.00 | 6,888,600 |
| ネットワンシステムズ | 28,800 | 3,370.00 | 97,056,000 |
| アルゴグラフィックス | 5,500 | 3,210.00 | 17,655,000 |
| マーベラス | 12,800 | 841.00 | 10,764,800 |
| エイベックス | 12,600 | 1,488.00 | 18,748,800 |
| 日本ユニシス | 24,500 | 3,455.00 | 84,647,500 |
| 兼松エレクトロニクス | 3,700 | 3,660.00 | 13,542,000 |
| 都築電気 | 3,300 | 1,861.00 | 6,141,300 |
| TBSホールディングス | 46,700 | 2,127.00 | 99,330,900 |
| 日本テレビホールディングス | 58,200 | 1,427.00 | 83,051,400 |
| 朝日放送グループホールディングス | 11,000 | 698.00 | 7,678,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|-----------|---------------|
| テレビ朝日ホールディングス | 21,900 | 1,999.00 | 43,778,100 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 47,900 | 474.00 | 22,704,600 |
| テレビ東京ホールディングス | 5,200 | 2,281.00 | 11,861,200 |
| ビジョン | 10,100 | 1,020.00 | 10,302,000 |
| USEN - NEXT HOLDINGS | 3,100 | 2,219.00 | 6,878,900 |
| コネクシオ | 4,500 | 1,383.00 | 6,223,500 |
| 日本電信電話 | 818,500 | 2,778.50 | 2,274,202,250 |
| K D D I | 561,700 | 3,318.00 | 1,863,720,600 |
| ソフトバンク | 636,500 | 1,426.00 | 907,649,000 |
| 光通信 | 8,200 | 22,050.00 | 180,810,000 |
| エムティーアイ | 9,500 | 783.00 | 7,438,500 |
| GMOインターネット | 25,500 | 3,175.00 | 80,962,500 |
| ファイバーゲート | 2,800 | 1,583.00 | 4,432,400 |
| K A D O K A W A | 19,000 | 4,325.00 | 82,175,000 |
| 学研ホールディングス | 9,600 | 1,405.00 | 13,488,000 |
| ゼンリン | 13,900 | 1,252.00 | 17,402,800 |
| アイネット | 5,000 | 1,476.00 | 7,380,000 |
| 松竹 | 4,700 | 12,620.00 | 59,314,000 |
| 東宝 | 41,300 | 4,445.00 | 183,578,500 |
| 東映 | 2,300 | 23,970.00 | 55,131,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 185,700 | 1,690.00 | 313,833,000 |
| ピー・シー・エー | 1,400 | 4,950.00 | 6,930,000 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 3,200 | 1,841.00 | 5,891,200 |
| D T S | 13,700 | 2,538.00 | 34,770,600 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 29,900 | 6,330.00 | 189,267,000 |
| シーイーシー | 8,500 | 1,403.00 | 11,925,500 |
| カブコン | 60,000 | 3,525.00 | 211,500,000 |
| アイ・エス・ピー | 4,200 | 1,229.00 | 5,161,800 |
| ジャステック | 5,800 | 1,257.00 | 7,290,600 |
| S C S K | 16,200 | 6,450.00 | 104,490,000 |
| 日本システムウエア | 3,000 | 2,041.00 | 6,123,000 |
| アイネス | 8,500 | 1,403.00 | 11,925,500 |
| T K C | 11,400 | 3,465.00 | 39,501,000 |
| 富士ソフト | 7,400 | 5,480.00 | 40,552,000 |
| N S D | 22,400 | 1,779.00 | 39,849,600 |
| コナミホールディングス | 25,400 | 6,490.00 | 164,846,000 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| 福井コンピュータホールディングス | 3,600 | 4,470.00 | 16,092,000 |
| J B C Cホールディングス | 6,000 | 1,401.00 | 8,406,000 |
| ミロク情報サービス | 7,400 | 1,911.00 | 14,141,400 |
| ソフトバンクグループ | 556,000 | 10,135.00 | 5,635,060,000 |
| 伊藤忠食品 | 2,000 | 5,150.00 | 10,300,000 |
| エレマテック | 7,500 | 1,181.00 | 8,857,500 |
| あらた | 5,500 | 4,510.00 | 24,805,000 |
| 東京エレクトロン デバイス | 2,700 | 5,240.00 | 14,148,000 |
| フィールズ | 9,400 | 504.00 | 4,737,600 |
| 双日 | 384,200 | 308.00 | 118,333,600 |
| アルフレッサ ホールディングス | 72,700 | 1,991.00 | 144,745,700 |
| 横浜冷凍 | 18,400 | 888.00 | 16,339,200 |
| アルコニックス | 8,000 | 1,500.00 | 12,000,000 |
| 神戸物産 | 48,400 | 3,095.00 | 149,798,000 |
| あい ホールディングス | 10,800 | 2,124.00 | 22,939,200 |
| ダイワボウホールディングス | 31,500 | 1,694.00 | 53,361,000 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 16,700 | 2,218.00 | 37,040,600 |
| ラクト・ジャパン | 3,500 | 2,823.00 | 9,880,500 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 14,400 | 712.00 | 10,252,800 |
| 八洲電機 | 8,800 | 963.00 | 8,474,400 |
| レスターホールディングス | 7,700 | 1,983.00 | 15,269,100 |
| ジュテックホールディングス | 3,200 | 1,014.00 | 3,244,800 |
| T O K A Iホールディングス | 32,400 | 898.00 | 29,095,200 |
| 三洋貿易 | 8,900 | 1,080.00 | 9,612,000 |
| ウイン・パートナーズ | 5,900 | 991.00 | 5,846,900 |
| シップヘルスケアホールディングス | 25,000 | 2,890.00 | 72,250,000 |
| コメダホールディングス | 15,200 | 2,004.00 | 30,460,800 |
| アセンテック | 2,400 | 1,513.00 | 3,631,200 |
| 小野建 | 7,400 | 1,305.00 | 9,657,000 |
| 佐鳥電機 | 7,800 | 799.00 | 6,232,200 |
| 伯東 | 5,700 | 1,259.00 | 7,176,300 |
| コンドーテック | 7,100 | 1,010.00 | 7,171,000 |
| ナガイレーベン | 9,700 | 2,613.00 | 25,346,100 |
| 三菱食品 | 6,900 | 3,015.00 | 20,803,500 |
| 松田産業 | 5,900 | 2,215.00 | 13,068,500 |
| 第一興商 | 11,000 | 4,385.00 | 48,235,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|---------------|
| メディバルホールディングス | 69,700 | 2,063.00 | 143,791,100 |
| S P K | 5,500 | 1,301.00 | 7,155,500 |
| 萩原電気ホールディングス | 3,400 | 2,555.00 | 8,687,000 |
| アズワン | 5,100 | 14,060.00 | 71,706,000 |
| 尾家産業 | 4,000 | 1,207.00 | 4,828,000 |
| シモジマ | 6,000 | 1,202.00 | 7,212,000 |
| ドウシシャ | 6,700 | 1,865.00 | 12,495,500 |
| 高速 | 5,000 | 1,412.00 | 7,060,000 |
| 丸文 | 10,900 | 512.00 | 5,580,800 |
| ハピネット | 6,900 | 1,476.00 | 10,184,400 |
| 日本ライフライン | 22,700 | 1,516.00 | 34,413,200 |
| タカショー | 7,500 | 757.00 | 5,677,500 |
| マルカ | 3,600 | 1,984.00 | 7,142,400 |
| I D O M | 25,700 | 647.00 | 16,627,900 |
| 進和 | 5,200 | 2,100.00 | 10,920,000 |
| ダイترون | 4,100 | 1,869.00 | 7,662,900 |
| シークス | 9,800 | 1,485.00 | 14,553,000 |
| オーハシテクニカ | 5,300 | 1,438.00 | 7,621,400 |
| 伊藤忠商事 | 490,800 | 3,430.00 | 1,683,444,000 |
| 丸紅 | 694,000 | 899.50 | 624,253,000 |
| 長瀬産業 | 39,700 | 1,679.00 | 66,656,300 |
| 蝶理 | 5,600 | 1,573.00 | 8,808,800 |
| 豊田通商 | 70,100 | 4,755.00 | 333,325,500 |
| 三共生興 | 16,400 | 520.00 | 8,528,000 |
| 兼松 | 27,400 | 1,422.00 | 38,962,800 |
| 三井物産 | 570,300 | 2,269.50 | 1,294,295,850 |
| 日本紙パルプ商事 | 3,900 | 3,645.00 | 14,215,500 |
| カメイ | 9,700 | 1,168.00 | 11,329,600 |
| スターゼン | 5,800 | 2,327.00 | 13,496,600 |
| 山善 | 26,400 | 992.00 | 26,188,800 |
| 椿本興業 | 1,800 | 3,510.00 | 6,318,000 |
| 住友商事 | 444,600 | 1,498.00 | 666,010,800 |
| 内田洋行 | 3,000 | 4,765.00 | 14,295,000 |
| 三菱商事 | 427,400 | 3,012.00 | 1,287,328,800 |
| 第一実業 | 3,400 | 4,145.00 | 14,093,000 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 17,700 | 2,601.00 | 46,037,700 |

| | | | |
|-------------------|--------|----------|-------------|
| 西華産業 | 5,600 | 1,668.00 | 9,340,800 |
| 佐藤商事 | 7,900 | 992.00 | 7,836,800 |
| 菱洋エレクトロ | 5,500 | 2,700.00 | 14,850,000 |
| 東京産業 | 10,100 | 600.00 | 6,060,000 |
| ユアサ商事 | 7,100 | 3,020.00 | 21,442,000 |
| 阪和興業 | 13,800 | 3,195.00 | 44,091,000 |
| 正栄食品工業 | 4,600 | 4,190.00 | 19,274,000 |
| カナデン | 7,200 | 1,148.00 | 8,265,600 |
| 菱電商事 | 6,400 | 1,640.00 | 10,496,000 |
| フルサト工業 | 5,500 | 1,314.00 | 7,227,000 |
| 岩谷産業 | 17,000 | 6,760.00 | 114,920,000 |
| 極東貿易 | 3,700 | 1,361.00 | 5,035,700 |
| イワキ | 10,800 | 748.00 | 8,078,400 |
| 三愛石油 | 17,600 | 1,250.00 | 22,000,000 |
| 稲畑産業 | 16,400 | 1,654.00 | 27,125,600 |
| G S Iクレオス | 5,200 | 1,176.00 | 6,115,200 |
| ヤマエ久野 | 6,800 | 1,058.00 | 7,194,400 |
| ワキタ | 14,400 | 1,063.00 | 15,307,200 |
| 東邦ホールディングス | 23,100 | 1,874.00 | 43,289,400 |
| サンゲツ | 18,800 | 1,543.00 | 29,008,400 |
| ミツウロコグループホールディングス | 10,600 | 1,444.00 | 15,306,400 |
| シナネンホールディングス | 3,100 | 3,030.00 | 9,393,000 |
| 伊藤忠エネクス | 14,400 | 1,045.00 | 15,048,000 |
| サンリオ | 19,600 | 1,792.00 | 35,123,200 |
| サンワテクノス | 6,000 | 1,108.00 | 6,648,000 |
| リョーサン | 8,200 | 2,161.00 | 17,720,200 |
| 新光商事 | 12,800 | 751.00 | 9,612,800 |
| トーヨー | 4,700 | 1,794.00 | 8,431,800 |
| 三信電気 | 4,800 | 2,145.00 | 10,296,000 |
| 東陽テクニカ | 9,200 | 1,066.00 | 9,807,200 |
| モスフードサービス | 10,200 | 3,050.00 | 31,110,000 |
| 加賀電子 | 6,700 | 2,385.00 | 15,979,500 |
| ソーダニッカ | 12,000 | 546.00 | 6,552,000 |
| 立花エレテック | 6,100 | 1,589.00 | 9,692,900 |
| P A L T A C | 11,300 | 5,840.00 | 65,992,000 |
| 三谷産業 | 12,400 | 453.00 | 5,617,200 |

| | | | |
|---------------------|--------|----------|-------------|
| 太平洋興発 | 7,700 | 668.00 | 5,143,600 |
| 西本Wismettacホールディングス | 2,300 | 2,710.00 | 6,233,000 |
| 国際紙バルブ商事 | 24,700 | 239.00 | 5,903,300 |
| ヤマタネ | 4,700 | 1,486.00 | 6,984,200 |
| 日鉄物産 | 4,600 | 3,855.00 | 17,733,000 |
| 泉州電業 | 2,500 | 3,605.00 | 9,012,500 |
| トラスコ中山 | 15,800 | 2,766.00 | 43,702,800 |
| オートバックスセブン | 27,800 | 1,472.00 | 40,921,600 |
| モリト | 10,000 | 606.00 | 6,060,000 |
| 加藤産業 | 9,600 | 3,245.00 | 31,152,000 |
| イノテック | 5,500 | 1,316.00 | 7,238,000 |
| イエローハット | 13,300 | 1,845.00 | 24,538,500 |
| J Kホールディングス | 8,100 | 807.00 | 6,536,700 |
| 日伝 | 6,100 | 2,119.00 | 12,925,900 |
| 杉本商事 | 4,100 | 2,291.00 | 9,393,100 |
| 因幡電機産業 | 18,000 | 2,583.00 | 46,494,000 |
| 東テク | 2,900 | 2,972.00 | 8,618,800 |
| ミスミグループ本社 | 88,000 | 3,110.00 | 273,680,000 |
| タキヒヨー | 4,100 | 1,925.00 | 7,892,500 |
| スズケン | 29,900 | 3,955.00 | 118,254,500 |
| ジェコス | 6,700 | 922.00 | 6,177,400 |
| ローソン | 18,000 | 5,060.00 | 91,080,000 |
| サンエー | 5,000 | 4,295.00 | 21,475,000 |
| カワチ薬品 | 5,000 | 2,568.00 | 12,840,000 |
| エービーシー・マート | 11,000 | 5,940.00 | 65,340,000 |
| アスクル | 6,400 | 3,970.00 | 25,408,000 |
| ゲオホールディングス | 9,800 | 1,117.00 | 10,946,600 |
| アダストリア | 10,200 | 1,819.00 | 18,553,800 |
| くら寿司 | 4,300 | 7,720.00 | 33,196,000 |
| キャンドウ | 4,900 | 2,147.00 | 10,520,300 |
| パルグループホールディングス | 7,300 | 1,562.00 | 11,402,600 |
| エディオン | 28,000 | 1,166.00 | 32,648,000 |
| サーラコーポレーション | 16,100 | 607.00 | 9,772,700 |
| ハローズ | 3,000 | 2,960.00 | 8,880,000 |
| フジオフードグループ本社 | 7,900 | 1,411.00 | 11,146,900 |
| あみやき亭 | 2,700 | 2,776.00 | 7,495,200 |

| | | | |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| 大黒天物産 | 1,900 | 8,260.00 | 15,694,000 |
| ハニーズホールディングス | 6,800 | 1,046.00 | 7,112,800 |
| アルペン | 5,800 | 2,406.00 | 13,954,800 |
| クオールホールディングス | 10,700 | 1,417.00 | 15,161,900 |
| ジinzホールディングス | 4,000 | 8,010.00 | 32,040,000 |
| ビックカメラ | 41,700 | 1,133.00 | 47,246,100 |
| D C Mホールディングス | 42,900 | 1,112.00 | 47,704,800 |
| Monotaro | 100,200 | 2,820.00 | 282,564,000 |
| アークランドサービスホールディングス | 6,500 | 2,184.00 | 14,196,000 |
| J . フロント リテイリング | 85,800 | 994.00 | 85,285,200 |
| ドトール・日レスホールディングス | 11,500 | 1,615.00 | 18,572,500 |
| マツモトキヨシホールディングス | 29,000 | 4,525.00 | 131,225,000 |
| ブロンコビリー | 5,000 | 2,401.00 | 12,005,000 |
| Z O Z O | 41,800 | 3,485.00 | 145,673,000 |
| 物語コーポレーション | 4,000 | 7,290.00 | 29,160,000 |
| ココカラファイン | 6,200 | 7,700.00 | 47,740,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 124,400 | 735.00 | 91,434,000 |
| H a m e e | 2,300 | 1,673.00 | 3,847,900 |
| ウエルシアホールディングス | 37,100 | 3,555.00 | 131,890,500 |
| クリエイトSDホールディングス | 10,200 | 3,370.00 | 34,374,000 |
| シュッピン | 6,800 | 1,117.00 | 7,595,600 |
| オイシックス・ラ・大地 | 7,200 | 3,005.00 | 21,636,000 |
| ネクステージ | 12,200 | 1,756.00 | 21,423,200 |
| ジョイフル本田 | 20,100 | 1,365.00 | 27,436,500 |
| ホットランド | 8,000 | 1,293.00 | 10,344,000 |
| すかいらーくホールディングス | 80,000 | 1,631.00 | 130,480,000 |
| S F Pホールディングス | 5,300 | 1,322.00 | 7,006,600 |
| 綿半ホールディングス | 6,600 | 1,303.00 | 8,599,800 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 19,700 | 1,152.00 | 22,694,400 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 5,800 | 1,529.00 | 8,868,200 |
| B E E N O S | 3,800 | 2,945.00 | 11,191,000 |
| あさひ | 5,600 | 1,499.00 | 8,394,400 |
| 日本調剤 | 5,500 | 1,693.00 | 9,311,500 |
| コスモス薬品 | 7,100 | 15,990.00 | 113,529,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 275,200 | 4,520.00 | 1,243,904,000 |

| | | | | |
|-----------------------|---------|-----------|-------------|--|
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 39,300 | 752.00 | 29,553,600 | |
| ツルハホールディングス | 15,300 | 12,830.00 | 196,299,000 | |
| サンマルクホールディングス | 7,300 | 1,660.00 | 12,118,000 | |
| トリドールホールディングス | 18,100 | 1,715.00 | 31,041,500 | |
| J Mホールディングス | 6,100 | 2,090.00 | 12,749,000 | |
| アレンザホールディングス | 5,400 | 1,278.00 | 6,901,200 | |
| パロックジャパンリミテッド | 8,000 | 756.00 | 6,048,000 | |
| クスリのアオキホールディングス | 7,200 | 8,080.00 | 58,176,000 | |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 38,700 | 5,100.00 | 197,370,000 | |
| メディカルシステムネットワーク | 8,300 | 837.00 | 6,947,100 | |
| ノジマ | 12,400 | 2,796.00 | 34,670,400 | |
| カップ・クリエイト | 11,300 | 1,440.00 | 16,272,000 | |
| 良品計画 | 93,800 | 2,308.00 | 216,490,400 | |
| アドヴァン | 8,300 | 961.00 | 7,976,300 | |
| アルビス | 3,000 | 2,364.00 | 7,092,000 | |
| コナカ | 18,700 | 329.00 | 6,152,300 | |
| G - 7ホールディングス | 4,600 | 2,831.00 | 13,022,600 | |
| イオン北海道 | 11,100 | 1,108.00 | 12,298,800 | |
| コジマ | 14,000 | 874.00 | 12,236,000 | |
| コーナン商事 | 9,800 | 3,035.00 | 29,743,000 | |
| エコス | 3,400 | 1,891.00 | 6,429,400 | |
| ワタミ | 11,400 | 961.00 | 10,955,400 | |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 140,400 | 2,425.00 | 340,470,000 | |
| 西松屋チェーン | 15,900 | 1,672.00 | 26,584,800 | |
| ゼンショーホールディングス | 38,200 | 2,790.00 | 106,578,000 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 6,100 | 1,609.00 | 9,814,900 | |
| サイゼリヤ | 11,400 | 2,349.00 | 26,778,600 | |
| V Tホールディングス | 29,100 | 415.00 | 12,076,500 | |
| フジ・コーポレーション | 3,000 | 2,719.00 | 8,157,000 | |
| ユナイテッドアローズ | 8,800 | 1,905.00 | 16,764,000 | |
| ハイデイ日高 | 10,400 | 1,686.00 | 17,534,400 | |
| コロワイド | 18,900 | 1,827.00 | 34,530,300 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 11,400 | 459.00 | 5,232,600 | |
| 壱番屋 | 5,100 | 4,865.00 | 24,811,500 | |
| スギホールディングス | 14,100 | 8,720.00 | 122,952,000 | |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| 薬王堂ホールディングス | 3,500 | 2,411.00 | 8,438,500 |
| スクロール | 10,700 | 1,017.00 | 10,881,900 |
| ヨンドシーホールディングス | 7,200 | 1,878.00 | 13,521,600 |
| 木曽路 | 9,700 | 2,296.00 | 22,271,200 |
| S R S ホールディングス | 12,000 | 815.00 | 9,780,000 |
| 千趣会 | 19,800 | 388.00 | 7,682,400 |
| リテールパートナーズ | 9,200 | 1,283.00 | 11,803,600 |
| ケーヨー | 16,300 | 723.00 | 11,784,900 |
| 上新電機 | 8,200 | 2,762.00 | 22,648,400 |
| 日本瓦斯 | 35,100 | 1,880.00 | 65,988,000 |
| ロイヤルホールディングス | 9,200 | 1,921.00 | 17,673,200 |
| いなげや | 8,000 | 1,648.00 | 13,184,000 |
| チヨダ | 11,100 | 892.00 | 9,901,200 |
| ライフコーポレーション | 5,400 | 3,710.00 | 20,034,000 |
| リンガーハット | 9,800 | 2,224.00 | 21,795,200 |
| MrMaxHD | 11,600 | 668.00 | 7,748,800 |
| AOKIホールディングス | 17,900 | 590.00 | 10,561,000 |
| オークワ | 11,600 | 1,188.00 | 13,780,800 |
| コメリ | 10,800 | 2,923.00 | 31,568,400 |
| 青山商事 | 19,500 | 798.00 | 15,561,000 |
| しまむら | 8,100 | 11,190.00 | 90,639,000 |
| 高島屋 | 53,500 | 1,164.00 | 62,274,000 |
| 松屋 | 17,400 | 907.00 | 15,781,800 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 34,000 | 834.00 | 28,356,000 |
| 近鉄百貨店 | 3,200 | 3,135.00 | 10,032,000 |
| 丸井グループ | 60,300 | 2,062.00 | 124,338,600 |
| アクシアル リテイリング | 5,700 | 4,620.00 | 26,334,000 |
| イオン | 270,400 | 3,026.00 | 818,230,400 |
| イズミ | 14,600 | 4,410.00 | 64,386,000 |
| 平和堂 | 12,300 | 2,308.00 | 28,388,400 |
| フジ | 8,700 | 2,077.00 | 18,069,900 |
| ヤオコー | 8,100 | 7,190.00 | 58,239,000 |
| ゼビオホールディングス | 10,400 | 876.00 | 9,110,400 |
| ケーズホールディングス | 62,300 | 1,495.00 | 93,138,500 |
| 日産東京販売ホールディングス | 20,900 | 243.00 | 5,078,700 |
| Genky DrugStores | 3,200 | 3,410.00 | 10,912,000 |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|
| ブックオフグループホールディングス | 6,100 | 965.00 | 5,886,500 |
| アインホールディングス | 10,400 | 6,240.00 | 64,896,000 |
| 元気寿司 | 2,900 | 2,469.00 | 7,160,100 |
| ヤマダホールディングス | 234,300 | 558.00 | 130,739,400 |
| アークランドサカモト | 11,400 | 1,557.00 | 17,749,800 |
| ニトリホールディングス | 28,000 | 20,100.00 | 562,800,000 |
| グルメ杵屋 | 6,900 | 944.00 | 6,513,600 |
| 吉野家ホールディングス | 24,400 | 2,029.00 | 49,507,600 |
| 松屋フーズホールディングス | 3,600 | 3,495.00 | 12,582,000 |
| サガミホールディングス | 12,900 | 1,035.00 | 13,351,500 |
| 関西スーパーマーケット | 6,600 | 1,113.00 | 7,345,800 |
| 王将フードサービス | 4,600 | 5,610.00 | 25,806,000 |
| プレナス | 8,300 | 2,002.00 | 16,616,600 |
| ミニストップ | 6,900 | 1,429.00 | 9,860,100 |
| アークス | 13,100 | 2,407.00 | 31,531,700 |
| パローホールディングス | 13,900 | 2,380.00 | 33,082,000 |
| ベルク | 3,600 | 5,940.00 | 21,384,000 |
| ファーストリテイリング | 9,400 | 88,220.00 | 829,268,000 |
| サンドラッグ | 26,500 | 3,880.00 | 102,820,000 |
| ベルーナ | 15,800 | 1,219.00 | 19,260,200 |
| じもとホールディングス | 5,600 | 698.00 | 3,908,800 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 366,400 | 237.00 | 86,836,800 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 9,400 | 1,211.00 | 11,383,400 |
| 九州フィナンシャルグループ | 142,600 | 423.00 | 60,319,800 |
| ゆうちょ銀行 | 199,000 | 988.00 | 196,612,000 |
| 富山第一銀行 | 18,800 | 288.00 | 5,414,400 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 429,100 | 414.00 | 177,647,400 |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 47,900 | 698.00 | 33,434,200 |
| 三十三フィナンシャルグループ | 6,700 | 1,306.00 | 8,750,200 |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 11,500 | 2,361.00 | 27,151,500 |
| ひろぎんホールディングス | 104,600 | 603.00 | 63,073,800 |
| 新生銀行 | 57,800 | 1,603.00 | 92,653,400 |
| あおぞら銀行 | 42,200 | 2,341.00 | 98,790,200 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 4,819,900 | 572.50 | 2,759,392,750 |
| りそなホールディングス | 811,000 | 438.70 | 355,785,700 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 132,500 | 3,692.00 | 489,190,000 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|--|
| 三井住友フィナンシャルグループ | 487,200 | 3,767.00 | 1,835,282,400 | |
| 千葉銀行 | 235,500 | 685.00 | 161,317,500 | |
| 群馬銀行 | 145,900 | 359.00 | 52,378,100 | |
| 武蔵野銀行 | 10,500 | 1,649.00 | 17,314,500 | |
| 千葉興業銀行 | 20,200 | 266.00 | 5,373,200 | |
| 筑波銀行 | 30,600 | 166.00 | 5,079,600 | |
| 七十七銀行 | 22,300 | 1,360.00 | 30,328,000 | |
| 青森銀行 | 5,600 | 2,299.00 | 12,874,400 | |
| 秋田銀行 | 4,800 | 1,375.00 | 6,600,000 | |
| 山形銀行 | 8,600 | 1,018.00 | 8,754,800 | |
| 岩手銀行 | 4,800 | 2,107.00 | 10,113,600 | |
| 東邦銀行 | 67,000 | 217.00 | 14,539,000 | |
| 東北銀行 | 4,000 | 1,043.00 | 4,172,000 | |
| みちのく銀行 | 4,500 | 1,041.00 | 4,684,500 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 63,800 | 1,879.00 | 119,880,200 | |
| 静岡銀行 | 168,800 | 836.00 | 141,116,800 | |
| 十六銀行 | 8,900 | 2,021.00 | 17,986,900 | |
| スルガ銀行 | 64,200 | 390.00 | 25,038,000 | |
| 八十二銀行 | 154,500 | 367.00 | 56,701,500 | |
| 山梨中央銀行 | 8,100 | 815.00 | 6,601,500 | |
| 大垣共立銀行 | 14,200 | 1,986.00 | 28,201,200 | |
| 福井銀行 | 6,200 | 1,794.00 | 11,122,800 | |
| 北國銀行 | 6,700 | 2,547.00 | 17,064,900 | |
| 清水銀行 | 3,000 | 1,590.00 | 4,770,000 | |
| 富山銀行 | 1,500 | 2,747.00 | 4,120,500 | |
| 滋賀銀行 | 14,100 | 2,182.00 | 30,766,200 | |
| 南都銀行 | 10,400 | 1,814.00 | 18,865,600 | |
| 百五銀行 | 66,300 | 310.00 | 20,553,000 | |
| 京都銀行 | 25,300 | 5,970.00 | 151,041,000 | |
| 紀陽銀行 | 25,100 | 1,457.00 | 36,570,700 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 47,200 | 927.00 | 43,754,400 | |
| 山陰合同銀行 | 46,400 | 507.00 | 23,524,800 | |
| 中国銀行 | 61,200 | 863.00 | 52,815,600 | |
| 伊予銀行 | 92,600 | 598.00 | 55,374,800 | |
| 百十四銀行 | 7,500 | 1,541.00 | 11,557,500 | |
| 四国銀行 | 9,800 | 708.00 | 6,938,400 | |

| | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|
| 阿波銀行 | 11,000 | 2,206.00 | 24,266,000 |
| 大分銀行 | 4,500 | 1,957.00 | 8,806,500 |
| 宮崎銀行 | 4,900 | 2,260.00 | 11,074,000 |
| 佐賀銀行 | 4,500 | 1,383.00 | 6,223,500 |
| 沖縄銀行 | 6,700 | 2,749.00 | 18,418,300 |
| 琉球銀行 | 15,300 | 721.00 | 11,031,300 |
| セブン銀行 | 238,400 | 233.00 | 55,547,200 |
| みずほフィナンシャルグループ | 956,100 | 1,542.50 | 1,474,784,250 |
| 山口フィナンシャルグループ | 89,000 | 647.00 | 57,583,000 |
| 名古屋銀行 | 5,600 | 2,798.00 | 15,668,800 |
| 北洋銀行 | 108,200 | 277.00 | 29,971,400 |
| 愛知銀行 | 2,400 | 2,804.00 | 6,729,600 |
| 中京銀行 | 3,000 | 1,695.00 | 5,085,000 |
| 愛媛銀行 | 9,500 | 919.00 | 8,730,500 |
| 京葉銀行 | 32,400 | 417.00 | 13,510,800 |
| 栃木銀行 | 40,500 | 175.00 | 7,087,500 |
| 北日本銀行 | 2,700 | 1,812.00 | 4,892,400 |
| 東和銀行 | 12,600 | 613.00 | 7,723,800 |
| トモニホールディングス | 57,600 | 301.00 | 17,337,600 |
| フィデアホールディングス | 75,000 | 125.00 | 9,375,000 |
| 池田泉州ホールディングス | 82,400 | 169.00 | 13,925,600 |
| F P G | 22,000 | 675.00 | 14,850,000 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 4,500 | 1,607.00 | 7,231,500 |
| S B Iホールディングス | 86,300 | 2,959.00 | 255,361,700 |
| ジャフコ グループ | 11,200 | 7,460.00 | 83,552,000 |
| 大和証券グループ本社 | 523,100 | 560.00 | 292,936,000 |
| 野村ホールディングス | 1,075,400 | 571.20 | 614,268,480 |
| 岡三証券グループ | 62,600 | 451.00 | 28,232,600 |
| 丸三証券 | 22,100 | 626.00 | 13,834,600 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 76,300 | 396.00 | 30,214,800 |
| 水戸証券 | 24,200 | 303.00 | 7,332,600 |
| いちよし証券 | 16,300 | 601.00 | 9,796,300 |
| 松井証券 | 36,200 | 897.00 | 32,471,400 |
| マネックスグループ | 63,800 | 858.00 | 54,740,400 |
| 極東証券 | 10,900 | 822.00 | 8,959,800 |
| 岩井コスモホールディングス | 7,500 | 1,690.00 | 12,675,000 |

| | | | | |
|-------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| 藍澤証券 | 13,900 | 1,007.00 | 13,997,300 | |
| スパークス・グループ | 33,800 | 292.00 | 9,869,600 | |
| かんぽ生命保険 | 87,900 | 2,096.00 | 184,238,400 | |
| S O M P Oホールディングス | 124,000 | 4,073.00 | 505,052,000 | |
| アニコム ホールディングス | 22,200 | 1,021.00 | 22,666,200 | |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 170,300 | 3,135.00 | 533,890,500 | |
| 第一生命ホールディングス | 371,600 | 1,932.50 | 718,117,000 | |
| 東京海上ホールディングス | 233,300 | 5,289.00 | 1,233,923,700 | |
| T & Dホールディングス | 210,200 | 1,307.00 | 274,731,400 | |
| アドバンスクリエイト | 4,000 | 1,063.00 | 4,252,000 | |
| 全国保証 | 18,500 | 4,965.00 | 91,852,500 | |
| 日本モーゲージサービス | 4,200 | 1,040.00 | 4,368,000 | |
| アルヒ | 11,500 | 1,791.00 | 20,596,500 | |
| プレミアグループ | 3,900 | 2,461.00 | 9,597,900 | |
| クレディセゾン | 41,500 | 1,215.00 | 50,422,500 | |
| 芙蓉総合リース | 7,400 | 7,170.00 | 53,058,000 | |
| みずほリース | 11,100 | 3,200.00 | 35,520,000 | |
| 東京センチュリー | 16,300 | 6,880.00 | 112,144,000 | |
| 日本証券金融 | 28,700 | 798.00 | 22,902,600 | |
| アイフル | 123,900 | 300.00 | 37,170,000 | |
| リコーリース | 6,100 | 3,440.00 | 20,984,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 43,200 | 1,226.00 | 52,963,200 | |
| アコム | 142,000 | 474.00 | 67,308,000 | |
| ジャックス | 8,500 | 2,115.00 | 17,977,500 | |
| オリエントコーポレーション | 199,800 | 146.00 | 29,170,800 | |
| オリックス | 435,200 | 1,752.00 | 762,470,400 | |
| 三菱H C キャピタル | 240,100 | 625.00 | 150,062,500 | |
| 日本取引所グループ | 190,500 | 2,685.00 | 511,492,500 | |
| イー・ギャランティ | 8,800 | 2,127.00 | 18,717,600 | |
| N E C キャピタルソリューション | 3,500 | 1,898.00 | 6,643,000 | |
| いちご | 82,300 | 344.00 | 28,311,200 | |
| 日本駐車場開発 | 89,800 | 159.00 | 14,278,200 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 5,200 | 1,146.00 | 5,959,200 | |
| S R E ホールディングス | 1,000 | 5,560.00 | 5,560,000 | |
| ヒューリック | 149,300 | 1,266.00 | 189,013,800 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|--|
| 三栄建築設計 | 3,500 | 2,032.00 | 7,112,000 | |
| 野村不動産ホールディングス | 42,700 | 2,602.00 | 111,105,400 | |
| 三重交通グループホールディングス | 18,800 | 478.00 | 8,986,400 | |
| サムティ | 10,100 | 1,977.00 | 19,967,700 | |
| ディア・ライフ | 16,100 | 465.00 | 7,486,500 | |
| 日本商業開発 | 6,500 | 1,688.00 | 10,972,000 | |
| プレサンスコーポレーション | 11,800 | 1,648.00 | 19,446,400 | |
| 日本管理センター | 5,600 | 1,261.00 | 7,061,600 | |
| フージャースホールディングス | 13,600 | 658.00 | 8,948,800 | |
| オープンハウス | 22,200 | 4,615.00 | 102,453,000 | |
| 東急不動産ホールディングス | 191,300 | 590.00 | 112,867,000 | |
| 飯田グループホールディングス | 58,100 | 2,668.00 | 155,010,800 | |
| ハウスドゥ | 4,800 | 1,061.00 | 5,092,800 | |
| ケイアイスター不動産 | 2,300 | 3,730.00 | 8,579,000 | |
| グッドコムアセット | 3,900 | 1,431.00 | 5,580,900 | |
| ジェイ・エス・ビー | 1,700 | 3,380.00 | 5,746,000 | |
| パーク24 | 38,300 | 2,115.00 | 81,004,500 | |
| パラカ | 4,600 | 1,680.00 | 7,728,000 | |
| 三井不動産 | 321,200 | 2,399.00 | 770,558,800 | |
| 三菱地所 | 462,700 | 1,820.00 | 842,114,000 | |
| 平和不動産 | 12,000 | 3,650.00 | 43,800,000 | |
| 東京建物 | 70,200 | 1,616.00 | 113,443,200 | |
| ダイビル | 19,000 | 1,334.00 | 25,346,000 | |
| 京阪神ビルディング | 12,900 | 1,491.00 | 19,233,900 | |
| 住友不動産 | 158,600 | 3,676.00 | 583,013,600 | |
| テーオーシー | 16,500 | 726.00 | 11,979,000 | |
| 東京楽天地 | 1,800 | 4,390.00 | 7,902,000 | |
| スターツコーポレーション | 7,800 | 2,701.00 | 21,067,800 | |
| フジ住宅 | 11,800 | 679.00 | 8,012,200 | |
| 空港施設 | 13,100 | 598.00 | 7,833,800 | |
| ゴールドクレスト | 7,400 | 1,609.00 | 11,906,600 | |
| 日本エスコン | 13,600 | 748.00 | 10,172,800 | |
| タカラレーベン | 35,000 | 351.00 | 12,285,000 | |
| A V A N T I A | 7,800 | 893.00 | 6,965,400 | |
| イオンモール | 35,500 | 1,759.00 | 62,444,500 | |
| カチタス | 17,500 | 3,205.00 | 56,087,500 | |

| | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|
| トーセイ | 11,500 | 1,077.00 | 12,385,500 |
| サンフロンティア不動産 | 11,200 | 945.00 | 10,584,000 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 7,600 | 1,038.00 | 7,888,800 |
| ランドビジネス | 13,800 | 361.00 | 4,981,800 |
| 日本空港ビルデング | 22,800 | 4,945.00 | 112,746,000 |
| 日本工営 | 4,700 | 2,954.00 | 13,883,800 |
| L I F U L L | 29,900 | 384.00 | 11,481,600 |
| ミクシィ | 13,200 | 2,737.00 | 36,128,400 |
| ジェイエシーリクルートメント | 5,500 | 1,801.00 | 9,905,500 |
| 日本M & Aセンター | 112,200 | 2,950.00 | 330,990,000 |
| メンバーズ | 2,600 | 2,585.00 | 6,721,000 |
| UTグループ | 10,100 | 3,630.00 | 36,663,000 |
| アイティメディア | 2,900 | 1,901.00 | 5,512,900 |
| タケエイ | 9,100 | 1,261.00 | 11,475,100 |
| 夢真ビーネックスグループ | 10,100 | 1,460.00 | 14,746,000 |
| コシダカホールディングス | 19,800 | 554.00 | 10,969,200 |
| パソナグループ | 7,900 | 2,019.00 | 15,950,100 |
| リンクアンドモチベーション | 15,200 | 643.00 | 9,773,600 |
| G C A | 13,300 | 796.00 | 10,586,800 |
| エス・エム・エス | 23,900 | 3,280.00 | 78,392,000 |
| パーソルホールディングス | 68,900 | 2,054.00 | 141,520,600 |
| リニカル | 6,600 | 733.00 | 4,837,800 |
| クックパッド | 29,600 | 304.00 | 8,998,400 |
| スタジオアリス | 4,600 | 2,387.00 | 10,980,200 |
| シミックホールディングス | 4,900 | 1,619.00 | 7,933,100 |
| 総合警備保障 | 27,100 | 4,860.00 | 131,706,000 |
| カカクコム | 50,900 | 2,977.00 | 151,529,300 |
| アイロムグループ | 3,300 | 2,492.00 | 8,223,600 |
| セントケア・ホールディング | 6,400 | 1,205.00 | 7,712,000 |
| ルネサンス | 7,300 | 1,116.00 | 8,146,800 |
| ディップ | 10,900 | 3,075.00 | 33,517,500 |
| デジタルホールディングス | 5,400 | 1,912.00 | 10,324,800 |
| 新日本科学 | 11,100 | 722.00 | 8,014,200 |
| ベネフィット・ワン | 25,400 | 2,873.00 | 72,974,200 |
| エムスリー | 120,400 | 7,589.00 | 913,715,600 |
| アウトソーシング | 39,700 | 1,726.00 | 68,522,200 |

| | | | |
|----------------------|--------|-----------|---------------|
| ウェルネット | 14,600 | 571.00 | 8,336,600 |
| ワールドホールディングス | 2,900 | 2,800.00 | 8,120,000 |
| ディー・エヌ・エー | 29,600 | 2,124.00 | 62,870,400 |
| 博報堂D Yホールディングス | 95,200 | 1,785.00 | 169,932,000 |
| ぐるなび | 15,600 | 595.00 | 9,282,000 |
| タカミヤ | 12,900 | 550.00 | 7,095,000 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 7,700 | 736.00 | 5,667,200 |
| ファンコミュニケーションズ | 23,800 | 397.00 | 9,448,600 |
| ライク | 2,700 | 2,473.00 | 6,677,100 |
| エスプール | 18,300 | 988.00 | 18,080,400 |
| WDBホールディングス | 3,700 | 2,376.00 | 8,791,200 |
| 手間いらず | 900 | 5,860.00 | 5,274,000 |
| アドウェイズ | 9,900 | 836.00 | 8,276,400 |
| バリューコマース | 4,800 | 3,635.00 | 17,448,000 |
| インフォマート | 70,900 | 1,026.00 | 72,743,400 |
| J Pホールディングス | 27,700 | 306.00 | 8,476,200 |
| E P Sホールディングス | 10,700 | 1,176.00 | 12,583,200 |
| プレステージ・インターナショナル | 26,500 | 764.00 | 20,246,000 |
| アミューズ | 4,600 | 2,348.00 | 10,800,800 |
| ドリームインキュベータ | 4,300 | 1,002.00 | 4,308,600 |
| クイック | 6,300 | 1,166.00 | 7,345,800 |
| 電通グループ | 77,000 | 3,340.00 | 257,180,000 |
| イオンファンタジー | 3,400 | 2,013.00 | 6,844,200 |
| シーティーエス | 8,900 | 852.00 | 7,582,800 |
| H . U . グループホールディングス | 19,800 | 3,600.00 | 71,280,000 |
| アルプス技研 | 6,800 | 2,024.00 | 13,763,200 |
| 日本空調サービス | 11,200 | 735.00 | 8,232,000 |
| オリエンタルランド | 72,600 | 15,700.00 | 1,139,820,000 |
| ダスキン | 16,400 | 2,590.00 | 42,476,000 |
| 明光ネットワークジャパン | 13,600 | 600.00 | 8,160,000 |
| ファルコホールディングス | 4,600 | 1,680.00 | 7,728,000 |
| ラウンドワン | 24,400 | 1,099.00 | 26,815,600 |
| リゾートトラスト | 32,900 | 1,751.00 | 57,607,900 |
| ビー・エム・エル | 8,800 | 3,695.00 | 32,516,000 |
| りらいあコミュニケーションズ | 10,700 | 1,368.00 | 14,637,600 |
| リソー教育 | 40,400 | 307.00 | 12,402,800 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| ユー・エス・エス | 76,600 | 2,027.00 | 155,268,200 |
| 東京個別指導学院 | 9,400 | 592.00 | 5,564,800 |
| サイバーエージェント | 168,800 | 1,946.00 | 328,484,800 |
| 楽天グループ | 318,700 | 1,376.00 | 438,531,200 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 5,000 | 1,580.00 | 7,900,000 |
| モーニングスター | 13,700 | 487.00 | 6,671,900 |
| 山田コンサルティンググループ | 5,800 | 1,157.00 | 6,710,600 |
| セントラルスポーツ | 4,100 | 2,328.00 | 9,544,800 |
| フルキャストホールディングス | 7,000 | 1,920.00 | 13,440,000 |
| エン・ジャパン | 12,500 | 3,450.00 | 43,125,000 |
| テクノプロ・ホールディングス | 13,800 | 8,630.00 | 119,094,000 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 2,900 | 15,220.00 | 44,138,000 |
| Keeper 技研 | 4,900 | 2,322.00 | 11,377,800 |
| Gunosy | 6,100 | 966.00 | 5,892,600 |
| イー・ガーディアン | 3,300 | 2,900.00 | 9,570,000 |
| ジャパンマテリアル | 21,400 | 1,324.00 | 28,333,600 |
| ベクトル | 9,600 | 963.00 | 9,244,800 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 5,900 | 1,251.00 | 7,380,900 |
| キャリアリンク | 2,700 | 2,238.00 | 6,042,600 |
| I B J | 7,800 | 923.00 | 7,199,400 |
| アサンテ | 4,100 | 1,839.00 | 7,539,900 |
| バリューHR | 4,000 | 1,632.00 | 6,528,000 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 5,600 | 5,180.00 | 29,008,000 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 3,500 | 1,681.00 | 5,883,500 |
| シグマクシス | 4,500 | 2,104.00 | 9,468,000 |
| ウィルグループ | 6,600 | 1,030.00 | 6,798,000 |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 15,800 | 270.00 | 4,266,000 |
| メドピア | 3,300 | 5,960.00 | 19,668,000 |
| リクルートホールディングス | 488,800 | 5,038.00 | 2,462,574,400 |
| エラン | 9,400 | 1,323.00 | 12,436,200 |
| 日本郵政 | 516,600 | 911.00 | 470,622,600 |
| ベルシステム24ホールディングス | 12,100 | 1,712.00 | 20,715,200 |
| 鎌倉新書 | 8,200 | 1,288.00 | 10,561,600 |
| アトラエ | 5,000 | 1,750.00 | 8,750,000 |
| ストライク | 2,700 | 4,730.00 | 12,771,000 |
| ソラスト | 17,200 | 1,414.00 | 24,320,800 |

| | | | |
|------------------------|--------|-----------|-------------|
| セラク | 2,800 | 2,327.00 | 6,515,600 |
| インソース | 6,100 | 2,517.00 | 15,353,700 |
| ペイカレント・コンサルティング | 4,500 | 31,000.00 | 139,500,000 |
| Orchestra Holdings | 2,200 | 2,998.00 | 6,595,600 |
| アイモバイル | 3,300 | 1,337.00 | 4,412,100 |
| グレイステクノロジー | 7,200 | 2,832.00 | 20,390,400 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 19,800 | 2,252.00 | 44,589,600 |
| ミダック | 1,800 | 5,500.00 | 9,900,000 |
| 日総工産 | 7,100 | 734.00 | 5,211,400 |
| キュービーネットホールディングス | 5,000 | 1,761.00 | 8,805,000 |
| RPAホールディングス | 9,700 | 806.00 | 7,818,200 |
| マネジメントソリューションズ | 4,000 | 2,018.00 | 8,072,000 |
| プロレド・パートナーズ | 1,200 | 3,095.00 | 3,714,000 |
| カーブスホールディングス | 20,200 | 940.00 | 18,988,000 |
| ダイレクトマーケティングミックス | 3,200 | 3,465.00 | 11,088,000 |
| ポピンズホールディングス | 1,700 | 4,295.00 | 7,301,500 |
| LITALICO | 3,100 | 4,815.00 | 14,926,500 |
| リログループ | 38,300 | 2,338.00 | 89,545,400 |
| 東祥 | 5,300 | 1,809.00 | 9,587,700 |
| エイチ・アイ・エス | 10,400 | 2,205.00 | 22,932,000 |
| ラックランド | 3,000 | 2,416.00 | 7,248,000 |
| 共立メンテナンス | 11,700 | 3,475.00 | 40,657,500 |
| イチネンホールディングス | 8,600 | 1,269.00 | 10,913,400 |
| 建設技術研究所 | 5,000 | 2,543.00 | 12,715,000 |
| 長大 | 3,500 | 1,740.00 | 6,090,000 |
| 燦ホールディングス | 4,800 | 1,081.00 | 5,188,800 |
| 東京テアトル | 6,200 | 1,251.00 | 7,756,200 |
| ナガワ | 2,200 | 8,230.00 | 18,106,000 |
| 東京都競馬 | 4,700 | 5,890.00 | 27,683,000 |
| カナモト | 12,400 | 2,701.00 | 33,492,400 |
| 西尾レントオール | 6,500 | 3,000.00 | 19,500,000 |
| トランス・コスモス | 6,900 | 3,090.00 | 21,321,000 |
| 乃村工藝社 | 30,700 | 816.00 | 25,051,200 |
| 日本管財 | 7,100 | 2,138.00 | 15,179,800 |
| トーカイ | 6,700 | 2,409.00 | 16,140,300 |

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

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

| | （2020年 4月27日現在） | （2021年 4月26日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 633,599,484 | 1,942,451,000 |
| 金銭信託 | 100,485,366 | 302,937,580 |
| コール・ローン | 103,015,575 | 695,167,542 |
| 株式 | 186,251,660,602 | 283,850,458,884 |
| 投資証券 | 4,618,495,180 | 6,801,473,940 |
| 派生商品評価勘定 | 27,953,556 | 59,535,179 |
| 未収入金 | 1,865,057,554 | 45,617,843 |
| 未収配当金 | 227,793,045 | 309,276,064 |
| 差入委託証拠金 | 1,118,430,587 | 1,650,022,983 |
| 流動資産合計 | 194,946,490,949 | 295,656,941,015 |
| 資産合計 | 194,946,490,949 | 295,656,941,015 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 9,203,874 | 372,922 |
| 前受金 | 17,362,275 | 59,485,972 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 未払金 | 54,739,686 | - |
| 未払解約金 | 1,290,294,992 | 1,041,495,833 |
| 未払利息 | 297 | 2,012 |
| その他未払費用 | 41,742 | 20,043 |
| 流動負債合計 | 1,371,642,866 | 1,101,376,782 |
| 負債合計 | 1,371,642,866 | 1,101,376,782 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 58,066,751,593 | 57,943,987,779 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 135,508,096,490 | 236,611,576,454 |
| 元本等合計 | 193,574,848,083 | 294,555,564,233 |
| 純資産合計 | 193,574,848,083 | 294,555,564,233 |
| 負債純資産合計 | 194,946,490,949 | 295,656,941,015 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本と | 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27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 58,066,751,593口 | 57,943,987,779口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 3.3337円 (10,000口当たりの純資産額 33,337円) | 1口当たり純資産額 5.0835円 (10,000口当たりの純資産額 50,835円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2020年 4月27日現在) | |
|---------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 58,840,117,713円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 7,256,445,495円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 8,029,811,615円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 25,451,218,551円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 354,132,894円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,402,748,729円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 898,409,075円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 67,502,372円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 2,062,158円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 8,137,497円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 23,861,394円 |

| | |
|---|----------------|
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 50,148,540円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 42,133,260円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 93,012,458円 |
| 外国株式指数ファンド | 558,034,519円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 5,826,411,908円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 243,195,509円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 245,763,764円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 180,873,346円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 8,810,021円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 63,308,584円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 50,183,200円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 158,005,784円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 76,905,157円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 92,680,407円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 24,402,638円 |
| 三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド | 11,277,567円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 218,126円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 848,695円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 538,088円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,759,348円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 1,296,632,642円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定> | 7,995,785円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定> | 71,673,896円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 1,521,663,602円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 1,513,925,274円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 6,117,486,464円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定> | 19,789,865円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定> | 101,693,203円 |
| 世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定> | 347,233円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用> | 718,885,446円 |
| S M A M・バランスファンドV L国際分散型 <適格機関投資家限定> | 64,157,112円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 177,133,917円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 760,554,540円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用> | 648,495,263円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用> | 1,550,284,613円 |
| S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定> | 837,014円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用) | 293,533,256円 |
| S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定> | 131,650,499円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用> | 17,994,714円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用> | 13,073,387円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用> | 6,812,692円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用> | 43,227,998円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用> | 112,493,525円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A <適格機関投資家限定> | 634,241,041円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A <適格機関投資家限定> | 137,128,409円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定> | 5,665,809,160円 |
| S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定> | 251,019,233円 |
| S M A M・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定> | 95,964,227円 |

| | |
|---|-----------------|
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 6,000,355円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 7,004,719円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 7,446,085円 |
| S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 135,212,835円 |
| 合計 | 58,066,751,593円 |

(2021年 4月26日現在)

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 58,066,751,593円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 16,895,224,068円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 17,017,987,882円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 28,763,062,087円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 278,659,320円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,185,860,476円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 826,468,614円 |
| S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 68,282,666円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 1,307,216円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 6,153,493円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 17,918,101円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 44,256,436円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 43,724,486円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 93,759,250円 |
| 外国株式指数ファンド | 597,608,127円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A ・全海外株インデックスファンド | 9,332,591,971円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 226,710,914円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 247,923,480円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 161,310,710円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 53,042,866円 |
| 三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,361,494円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 93,387,800円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 79,384,983円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 253,475,380円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 124,628,072円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 143,424,749円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド | 31,364,778円 |
| 三井住友D S ・外国株式インデックス年金ファンド | 185,695,612円 |
| 三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型) | 3,502,496円 |
| 三井住友D S ・年金バランス50(標準型) | 13,766,131円 |
| 三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型) | 11,897,831円 |
| 三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,957,599円 |
| S M B C ・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ) | 36,164,679円 |
| S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 765,606,897円 |

| | |
|---|-----------------|
| バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 5,449,180円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 42,227,299円 |
| SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 890,427,813円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 1,017,321,892円 |
| SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 4,322,684,584円 |
| SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 13,987,860円 |
| SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞ | 76,827,086円 |
| SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 582,908,081円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 46,776,376円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 123,376,353円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 563,978,699円 |
| SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 436,244,612円 |
| SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 1,003,186,093円 |
| SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞ | 241,876円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 249,141,886円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞ | 90,384,153円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞ | 11,959,916円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞ | 9,138,921円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞ | 4,880,615円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞ | 27,135,381円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞ | 73,803,151円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA＜適格機関投資家限定＞ | 168,068,608円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA＜適格機関投資家限定＞ | 80,082,212円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 2,365,412,561円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞ | 154,088,266円 |
| SMAM・外国株式インデックスファンドSA＜適格機関投資家限定＞ | 1,460,825,276円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞ | 12,940,494円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞ | 34,488,574円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞ | 28,712,764円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド＜適格機関投資家限定＞ | 341,028,483円 |
| 合計 | 57,943,987,779円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|-----------------------------|--------|-------|------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | BAKER HUGHES COMPANY | 31,974 | 20.01 | 639,799.74 | |
| | CABOT OIL & GAS CORPORATION | 19,632 | 16.12 | 316,467.84 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 11,747 | 74.19 | 871,509.93 | |

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ドル

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

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

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

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|----------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 591銘柄 | 69.3% | 71.9% |
| カナダドル | 株式 87銘柄 | 3.4% | 3.5% |
| ユーロ | 株式 234銘柄 | 10.5% | 10.9% |
| 英ポンド | 株式 86銘柄 | 4.5% | 4.7% |
| スイスフラン | 株式 40銘柄 | 3.0% | 3.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式 38銘柄 | 1.2% | 1.2% |
| ノルウェークローネ | 株式 11銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式 19銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| オーストラリアドル | 株式 54銘柄 | 2.1% | 2.1% |
| ニュージーランドドル | 株式 7銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 香港ドル | 株式 31銘柄 | 1.0% | 1.0% |
| シンガポールドル | 株式 14銘柄 | 0.3% | 0.3% |

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

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

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-----------|-----------|----------------|------------|
| 米ドル | 投資証券 37銘柄 | 1.9% | 80.4% |
| カナダドル | 投資証券 2銘柄 | 0.0% | 0.5% |
| ユーロ | 投資証券 4銘柄 | 0.1% | 2.2% |
| 英ポンド | 投資証券 3銘柄 | 0.1% | 2.4% |
| オーストラリアドル | 投資証券 11銘柄 | 0.2% | 10.1% |
| 香港ドル | 投資証券 3銘柄 | 0.1% | 2.3% |
| シンガポールドル | 投資証券 5銘柄 | 0.0% | 2.0% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 136,683,620 | 251,077,719 |
| 金銭信託 | 646,925,215 | 762,512,013 |
| コール・ローン | 663,214,708 | 1,749,778,290 |
| 株式 | 3,662,360,965 | 9,586,932,925 |
| 投資信託受益証券 | 411,445,602 | 497,674,247 |
| 投資証券 | 119,441,221 | 912,831,155 |
| 派生商品評価勘定 | 101,259,570 | 16,583,310 |
| 未収入金 | 132,763 | 16,081,391 |
| 未収配当金 | 4,237,599 | 12,315,820 |
| 前払金 | 6,878,868 | - |
| 差入委託証拠金 | 650,095,027 | 785,870,472 |
| 流動資産合計 | 6,402,675,158 | 14,591,657,342 |
| 資産合計 | 6,402,675,158 | 14,591,657,342 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 31,112,301 | 33,807,564 |
| 前受金 | - | 121,915 |
| 未払解約金 | 4,770,000 | 290,000 |
| 未払利息 | 1,913 | 5,064 |
| その他未払費用 | 96,472 | 64,023 |
| 流動負債合計 | 35,980,686 | 34,288,566 |
| 負債合計 | 35,980,686 | 34,288,566 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 5,713,549,870 | 8,325,755,557 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 653,144,602 | 6,231,613,219 |
| 元本等合計 | 6,366,694,472 | 14,557,368,776 |
| 純資産合計 | 6,366,694,472 | 14,557,368,776 |
| 負債純資産合計 | 6,402,675,158 | 14,591,657,342 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

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

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | | (2021年 4月26日現在) | |
|-----------------------|--------------------------------|---------------------|--------------------------------|---------------------|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 5,713,549,870口 | | 8,325,755,557口 | |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 1.1143円 11,143円) | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) | 1.7485円 17,485円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項 目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | 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 MSCIE 2006 | 2,172,770,028 | - | 2,165,891,160 | 6,878,868 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,262,767,762 | - | 2,337,596,220 | 74,828,458 |
| | 米ドル | 2,262,767,762 | - | 2,337,596,220 | 74,828,458 |
| | 売建 | 961,067,762 | - | 958,870,083 | 2,197,679 |
| | 米ドル | 961,000,000 | - | 958,802,971 | 2,197,029 |
| | ブラジルリアル | 58,380 | - | 57,750 | 630 |
| | 香港ドル | 9,382 | - | 9,362 | 20 |
| | 合計 | 5,396,605,552 | - | 5,462,357,463 | 70,147,269 |

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | 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 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| | MSCIE 2106 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 米ドル | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 売建 | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| | 米ドル | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| | 合計 | 6,399,360,207 | - | 6,376,705,695 | 17,224,254 |

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2020年 4月28日

至 2021年 4月26日

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

(その他の注記)

(2020年 4月27日現在)

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 6,421,132,350円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 838,276,061円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,545,858,541円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 2,454,605,033円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 1,776,810,273円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 198,129,473円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 458,657,103円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 338,056,722円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,268,525円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 40,284,077円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 27,674,839円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 125,402,862円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 82,725,406円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 144,452,900円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 36,039,470円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,548,148円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 14,895,039円 |
| 合計 | 5,713,549,870円 |

(2021年 4月26日現在)

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 5,713,549,870円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 4,826,668,980円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,214,463,293円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 4,212,467,456円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 2,168,457,848円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,316,544円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 466,719,046円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 305,570,265円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 36,830,971円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 19,428,099円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 51,180,927円 |

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型) | 38,730,510円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型) | 184,820,124円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型) | 125,451,007円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型) | 215,280,733円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 45,405,336円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,767,956円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 29,328,735円 |
| 合計 | 8,325,755,557円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株数 | 評価額 | | 備考 |
|-------------------|-----------------------------------|--------|-----------|------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | YPF S.A. -SPONSORED ADR | 1,387 | 3.75 | 5,201.25 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR | 2,217 | 10.16 | 22,524.72 | |
| | SOUTHERN COPPER CORPORATION | 1,088 | 71.64 | 77,944.32 | |
| | 51JOB INC-ADR | 358 | 62.56 | 22,396.48 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 5,027 | 32.28 | 162,271.56 | |
| | LI AUTO INC - ADR | 2,210 | 20.60 | 45,526.00 | |
| | NIO INC-ADR | 15,750 | 41.08 | 647,010.00 | |
| | XPENG INC - ADR | 2,088 | 33.30 | 69,530.40 | |
| | GSX TECHEDU INC- ADR | 949 | 27.07 | 25,689.43 | |
| | HUAZHU GROUP LTD-ADR | 1,969 | 59.00 | 116,171.00 | |
| | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | 18,810 | 16.10 | 302,841.00 | |
| | TAL EDUCATION GROUP-ADR | 4,662 | 61.06 | 284,661.72 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 4,894 | 59.13 | 289,382.22 | |
| | AUTOHOME INC-ADR | 775 | 93.67 | 72,594.25 | |
| | BAIDU INC - SPON ADR | 3,311 | 220.94 | 731,532.34 | |
| | BILIBILI INC-SPONSORED ADR | 2,015 | 116.66 | 235,069.90 | |
| | DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR | 1,074 | 10.50 | 11,277.00 | |
| | HUYA INC-ADR | 1,153 | 18.50 | 21,330.50 | |
| | IQIYI INC-ADR | 3,643 | 15.60 | 56,830.80 | |
| | JOYY INC | 758 | 99.10 | 75,117.80 | |
| MOMO INC-SPON ADR | 1,551 | 15.17 | 23,528.67 | | |

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|----------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 45銘柄 | 9.1% | 13.8% |
| メキシコペソ | 株式 21銘柄 | 1.1% | 1.7% |
| ブラジルリアル | 株式 47銘柄 | 3.3% | 5.0% |
| チリペソ | 株式 14銘柄 | 0.4% | 0.6% |
| コロンビアペソ | 株式 5銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| ユーロ | 株式 4銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| トルコリラ | 株式 14銘柄 | 0.2% | 0.3% |
| チェココルナ | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| ハンガリーフォリント | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.2% |
| ポーランドズロチ | 株式 14銘柄 | 0.5% | 0.7% |
| 香港ドル | 株式 200銘柄 | 16.4% | 24.9% |
| マレーシアリングット | 株式 38銘柄 | 1.0% | 1.6% |
| タイバーツ | 株式 44銘柄 | 1.3% | 2.0% |
| フィリピンペソ | 株式 20銘柄 | 0.5% | 0.7% |
| インドネシアルピア | 株式 22銘柄 | 0.9% | 1.4% |
| 韓国ウォン | 株式 106銘柄 | 10.2% | 15.5% |
| 新台湾ドル | 株式 87銘柄 | 10.8% | 16.3% |
| インドルピー | 株式 96銘柄 | 6.8% | 10.4% |
| エジプトポンド | 株式 3銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| 南アフリカランド | 株式 36銘柄 | 2.8% | 4.3% |

(b)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------|---------------|----------------------------|---------|--------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | 中国元(オフショア) | CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF | 571,200 | 29,919,456.00 | |
| | 中国元(オフショア) 小計 | | 571,200 | 29,919,456.00 (497,674,247) | |
| | | | | 497,674,247 | |

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資信託受益証券 時価比率 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する 比率 |
|-----|----------|--------------------|----------------|----------------|
| 米ドル | 投資証券 6銘柄 | - | 5.8% | 60.3% |

| | | | | | |
|------------|----------|-----|------|------|-------|
| メキシコペソ | 投資証券 | 3銘柄 | - | 0.2% | 2.4% |
| ブラジルレアル | 投資証券 | 6銘柄 | - | 0.2% | 1.7% |
| 南アフリカランド | 投資証券 | 1銘柄 | - | 0.0% | 0.3% |
| 中国元(オフショア) | 投資信託受益証券 | 1銘柄 | 3.4% | - | 35.3% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 29,223,710 | 29,114,056 |
| コール・ローン | 29,959,559 | 66,809,626 |
| 投資証券 | 3,952,989,000 | 8,029,616,750 |
| 派生商品評価勘定 | - | 4,736,400 |
| 未収入金 | 102,225 | 2,631,744 |
| 未収配当金 | 45,102,963 | 58,652,103 |
| 前払金 | 14,135,500 | - |
| 差入委託証拠金 | 15,120,000 | 3,330,000 |
| 流動資産合計 | 4,086,632,957 | 8,194,890,679 |
| 資産合計 | 4,086,632,957 | 8,194,890,679 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 14,148,700 | - |
| 前受金 | - | 4,743,000 |
| 未払解約金 | 2,285,580 | 68,058,794 |
| 未払利息 | 86 | 193 |
| その他未払費用 | 10,403 | 2,229 |
| 流動負債合計 | 16,444,769 | 72,804,216 |
| 負債合計 | 16,444,769 | 72,804,216 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,079,734,759 | 3,071,522,148 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 1,990,453,429 | 5,050,564,315 |
| 元本等合計 | 4,070,188,188 | 8,122,086,463 |
| 純資産合計 | 4,070,188,188 | 8,122,086,463 |
| 負債純資産合計 | 4,086,632,957 | 8,194,890,679 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 2,079,734,759口 | 3,071,522,148口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.9571円 (10,000口当たりの純資産額 19,571円) | 1口当たり純資産額 2.6443円 (10,000口当たりの純資産額 26,443円) |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | 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 | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |
| | 東証REIT指数 先物 | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |
| 合計 | | 108,768,700 | - | 94,620,000 | 14,148,700 |

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | 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 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| | 東証REIT指数 先物 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| | 合計 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 4月28日

至 2021年 4月26日

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

(その他の注記)

(2020年 4月27日現在)

| | |
|----------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,088,186,762円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 460,275,364円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,468,727,367円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 152,382,989円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 310,073,497円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 261,721,272円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,177,332,621円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 5,392,698円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 25,359,901円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 17,271,591円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 48,367,096円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 24,397,339円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 20,133,135円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 10,128,064円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,159,286円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 383,164円 |

| | |
|---|----------------|
| S M A M ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定> | 5,389,396円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 4,214,611円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 6,211,193円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 9,816,906円 |
| 合計 | 2,079,734,759円 |

| (2021年 4月26日現在) | |
|---|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 2,079,734,759円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,566,048,223円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,574,260,834円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 316,132,317円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 348,559,330円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 238,816,451円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 84,560,850円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,588,375,824円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 9,834,653円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 35,461,155円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 25,278,674円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 80,153,697円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 41,281,247円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 33,683,493円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 15,113,869円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,448,736円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド | 20,024,548円 |
| S M A M ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定> | 50,433,479円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 31,132,085円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 82,301,805円 |
| S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 68,929,935円 |
| 合計 | 3,071,522,148円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------------|-------------------------|-------------|-------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人 | 118 | 15,163,000 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 179 | 20,996,700 | |
| | S O S i L A 物流リート投資法人 | 191 | 27,408,500 | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 251 | 163,401,000 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 852 | 134,616,000 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 1,024 | 202,547,200 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 689 | 239,083,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 495 | 109,791,000 | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 363 | 179,685,000 | |
| | G L P 投資法人 | 2,264 | 412,727,200 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 325 | 112,612,500 | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 1,146 | 400,527,000 | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 111 | 71,817,000 | |
| | O n e リート投資法人 | 113 | 34,691,000 | |
| | イオンリート投資法人 | 737 | 110,697,400 | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 599 | 103,327,500 | |
| | 日本リート投資法人 | 236 | 100,300,000 | |
| | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | 4,672 | 96,944,000 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 2,130 | 197,664,000 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 160 | 22,256,000 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 288 | 78,710,400 | |
| | ヘルスケア&メディカル投資法人 | 154 | 21,098,000 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 137 | 15,987,900 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 2,343 | 401,121,600 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 125 | 10,525,000 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 835 | 147,461,000 | |
| スターアジア不動産投資法人 | 745 | 41,422,000 | | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 69 | 8,887,200 | | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 254 | 143,764,000 | | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 115 | 9,315,000 | | |

| | | | |
|-----------------------|--------|---------------|--|
| 投資法人みらい | 779 | 38,911,050 | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 157 | 20,912,400 | |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 182 | 81,172,000 | |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 231 | 41,441,400 | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 110 | 12,496,000 | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 219 | 25,228,800 | |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 281 | 38,974,700 | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 816 | 580,176,000 | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 725 | 490,825,000 | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 3,609 | 382,914,900 | |
| オリックス不動産投資法人 | 1,444 | 274,504,400 | |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 451 | 197,087,000 | |
| N T T 都市開発リート投資法人 | 654 | 110,002,800 | |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 488 | 89,548,000 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 506 | 63,806,600 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1,550 | 252,030,000 | |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 520 | 80,392,000 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 3,037 | 120,872,600 | |
| フロンティア不動産投資法人 | 241 | 112,788,000 | |
| 平和不動産リート投資法人 | 443 | 70,569,900 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 474 | 151,680,000 | |
| 福岡リート投資法人 | 376 | 66,213,600 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 225 | 182,925,000 | |
| いちごオフィスリート投資法人 | 601 | 58,717,700 | |
| 大和証券オフィス投資法人 | 155 | 122,295,000 | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 326 | 49,715,000 | |
| スターツプロシード投資法人 | 113 | 26,035,200 | |
| 大和ハウスリート投資法人 | 1,034 | 302,341,600 | |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2,331 | 144,755,100 | |
| 大和証券リビング投資法人 | 945 | 104,233,500 | |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 674 | 101,504,400 | |
| 合計 | 45,417 | 8,029,616,750 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 51,118,215 | 44,482,747 |
| 金銭信託 | 3,963,979 | 28,588,674 |
| コール・ローン | 4,063,792 | 65,604,005 |
| 投資証券 | 5,478,909,884 | 11,519,480,828 |
| 派生商品評価勘定 | 5,199 | 17,814 |
| 未収入金 | 2,163 | 57,714,478 |
| 未収配当金 | 5,165,802 | 11,685,275 |
| 流動資産合計 | 5,543,229,034 | 11,727,573,821 |
| 資産合計 | 5,543,229,034 | 11,727,573,821 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 5,197 | 49,052 |
| 未払金 | 5,641,591 | - |
| 未払解約金 | - | 142,622,000 |
| 未払利息 | 11 | 189 |
| その他未払費用 | 1,101 | 547 |
| 流動負債合計 | 5,647,900 | 142,671,788 |
| 負債合計 | 5,647,900 | 142,671,788 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,351,152,062 | 4,897,225,610 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 2,186,429,072 | 6,687,676,423 |
| 元本等合計 | 5,537,581,134 | 11,584,902,033 |
| 純資産合計 | 5,537,581,134 | 11,584,902,033 |
| 負債純資産合計 | 5,543,229,034 | 11,727,573,821 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| | |
|----|--------------------------------|
| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|----|--------------------------------|

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 3,351,152,062口 | 4,897,225,610口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 1.6524円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 16,524円)</p> | <p>1口当たり純資産額 2.3656円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 23,656円)</p> |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| | |
|----|---|
| 項目 | <p>自 2020年 4月28日</p> <p>至 2021年 4月26日</p> |
|----|---|

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

. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-----------|-----------|-----------|-------|-----------|-------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 5,500,000 | - | 5,500,602 | 602 |
| | 米ドル | 4,500,000 | - | 4,495,403 | 4,597 |
| | ユーロ | 500,000 | - | 501,768 | 1,768 |
| | オーストラリアドル | 500,000 | - | 503,431 | 3,431 |
| | 売建 | 2,430,180 | - | 2,430,780 | 600 |
| | カナダドル | 610,080 | - | 610,080 | - |
| | 英ポンド | 1,064,400 | - | 1,064,800 | 400 |
| | シンガポールドル | 755,700 | - | 755,900 | 200 |
| 合計 | | 7,930,180 | - | 7,931,382 | 2 |

(2021年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
|--|--|--|--|--|

| 区分 | 種類 | 契約額等 | 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 | 4,300,000 | - | 4,299,779 | 221 |
| | 米ドル | 2,500,000 | - | 2,499,953 | 47 |
| | ユーロ | 500,000 | - | 499,985 | 15 |
| | 英ポンド | 500,000 | - | 499,947 | 53 |
| | オーストラリアドル | 800,000 | - | 799,894 | 106 |
| | 売建 | 51,623,281 | - | 51,654,298 | 31,017 |
| | 米ドル | 37,991,360 | - | 37,976,928 | 14,432 |
| | カナダドル | 949,850 | - | 952,152 | 2,302 |
| | ユーロ | 2,205,070 | - | 2,219,378 | 14,308 |
| | 英ポンド | 2,839,151 | - | 2,846,004 | 6,853 |
| | オーストラリアドル | 3,410,872 | - | 3,431,290 | 20,418 |
| | ニュージーランドドル | 1,245,808 | - | 1,243,028 | 2,780 |
| | 香港ドル | 1,196,002 | - | 1,195,400 | 602 |
| | シンガポールドル | 1,785,168 | - | 1,790,118 | 4,950 |
| | 合計 | 55,923,281 | - | 55,954,077 | 31,238 |

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 4月28日

至 2021年 4月26日

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

(その他の注記)

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,048,191,413円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 512,908,214円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 209,947,565円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 37,376,988円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 37,514,775円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 28,930,639円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 3,048,076,760円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 2,560,043円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 27,304,661円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 18,240,993円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 55,898,575円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 27,687,998円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 22,576,318円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 35,818,994円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 450,246円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 449,158円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,818,172円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 5,447,742円 |
| 合計 | 3,351,152,062円 |

| (2021年 4月26日現在) | |
|---------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,351,152,062円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,408,226,049円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 862,152,501円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 36,052,341円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 44,692,972円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 29,319,643円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 44,687,417円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 4,353,843,871円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 3,924,728円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 40,667,543円 |

| | |
|---|----------------|
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 28,606,664円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 90,223,455円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 46,713,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 37,645,676円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 51,093,218円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 583,824円 |
| 三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド | 17,098,546円 |
| S M A M ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定> | 46,391,095円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 25,680,984円 |
| 合計 | 4,897,225,610円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|--|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ACADIA REALTY TRUST | 6,133 | 128,363.69 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 4,936 | 350,998.96 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 5,532 | 98,303.64 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 136 | 37,991.60 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC. | 9,574 | 1,717,096.90 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 3,856 | 132,415.04 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC | 10,006 | 457,474.32 | |
| | | AMERICAN FINANCE TRUST INC | 10,155 | 99,214.35 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 19,922 | 710,418.52 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 19,430 | 762,821.80 | |
| | | APARTMENT INCOME REIT CORP | 11,143 | 511,575.13 | |
| | | APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A | 9,715 | 64,799.05 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 14,879 | 227,202.33 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 4,848 | 65,884.32 | |

| | | | |
|---------------------------------|--------|--------------|--|
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 10,587 | 2,052,607.56 | |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 600 | 5,778.00 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 10,768 | 1,141,946.40 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 13,383 | 176,923.26 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 21,772 | 472,452.40 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 2,372 | 46,396.32 | |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 3,309 | 59,231.10 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 500 | 8,995.00 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,318 | 868,719.78 | |
| CARETRUST REIT INC | 6,670 | 162,681.30 | |
| CENTERSPACE | 1,026 | 73,543.68 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 4,019 | 54,296.69 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 4,603 | 50,863.15 | |
| CLIPPER REALTY INC | 800 | 6,568.00 | |
| COLONY CAPITAL INC-CLASS A | 36,813 | 254,377.83 | |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 8,351 | 150,150.98 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1,483 | 76,448.65 | |
| COREPOINT LODGING INC | 4,226 | 40,865.42 | |
| CORESITE REALTY CORPORATION | 3,078 | 386,227.44 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 8,127 | 227,149.65 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 11,001 | 398,016.18 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 310 | 16,141.70 | |
| CUBESMART | 14,994 | 630,197.82 | |
| CYRUSONE INC | 8,925 | 663,038.25 | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY | 16,010 | 161,701.00 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 21,113 | 3,146,681.52 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 16,755 | 74,057.10 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 12,552 | 414,592.56 | |
| DUKE REALTY CORP | 28,151 | 1,277,210.87 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20,000 | 2,740.00 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 7,057 | 151,796.07 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 3,002 | 465,099.86 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 10,409 | 114,499.00 | |
| EPR PROPERTIES | 6,064 | 289,131.52 | |
| EQUINIX INC | 6,723 | 4,827,853.53 | |

| | | | |
|--|--------|--------------|--|
| EQUITY COMMONWEALTH REIT | 8,994 | 255,069.84 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 12,788 | 876,873.16 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 25,464 | 1,899,105.12 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST | 8,801 | 229,530.08 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 4,885 | 1,452,505.90 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 9,964 | 1,470,088.56 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1,217 | 16,405.16 | |
| FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 5,233 | 574,740.39 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 9,994 | 487,107.56 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 5,235 | 153,699.60 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION | 6,015 | 33,082.50 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 16,465 | 756,402.10 | |
| GEO GROUP INC | 9,546 | 56,416.86 | |
| GETTY REALTY CORPORATION | 3,220 | 99,465.80 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION | 3,102 | 64,304.46 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 1,730 | 36,572.20 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 4,403 | 63,623.35 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 6,857 | 130,351.57 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 10,873 | 349,023.30 | |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 16,198 | 467,312.30 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 40,238 | 1,367,689.62 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 2,876 | 30,111.72 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 7,786 | 334,798.00 | |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 53,394 | 923,182.26 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 11,456 | 314,008.96 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST | 7,584 | 126,652.80 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 4,808 | 117,988.32 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 1,827 | 332,440.92 | |
| INVITATION HOMES INC | 42,748 | 1,450,867.12 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 21,490 | 866,476.80 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 8,057 | 259,193.69 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 54,000 | 39,690.00 | |

| | | | |
|---|---------|--------------|--|
| KILROY REALTY CORP | 7,752 | 519,616.56 | |
| KIMCO REALTY CORPORATION | 32,263 | 657,197.31 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 7,036 | 144,519.44 | |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 19,964 | 238,969.08 | |
| LIFE STORAGE INC | 5,527 | 524,235.95 | |
| LTC PROPERTIES INC | 2,847 | 122,250.18 | |
| MACERICH COMPANY/THE | 9,580 | 124,348.40 | |
| MACK-CALI REALTY CORPORATION | 5,757 | 92,630.13 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 121,700 | 88,841.00 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 42,948 | 972,342.72 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES | 8,652 | 1,342,703.88 | |
| MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP | 7,136 | 130,731.52 | |
| NATIONAL HEALTH INVESTORS INC | 3,379 | 245,619.51 | |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 13,181 | 622,011.39 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 4,465 | 200,657.10 | |
| NETSTREIT CORP | 2,801 | 58,512.89 | |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 5,922 | 39,262.86 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 1,760 | 88,827.20 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 3,872 | 106,751.04 | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 17,778 | 673,608.42 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 1,014 | 24,863.28 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 11,445 | 116,281.20 | |
| PARK HOTELS AND RESORTS INC | 17,591 | 385,594.72 | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 10,153 | 249,256.15 | |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 16,350 | 307,543.50 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 9,036 | 163,461.24 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 1,781 | 31,666.18 | |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 2,900 | 30,334.00 | |
| PRIME US REIT | 54,200 | 45,528.00 | |
| PROLOGIS INC | 55,672 | 6,395,042.64 | |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 1,568 | 256,901.12 | |
| PUBLIC STORAGE | 11,470 | 3,174,551.90 | |

| | | | |
|---|--------|--------------|--|
| QTS REALTY TRUST INC-CL A | 4,755 | 315,827.10 | |
| REALTY INCOME CORPORATION | 27,973 | 1,941,326.20 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 11,708 | 727,300.96 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 9,864 | 173,409.12 | |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA | 17,002 | 197,223.20 | |
| RETAIL VALUE INC | 655 | 12,883.85 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 9,544 | 527,115.12 | |
| RLJ LODGING TRUST | 12,486 | 196,404.78 | |
| RPT REALTY | 6,346 | 80,149.98 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 4,011 | 304,595.34 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT | 15,826 | 282,968.88 | |
| SAFEHOLD INC | 1,242 | 83,201.58 | |
| SAUL CENTERS INC | 703 | 29,097.17 | |
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 3,468 | 63,325.68 | |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 12,534 | 150,784.02 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 24,472 | 2,861,266.24 | |
| SITE CENTERS CORP | 12,194 | 182,544.18 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 5,137 | 366,011.25 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 8,476 | 389,811.24 | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 12,052 | 437,126.04 | |
| STORE CAPITAL CORP | 18,293 | 653,608.89 | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 6,976 | 69,550.72 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 8,397 | 1,353,092.58 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 15,464 | 195,774.24 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC | 5,911 | 100,368.78 | |
| TERRENO REALTY CORP | 4,856 | 307,627.60 | |
| UDR INC | 22,389 | 1,047,357.42 | |
| UMH PROPERTIES INC | 2,728 | 58,542.88 | |
| UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST | 775 | 53,475.00 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 8,922 | 163,272.60 | |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A | 2,927 | 52,978.70 | |
| VENTAS INC | 28,379 | 1,554,317.83 | |

| | | | |
|-------|---|-----------|----------------------------------|
| | VEREIT INC | 16,997 | 712,344.27 |
| | VICI PROPERTIES INC | 39,957 | 1,230,675.60 |
| | VORNADO REALTY TRUST | 11,474 | 514,264.68 |
| | WASHINGTON PRIME GROUP INC | 682 | 1,452.66 |
| | WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 5,882 | 134,286.06 |
| | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 9,693 | 303,778.62 |
| | WELLTOWER INC | 31,480 | 2,374,851.20 |
| | WHITESTONE REIT | 4,511 | 44,027.36 |
| | WP CAREY INC | 13,151 | 965,020.38 |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 8,231 | 153,261.22 |
| | 米ドル 小計 | 1,876,407 | 79,489,280.99 (8,576,098,526) |
| カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE | 4,531 | 185,997.55 |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 5,337 | 57,639.60 |
| | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | 869 | 10,071.71 |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,000 | 74,380.00 |
| | CAN APARTMENT PROP | 6,660 | 368,298.00 |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 12,026 | 170,528.68 |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR | 6,216 | 60,543.84 |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2,613 | 42,670.29 |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,200 | 52,864.00 |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR | 5,837 | 79,499.94 |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 2,905 | 61,295.50 |
| | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 7,380 | 128,781.00 |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 2,243 | 176,591.39 |
| | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,212 | 166,273.96 |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 4,450 | 69,420.00 |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 3,469 | 66,708.87 |
| | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 914 | 20,245.10 |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RE | 1,557 | 24,304.77 |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 7,085 | 92,742.65 |

| | | | |
|-----|--|---------|-------------------------------|
| | PLAZA RETAIL REIT | 3,747 | 14,725.71 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,532 | 236,636.64 |
| | SLATE GROCERY REIT | 500 | 6,080.00 |
| | SLATE OFFICE REIT | 3,663 | 16,080.57 |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 5,277 | 148,178.16 |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 6,456 | 103,877.04 |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST | 6,603 | 46,551.15 |
| | WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I | 3,417 | 71,962.02 |
| | カナダドル 小計 | 131,699 | 2,552,948.14 (220,983,190) |
| ユーロ | AEDIFICA | 2,494 | 256,632.60 |
| | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 13,175 | 190,774.00 |
| | ALTAREA | 280 | 46,424.00 |
| | BEFIMMO SCA | 2,074 | 73,212.20 |
| | CARE PROPERTY INVEST | 2,315 | 58,453.75 |
| | CARMILA | 3,073 | 41,731.34 |
| | COFINIMMO | 2,117 | 270,976.00 |
| | COVIVIO | 3,674 | 278,489.20 |
| | CROMWELL EUROPEAN REIT | 76,600 | 36,385.00 |
| | EUROCOMMERCIAL | 2,557 | 52,418.50 |
| | GECINA SA | 4,115 | 495,240.25 |
| | HAMBORNER REIT AG | 5,713 | 53,188.03 |
| | HIBERNIA REIT PLC | 40,242 | 47,324.59 |
| | ICADE | 2,374 | 152,292.10 |
| | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 3,408 | 13,223.04 |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 18,812 | 155,857.42 |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | 2,057 | 45,254.00 |
| | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 38,432 | 63,105.34 |
| | KLEPIERRE | 15,135 | 313,899.90 |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 4,421 | 23,387.09 |
| | MERCIALYS | 2,280 | 23,552.40 |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 24,871 | 223,988.22 |
| | MONTEA | 842 | 77,548.20 |

| | | | |
|-------|--------------------------------------|---------|-------------------------------|
| | NSI NV | 1,336 | 45,758.00 |
| | RETAIL ESTATES | 638 | 38,662.80 |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED | 10,486 | 698,472.46 |
| | VASTNED RETAIL | 1,421 | 34,672.40 |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 9,853 | 294,407.64 |
| | WERELDHAVE NV | 3,304 | 46,751.60 |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 1,187 | 54,958.10 |
| | ユーロ 小計 | 299,286 | 4,207,040.17 (549,229,094) |
| 英bond | AEW UK REIT PLC | 9,000 | 8,361.00 |
| | ASSURA PLC | 192,407 | 142,188.77 |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 12,633 | 152,732.97 |
| | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | 63,210 | 50,188.74 |
| | BRITISH LAND CO PLC | 70,201 | 358,025.10 |
| | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 64,631 | 116,012.64 |
| | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 42,625 | 48,251.50 |
| | CUSTODIAN REIT PLC | 27,002 | 26,353.95 |
| | DERWENT LONDON PLC | 8,287 | 279,769.12 |
| | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 49,102 | 42,669.63 |
| | GCP STUDENT LIVING PLC | 31,176 | 52,625.08 |
| | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 19,544 | 135,928.52 |
| | HAMMERSON PLC | 301,207 | 114,368.29 |
| | HOME REIT PLC | 17,550 | 20,007.00 |
| | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 23,000 | 26,220.00 |
| | INTU PROPERTIES PLC | 28,500 | 285.00 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 56,546 | 402,381.33 |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 65,725 | 148,801.40 |
| | LXI REIT PLC | 36,635 | 48,138.39 |
| | NEWRIVER REIT PLC | 17,642 | 17,924.27 |
| | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 57,141 | 51,884.02 |
| | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 99,269 | 149,102.03 |
| | RDI REIT PLC | 32,563 | 39,401.23 |
| | REGIONAL REIT LTD | 45,664 | 37,672.80 |
| | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 15,455 | 131,212.95 |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 15,000 | 6,337.50 |

| | | | |
|-----------|--|-----------|-------------------------------|
| | TRUST | | |
| | SEGRO PLC | 89,084 | 887,276.64 |
| | SHAFTESBURY PLC | 23,307 | 146,367.96 |
| | STANDARD LIFE INV PROP INC | 53,280 | 35,004.96 |
| | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 53,099 | 60,532.86 |
| | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 34,770 | 35,882.64 |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 121,677 | 229,482.82 |
| | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 58,562 | 44,741.36 |
| | UNITE GROUP PLC | 30,847 | 353,198.15 |
| | WORKSPACE GROUP PLC | 9,219 | 73,613.71 |
| | 英bond 小計 | 1,875,560 | 4,472,944.33 (670,002,331) |
| オーストラリアドル | ABACUS PROPERTY GROUP | 23,209 | 68,002.37 |
| | APN INDUSTRIA REIT | 13,221 | 40,324.05 |
| | ARENA REIT | 28,622 | 91,304.18 |
| | AVENTUS GROUP | 25,000 | 70,750.00 |
| | BWP TRUST | 34,253 | 140,437.30 |
| | CENTURIA CAPITAL GROUP | 46,643 | 127,335.39 |
| | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 40,528 | 139,011.04 |
| | CENTURIA OFFICE REIT | 24,034 | 50,231.06 |
| | CHARTER HALL GROUP | 34,432 | 481,359.36 |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 36,546 | 179,440.86 |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 42,995 | 161,661.20 |
| | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 33,955 | 107,976.90 |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 158,718 | 138,878.25 |
| | DEXUS | 79,907 | 800,668.14 |
| | GDI PROPERTY GROUP | 18,000 | 19,170.00 |
| | GOODMAN GROUP | 126,807 | 2,444,838.96 |
| | GPT GROUP | 145,221 | 672,373.23 |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUS | 15,930 | 56,710.80 |
| | HOME CONSORTIUM | 10,000 | 48,700.00 |
| | HOMEKO DAILY NEEDS REIT | 40,492 | 52,234.68 |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 15,921 | 49,036.68 |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 21,419 | 113,092.32 |
| | IRONGATE GROUP | 42,404 | 57,033.38 |

| | | | |
|------------|---|-----------|--------------------------------|
| | MIRVAC GROUP | 299,202 | 774,933.18 |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 80,507 | 165,039.35 |
| | RURAL FUNDS GROUP | 10,000 | 23,800.00 |
| | SCENTRE GROUP | 388,778 | 1,053,588.38 |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR | 73,925 | 185,551.75 |
| | STOCKLAND | 183,438 | 845,649.18 |
| | VICINITY CENTRES | 302,292 | 479,132.82 |
| | WAYPOINT REIT LTD | 50,503 | 125,752.47 |
| | オーストラリアドル 小計 | 2,446,902 | 9,764,017.28 (817,150,606) |
| ニュージーランドドル | ARGOSY PROPERTY LTD | 54,280 | 81,148.60 |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 83,533 | 190,455.24 |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 114,444 | 143,055.00 |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 80,117 | 132,193.05 |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 35,571 | 103,511.61 |
| | ニュージーランドドル 小計 | 367,945 | 650,363.50 (50,526,740) |
| 香港ドル | CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT | 127,000 | 580,390.00 |
| | FORTUNE REIT | 114,000 | 904,020.00 |
| | LINK REIT | 157,400 | 11,789,260.00 |
| | PROSPERITY REIT | 60,000 | 154,800.00 |
| | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 81,000 | 343,440.00 |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 124,000 | 483,600.00 |
| | 香港ドル 小計 | 663,400 | 14,255,510.00 (198,151,589) |
| シンガポールドル | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 23,500 | 32,195.00 |
| | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 117,300 | 87,975.00 |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 236,600 | 735,826.00 |
| | ASCOTT TRUST | 156,755 | 163,025.20 |
| | CAPITALAND CHINA TRUST | 61,000 | 84,790.00 |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 344,308 | 747,148.36 |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 69,050 | 86,312.50 |

| | | | |
|-----------|--|-----------|--------------------------------|
| | ESR REIT | 217,952 | 89,360.32 |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 46,000 | 29,210.00 |
| | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28,000 | 7,280.00 |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 92,500 | 226,625.00 |
| | FRASERS HOSPITALITY TRUST | 54,600 | 31,668.00 |
| | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 191,538 | 279,645.48 |
| | IREIT GLOBAL | 57,600 | 37,152.00 |
| | KEPPEL DC REIT | 99,300 | 270,096.00 |
| | KEPPEL REIT | 143,100 | 173,151.00 |
| | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 57,600 | 45,504.00 |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T | 321,700 | 22,519.00 |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 162,500 | 344,500.00 |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 127,800 | 357,840.00 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 219,750 | 432,907.50 |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 167,200 | 180,576.00 |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 243,200 | 97,280.00 |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 29,800 | 123,968.00 |
| | SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT | 31,000 | 13,175.00 |
| | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 20,000 | 18,200.00 |
| | SPH REIT | 74,600 | 65,648.00 |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 138,200 | 77,392.00 |
| | SUNTEC REIT | 147,500 | 228,625.00 |
| | シンガポールドル 小計 | 3,679,953 | 5,089,594.36 (414,140,293) |
| 韓国ウォン | JR REIT XXVII | 8,500 | 43,945,000.00 |
| | KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 2,600 | 14,664,000.00 |
| | LOTTE REIT CO LTD | 9,703 | 52,396,200.00 |
| | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 5,000 | 24,725,000.00 |
| | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 3,100 | 24,459,000.00 |
| | 韓国ウォン 小計 | 28,903 | 160,189,200.00 (15,522,333) |
| イスラエルシェケル | REIT 1 LTD | 13,478 | 231,282.48 |

| | | | |
|--|--------------|--------|------------------------------------|
| | イスラエルシェケル 小計 | 13,478 | 231,282.48 (7,676,126) |
| | 合計 | | 11,519,480,828 (11,519,480,828) |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|------------|----------------|------------|
| 米ドル | 投資証券 155銘柄 | 74.0% | 74.4% |
| カナダドル | 投資証券 27銘柄 | 1.9% | 1.9% |
| ユーロ | 投資証券 30銘柄 | 4.7% | 4.8% |
| 英ポンド | 投資証券 35銘柄 | 5.8% | 5.8% |
| オーストラリアドル | 投資証券 31銘柄 | 7.1% | 7.1% |
| ニュージーランドドル | 投資証券 5銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| 香港ドル | 投資証券 6銘柄 | 1.7% | 1.7% |
| シンガポールドル | 投資証券 29銘柄 | 3.6% | 3.6% |
| 韓国ウォン | 投資証券 5銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| イスラエルシェケル | 投資証券 1銘柄 | 0.1% | 0.1% |

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27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|---------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 192,151,216 | 115,436,377 |
| コール・ローン | 196,989,558 | 264,898,208 |
| 国債証券 | 108,583,603,390 | 105,830,132,390 |
| 地方債証券 | 8,517,711,860 | 8,548,198,020 |
| 特殊債券 | 13,069,990,511 | 11,590,909,198 |
| 社債券 | 5,677,516,000 | 4,049,851,000 |
| 未収入金 | - | 147,505,200 |
| 未収利息 | 289,194,993 | 272,216,894 |
| 前払費用 | 8,769,806 | 3,189,756 |
| 流動資産合計 | 136,535,927,334 | 130,822,337,043 |
| 資産合計 | 136,535,927,334 | 130,822,337,043 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 267,801,200 | - |
| 未払解約金 | 14,451,749 | 121,292,855 |
| 未払利息 | 568 | 766 |
| その他未払費用 | 65,632 | 12,631 |
| 流動負債合計 | 282,319,149 | 121,306,252 |
| 負債合計 | 282,319,149 | 121,306,252 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 105,756,496,620 | 102,129,036,469 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 30,497,111,565 | 28,571,994,322 |
| 元本等合計 | 136,253,608,185 | 130,701,030,791 |
| 純資産合計 | 136,253,608,185 | 130,701,030,791 |
| 負債純資産合計 | 136,535,927,334 | 130,822,337,043 |

注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|----|-----------------|-----------------|
|----|-----------------|-----------------|

| | | |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 105,756,496,620口 | 102,129,036,469口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2884円 12,884円) | 1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2798円 12,798円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2020年 4月27日現在) | |
|----------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 106,140,437,914円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 15,790,563,721円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,174,505,015円 |
| 2020年 4月27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) | 4,960,619,822円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 8,292,722,898円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,724,283,160円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 723,543,579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) | 44,849,500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) | 169,123,013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) | 346,223,015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) | 355,076,247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) | 136,949,340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) | 250,983,539円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 120,216,127円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 3,623,380,687円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 1,332,579,445円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 618,268,109円 |
| 三井住友D S・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) | 1,159,440,155円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 367,819,534円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 512,477,144円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 86,973,783円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 7,138,094円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 46,310,563円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 3,099,040円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 5,101,208円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 1,062,845円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,688,392円 |
| S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 5,908,244,271円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 > | 15,284,484,645円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 > | 6,538,002,991円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 > | 15,594,252,520円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 > | 310,135,056円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 > | 527,038,286円 |
| 世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 > | 1,972,815円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 > | 223,691,964円 |
| S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 103,533,600円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 > | 1,857,717,650円 |
| S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 > | 1,979,603,373円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 > | 2,449,603,074円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 > | 9,079,019,613円 |
| S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 > | 2,114,879円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用） | 1,354,089,917円 |
| S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 > | 448,466,921円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 > | 622,144,119円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 > | 170,571,267円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 41,651,607円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 > | 1,741,366,557円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 > | 2,265,783,446円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 884,727,878円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 200,322,382円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 17,629,769円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 304,049,534円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 5,571,268,063円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 257,779,674円 |
| S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 > | 379,382,709円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 > | 1,223,935,464円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 1,463,120,766円 |
| S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 4,046,048,431円 |
| 合計 | 105,756,496,620円 |

(2021年 4月26日現在)

| | |
|-----------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 105,756,496,620円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 20,315,447,294円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 23,942,907,445円 |
| 2021年 4月26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） | 6,095,887,942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 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 700,095,955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) | 184,825,933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) | 433,396,306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) | 578,861,248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) | 261,394,053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) | 405,524,676円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 136,367,739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) | 1,247,380,644円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 401,741,595円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 588,869,057円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 120,192,626円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 34,443,552円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 93,363,201円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 77,139,001円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 128,231,732円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 35,509,835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> | 1,590,676,701円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 14,416,480,636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> | 291,860,981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> | 124,997,220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> | 2,221,232,701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> | 9,293,268,718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) | 1,258,717,162円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 469,800,479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> | 182,525,240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> | 1,623,185,800円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,259,171,883円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 791,362,877円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 219,084,514円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,227,758円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 298,258,456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 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 > | 758,516,436円 |
| S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 > | 3,349,108,014円 |
| 合計 | 102,129,036,469円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第4 1 9 回利付国債(2年) | 2,090,000,000 | 2,097,858,400 | |
| | 第4 2 0 回利付国債(2年) | 510,000,000 | 512,019,600 | |
| | 第4 2 1 回利付国債(2年) | 390,000,000 | 391,622,400 | |
| | 第4 2 2 回利付国債(2年) | 390,000,000 | 391,727,700 | |
| | 第4 2 3 回利付国債(2年) | 210,000,000 | 210,567,000 | |
| | 第1 3 3 回利付国債(5年) | 48,000,000 | 48,151,200 | |
| | 第1 3 4 回利付国債(5年) | 110,000,000 | 110,418,000 | |
| | 第1 3 5 回利付国債(5年) | 190,000,000 | 190,830,300 | |
| | 第1 3 6 回利付国債(5年) | 500,000,000 | 502,475,000 | |
| | 第1 3 7 回利付国債(5年) | 100,000,000 | 100,565,000 | |
| | 第1 3 8 回利付国債(5年) | 600,000,000 | 603,906,000 | |
| | 第1 3 9 回利付国債(5年) | 260,000,000 | 261,851,200 | |
| | 第1 4 0 回利付国債(5年) | 600,000,000 | 604,548,000 | |
| | 第1 4 1 回利付国債(5年) | 15,000,000 | 15,120,300 | |
| | 第1 4 2 回利付国債(5年) | 680,000,000 | 685,854,800 | |
| | 第1 4 3 回利付国債(5年) | 770,000,000 | 777,084,000 | |
| | 第1 4 4 回利付国債(5年) | 1,250,000,000 | 1,261,987,500 | |
| | 第1 4 5 回利付国債(5年) | 1,310,000,000 | 1,323,034,500 | |
| | 第1 4 6 回利付国債(5年) | 1,840,000,000 | 1,858,473,600 | |
| | 第1 4 7 回利付国債(5年) | 340,000,000 | 341,839,400 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第1回利付国債(40年) | 40,000,000 | 58,086,400 | |
| 第2回利付国債(40年) | 242,000,000 | 341,045,760 | |
| 第3回利付国債(40年) | 185,000,000 | 261,760,200 | |
| 第4回利付国債(40年) | 247,000,000 | 350,735,060 | |
| 第5回利付国債(40年) | 225,000,000 | 309,116,250 | |
| 第6回利付国債(40年) | 240,000,000 | 325,269,600 | |
| 第7回利付国債(40年) | 255,000,000 | 332,976,450 | |
| 第8回利付国債(40年) | 300,000,000 | 367,083,000 | |
| 第9回利付国債(40年) | 483,000,000 | 443,606,520 | |
| 第10回利付国債(40年) | 470,000,000 | 505,668,300 | |
| 第11回利付国債(40年) | 330,000,000 | 344,727,900 | |
| 第12回利付国債(40年) | 390,000,000 | 368,292,600 | |
| 第13回利付国債(40年) | 465,000,000 | 438,578,700 | |
| 第326回利付国債(10年) | 77,000,000 | 78,049,510 | |
| 第327回利付国債(10年) | 25,000,000 | 25,382,000 | |
| 第328回利付国債(10年) | 130,000,000 | 131,790,100 | |
| 第329回利付国債(10年) | 2,030,000,000 | 2,070,660,900 | |
| 第330回利付国債(10年) | 1,285,000,000 | 1,313,925,350 | |
| 第332回利付国債(10年) | 793,000,000 | 808,598,310 | |
| 第333回利付国債(10年) | 815,000,000 | 832,652,900 | |
| 第334回利付国債(10年) | 315,000,000 | 322,367,850 | |
| 第335回利付国債(10年) | 50,000,000 | 51,084,000 | |
| 第336回利付国債(10年) | 340,000,000 | 347,915,200 | |
| 第337回利付国債(10年) | 120,000,000 | 121,914,000 | |
| 第338回利付国債(10年) | 805,000,000 | 821,864,750 | |
| 第339回利付国債(10年) | 785,000,000 | 802,348,500 | |
| 第340回利付国債(10年) | 770,000,000 | 787,879,400 | |
| 第341回利付国債(10年) | 557,000,000 | 567,933,910 | |
| 第342回利付国債(10年) | 350,000,000 | 353,528,000 | |
| 第343回利付国債(10年) | 890,000,000 | 899,202,600 | |
| 第344回利付国債(10年) | 811,000,000 | 819,580,380 | |
| 第345回利付国債(10年) | 818,000,000 | 826,818,040 | |
| 第346回利付国債(10年) | 640,000,000 | 647,014,400 | |
| 第347回利付国債(10年) | 540,000,000 | 546,004,800 | |
| 第348回利付国債(10年) | 345,000,000 | 348,767,400 | |
| 第349回利付国債(10年) | 250,000,000 | 252,752,500 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第350回利付国債(10年) | 640,000,000 | 647,084,800 | |
| 第351回利付国債(10年) | 290,000,000 | 293,120,400 | |
| 第352回利付国債(10年) | 790,000,000 | 798,208,100 | |
| 第353回利付国債(10年) | 640,000,000 | 646,374,400 | |
| 第354回利付国債(10年) | 845,000,000 | 853,019,050 | |
| 第355回利付国債(10年) | 870,000,000 | 877,438,500 | |
| 第356回利付国債(10年) | 850,000,000 | 856,774,500 | |
| 第357回利付国債(10年) | 390,000,000 | 392,862,600 | |
| 第358回利付国債(10年) | 1,100,000,000 | 1,107,315,000 | |
| 第359回利付国債(10年) | 780,000,000 | 784,617,600 | |
| 第360回利付国債(10年) | 1,870,000,000 | 1,879,611,800 | |
| 第361回利付国債(10年) | 1,020,000,000 | 1,023,906,600 | |
| 第2回利付国債(30年) | 510,000,000 | 617,125,500 | |
| 第4回利付国債(30年) | 340,000,000 | 432,469,800 | |
| 第5回利付国債(30年) | 290,000,000 | 351,897,600 | |
| 第7回利付国債(30年) | 474,000,000 | 588,101,280 | |
| 第9回利付国債(30年) | 100,000,000 | 114,639,000 | |
| 第10回利付国債(30年) | 555,000,000 | 617,337,600 | |
| 第11回利付国債(30年) | 430,000,000 | 510,121,900 | |
| 第12回利付国債(30年) | 590,000,000 | 730,496,700 | |
| 第14回利付国債(30年) | 692,000,000 | 887,849,840 | |
| 第16回利付国債(30年) | 465,000,000 | 606,150,750 | |
| 第18回利付国債(30年) | 450,000,000 | 577,764,000 | |
| 第19回利付国債(30年) | 470,000,000 | 604,965,200 | |
| 第21回利付国債(30年) | 345,000,000 | 446,523,150 | |
| 第22回利付国債(30年) | 315,000,000 | 417,982,950 | |
| 第23回利付国債(30年) | 329,000,000 | 437,678,570 | |
| 第24回利付国債(30年) | 310,000,000 | 413,431,500 | |
| 第25回利付国債(30年) | 300,000,000 | 392,028,000 | |
| 第26回利付国債(30年) | 363,000,000 | 481,210,950 | |
| 第27回利付国債(30年) | 440,000,000 | 593,159,600 | |
| 第28回利付国債(30年) | 386,000,000 | 522,975,960 | |
| 第29回利付国債(30年) | 177,000,000 | 237,875,610 | |
| 第30回利付国債(30年) | 452,000,000 | 601,955,520 | |
| 第31回利付国債(30年) | 315,000,000 | 415,377,900 | |
| 第32回利付国債(30年) | 390,000,000 | 523,395,600 | |

| | | | |
|---------------|-------------|-------------|--|
| 第33回利付国債(30年) | 378,000,000 | 488,640,600 | |
| 第34回利付国債(30年) | 457,000,000 | 610,282,370 | |
| 第35回利付国債(30年) | 390,000,000 | 507,690,300 | |
| 第36回利付国債(30年) | 60,000,000 | 78,361,200 | |
| 第37回利付国債(30年) | 355,000,000 | 458,163,000 | |
| 第38回利付国債(30年) | 360,000,000 | 458,697,600 | |
| 第39回利付国債(30年) | 190,000,000 | 246,479,400 | |
| 第40回利付国債(30年) | 270,000,000 | 344,871,000 | |
| 第41回利付国債(30年) | 270,000,000 | 339,719,400 | |
| 第42回利付国債(30年) | 260,000,000 | 327,459,600 | |
| 第43回利付国債(30年) | 305,000,000 | 384,522,650 | |
| 第44回利付国債(30年) | 300,000,000 | 378,588,000 | |
| 第45回利付国債(30年) | 345,000,000 | 420,630,900 | |
| 第46回利付国債(30年) | 295,000,000 | 359,888,200 | |
| 第47回利付国債(30年) | 280,000,000 | 348,238,800 | |
| 第48回利付国債(30年) | 345,000,000 | 413,872,350 | |
| 第49回利付国債(30年) | 345,000,000 | 414,044,850 | |
| 第50回利付国債(30年) | 355,000,000 | 376,491,700 | |
| 第51回利付国債(30年) | 345,000,000 | 325,224,600 | |
| 第52回利付国債(30年) | 353,000,000 | 349,064,050 | |
| 第53回利付国債(30年) | 247,000,000 | 249,773,810 | |
| 第54回利付国債(30年) | 45,000,000 | 47,603,700 | |
| 第55回利付国債(30年) | 335,000,000 | 354,145,250 | |
| 第56回利付国債(30年) | 320,000,000 | 338,051,200 | |
| 第57回利付国債(30年) | 355,000,000 | 374,755,750 | |
| 第58回利付国債(30年) | 350,000,000 | 369,201,000 | |
| 第59回利付国債(30年) | 400,000,000 | 411,740,000 | |
| 第60回利付国債(30年) | 400,000,000 | 431,280,000 | |
| 第61回利付国債(30年) | 345,000,000 | 354,018,300 | |
| 第62回利付国債(30年) | 105,000,000 | 102,245,850 | |
| 第63回利付国債(30年) | 380,000,000 | 359,533,200 | |
| 第64回利付国債(30年) | 245,000,000 | 231,145,250 | |
| 第65回利付国債(30年) | 355,000,000 | 334,370,950 | |
| 第66回利付国債(30年) | 260,000,000 | 244,483,200 | |
| 第67回利付国債(30年) | 310,000,000 | 307,330,900 | |
| 第68回利付国債(30年) | 400,000,000 | 396,040,000 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第69回利付国債(30年) | 350,000,000 | 355,232,500 | |
| 第70回利付国債(30年) | 20,000,000 | 20,275,600 | |
| 第59回利付国債(20年) | 1,455,000,000 | 1,498,882,800 | |
| 第61回利付国債(20年) | 1,215,000,000 | 1,240,964,550 | |
| 第64回利付国債(20年) | 1,025,000,000 | 1,075,091,750 | |
| 第65回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 1,075,182,000 | |
| 第69回利付国債(20年) | 1,020,000,000 | 1,086,269,400 | |
| 第70回利付国債(20年) | 780,000,000 | 842,509,200 | |
| 第72回利付国債(20年) | 753,000,000 | 810,484,020 | |
| 第74回利付国債(20年) | 664,000,000 | 718,421,440 | |
| 第75回利付国債(20年) | 490,000,000 | 532,786,800 | |
| 第78回利付国債(20年) | 590,000,000 | 639,813,700 | |
| 第82回利付国債(20年) | 620,000,000 | 680,877,800 | |
| 第84回利付国債(20年) | 850,000,000 | 933,810,000 | |
| 第85回利付国債(20年) | 645,000,000 | 714,808,350 | |
| 第88回利付国債(20年) | 742,000,000 | 834,148,980 | |
| 第89回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,380,200 | |
| 第90回利付国債(20年) | 580,000,000 | 652,244,800 | |
| 第92回利付国債(20年) | 734,000,000 | 825,272,900 | |
| 第93回利付国債(20年) | 632,000,000 | 710,077,280 | |
| 第95回利付国債(20年) | 305,000,000 | 349,847,200 | |
| 第97回利付国債(20年) | 677,000,000 | 775,794,610 | |
| 第99回利付国債(20年) | 693,000,000 | 793,193,940 | |
| 第100回利付国債(20年) | 207,000,000 | 239,393,430 | |
| 第101回利付国債(20年) | 355,000,000 | 415,470,700 | |
| 第102回利付国債(20年) | 457,000,000 | 537,317,750 | |
| 第105回利付国債(20年) | 390,000,000 | 451,943,700 | |
| 第106回利付国債(20年) | 370,000,000 | 431,512,500 | |
| 第107回利付国債(20年) | 378,000,000 | 439,727,400 | |
| 第108回利付国債(20年) | 390,000,000 | 447,708,300 | |
| 第109回利付国債(20年) | 340,000,000 | 391,625,600 | |
| 第111回利付国債(20年) | 386,000,000 | 455,375,780 | |
| 第113回利付国債(20年) | 427,000,000 | 502,109,300 | |
| 第114回利付国債(20年) | 363,000,000 | 428,376,300 | |
| 第116回利付国債(20年) | 200,000,000 | 238,610,000 | |
| 第118回利付国債(20年) | 200,000,000 | 235,836,000 | |

| | | | |
|----------------|-------------|-------------|--|
| 第119回利付国債(20年) | 295,000,000 | 342,477,300 | |
| 第120回利付国債(20年) | 200,000,000 | 228,540,000 | |
| 第121回利付国債(20年) | 255,000,000 | 299,275,650 | |
| 第122回利付国債(20年) | 330,000,000 | 384,209,100 | |
| 第123回利付国債(20年) | 80,000,000 | 95,702,400 | |
| 第124回利付国債(20年) | 190,000,000 | 225,469,200 | |
| 第125回利付国債(20年) | 205,000,000 | 248,033,600 | |
| 第126回利付国債(20年) | 180,000,000 | 214,246,800 | |
| 第127回利付国債(20年) | 145,000,000 | 171,160,900 | |
| 第128回利付国債(20年) | 215,000,000 | 254,517,000 | |
| 第129回利付国債(20年) | 190,000,000 | 223,006,800 | |
| 第130回利付国債(20年) | 155,000,000 | 182,402,450 | |
| 第131回利付国債(20年) | 380,000,000 | 443,262,400 | |
| 第132回利付国債(20年) | 450,000,000 | 526,140,000 | |
| 第133回利付国債(20年) | 190,000,000 | 224,152,500 | |
| 第134回利付国債(20年) | 200,000,000 | 236,646,000 | |
| 第135回利付国債(20年) | 155,000,000 | 181,729,750 | |
| 第136回利付国債(20年) | 120,000,000 | 139,400,400 | |
| 第137回利付国債(20年) | 25,000,000 | 29,377,500 | |
| 第139回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,281,800 | |
| 第140回利付国債(20年) | 500,000,000 | 589,175,000 | |
| 第141回利付国債(20年) | 230,000,000 | 271,593,200 | |
| 第142回利付国債(20年) | 110,000,000 | 131,155,200 | |
| 第143回利付国債(20年) | 170,000,000 | 199,158,400 | |
| 第144回利付国債(20年) | 30,000,000 | 34,794,300 | |
| 第145回利付国債(20年) | 110,000,000 | 130,496,300 | |
| 第146回利付国債(20年) | 105,000,000 | 124,812,450 | |
| 第147回利付国債(20年) | 220,000,000 | 259,276,600 | |
| 第148回利付国債(20年) | 59,000,000 | 68,901,970 | |
| 第149回利付国債(20年) | 695,000,000 | 812,830,300 | |
| 第150回利付国債(20年) | 261,000,000 | 302,266,710 | |
| 第151回利付国債(20年) | 770,000,000 | 872,302,200 | |
| 第152回利付国債(20年) | 265,000,000 | 300,419,900 | |
| 第153回利付国債(20年) | 247,000,000 | 283,600,460 | |
| 第154回利付国債(20年) | 580,000,000 | 658,416,000 | |
| 第155回利付国債(20年) | 410,000,000 | 454,095,500 | |

| | | | | |
|--------|----------------------|----------------|-----------------|--|
| | 第156回利付国債(20年) | 380,000,000 | 387,626,600 | |
| | 第157回利付国債(20年) | 175,000,000 | 173,090,750 | |
| | 第158回利付国債(20年) | 360,000,000 | 371,689,200 | |
| | 第159回利付国債(20年) | 418,000,000 | 437,725,420 | |
| | 第160回利付国債(20年) | 355,000,000 | 376,828,950 | |
| | 第161回利付国債(20年) | 320,000,000 | 334,528,000 | |
| | 第162回利付国債(20年) | 210,000,000 | 219,332,400 | |
| | 第163回利付国債(20年) | 670,000,000 | 699,098,100 | |
| | 第164回利付国債(20年) | 215,000,000 | 220,671,700 | |
| | 第165回利付国債(20年) | 590,000,000 | 604,803,100 | |
| | 第166回利付国債(20年) | 295,000,000 | 311,933,000 | |
| | 第167回利付国債(20年) | 500,000,000 | 511,190,000 | |
| | 第168回利付国債(20年) | 150,000,000 | 150,502,500 | |
| | 第169回利付国債(20年) | 400,000,000 | 393,564,000 | |
| | 第170回利付国債(20年) | 255,000,000 | 250,412,550 | |
| | 第171回利付国債(20年) | 495,000,000 | 485,144,550 | |
| | 第172回利付国債(20年) | 500,000,000 | 498,685,000 | |
| | 第173回利付国債(20年) | 515,000,000 | 512,718,550 | |
| | 第174回利付国債(20年) | 610,000,000 | 606,718,200 | |
| | 第175回利付国債(20年) | 375,000,000 | 379,755,000 | |
| 国債証券合計 | | 97,172,000,000 | 105,830,132,390 | |
| 地方債証券 | 第1回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 103,278,000 | |
| | 第1回東京都公募公債(30年) | 100,000,000 | 123,696,000 | |
| | 第6回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 107,729,000 | |
| | 第8回東京都公募公債(30年) | 400,000,000 | 519,924,000 | |
| | 第13回東京都公募公債(30年) | 500,000,000 | 637,765,000 | |
| | 第705回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,933,000 | |
| | 第710回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,921,000 | |
| | 平成24年度第1回北海道公募公債 | 100,000,000 | 100,970,000 | |
| | 平成24年度第14回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,428,000 | |
| | 平成26年度第15回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,569,000 | |
| | 平成29年度第6回北海道公募公債(5年) | 300,000,000 | 299,955,000 | |
| | 第1回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 107,985,000 | |
| | 第3回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 108,692,000 | |
| | 第7回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 112,692,000 | |
| | 第361回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 202,110,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第373回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,906,000 | |
| 第377回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,766,000 | |
| 平成27年度第4回京都府公募公債 | 100,000,000 | 102,230,000 | |
| 平成29年度第12回京都府公募公債 | 300,000,000 | 300,141,000 | |
| 第5回兵庫県公募公債(15年) | 300,000,000 | 325,758,000 | |
| 第7回静岡県公募公債(30年) | 100,000,000 | 129,405,000 | |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 109,520,000 | |
| 平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年) | 200,000,000 | 199,992,000 | |
| 平成25年度第11回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,926,000 | |
| 平成26年度第10回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,680,000 | |
| 平成25年度第8回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 101,688,000 | |
| 第9回群馬県公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,245,000 | |
| 第111回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,046,000 | |
| 第112回共同発行市場公募地方債 | 150,000,000 | 151,549,500 | |
| 第113回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,008,000 | |
| 第114回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,135,000 | |
| 第115回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 202,354,000 | |
| 第118回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,444,000 | |
| 第137回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 203,658,000 | |
| 第172回共同発行市場公募地方債 | 500,000,000 | 504,815,000 | |
| 第183回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 403,556,000 | |
| 第1回名古屋市公募公債(20年) | 200,000,000 | 210,468,000 | |
| 第3回名古屋市公募公債(20年) | 100,000,000 | 108,359,000 | |
| 第5回名古屋市公募公債(20年) | 100,000,000 | 112,143,000 | |
| 第1回京都市公募公債(30年) | 100,000,000 | 134,332,000 | |
| 第7回京都市公募公債(20年) | 100,000,000 | 116,935,000 | |
| 平成29年度第5回京都市公募公債 | 100,000,000 | 100,047,000 | |
| 平成26年度第17回神戸市公募公債 | 100,000,000 | 100,994,000 | |
| 第4回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 107,846,000 | |
| 第9回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 111,840,000 | |
| 第14回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 115,431,000 | |
| 第47回横浜市公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,043,000 | |
| 平成26年度第4回札幌市公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,653,000 | |
| 平成24年度第2回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 101,150,000 | |
| 平成23年度第9回福岡市公募公債 | 147,000,000 | 148,346,520 | |
| 平成29年度第11回福岡市公募公債(5年) | 300,000,000 | 300,141,000 | |

| | | | | |
|---------|----------------------------|---------------|---------------|--|
| 地方債証券合計 | | 7,997,000,000 | 8,548,198,020 | |
| 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 | 211,054,000 | |
| | 第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 300,000,000 | 300,054,000 | |
| | 第36回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 112,821,000 | |
| | 第9回道路債券 | 100,000,000 | 128,952,000 | |
| | 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 150,511,000 | |
| | 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 438,264,000 | |
| | 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 114,324,000 | |
| | 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 349,050,000 | |
| | 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 236,002,000 | |
| | 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 | 232,700,000 | |
| | 第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 132,492,000 | |
| | 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 | 350,607,000 | |
| | 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 | 118,309,000 | |
| | 第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 400,000,000 | 405,312,000 | |
| | 第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 116,257,000 | |
| | 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 | 118,678,000 | |
| | 第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 232,380,000 | |
| | 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 | 203,620,000 | |
| | 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 | 305,169,000 | |
| | 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 | 188,896,050 | |
| | 第2回地方公営企業等金融機構債券(20年) | 100,000,000 | 117,089,000 | |
| | 第3回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 101,932,000 | |
| | 第5回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 105,007,000 | |
| | 第17回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 111,516,000 | |
| | 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年) | 800,000,000 | 800,128,000 | |
| | 第20回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 112,632,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第22回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 113,491,000 | |
| 第24回公営企業債券(20年) | 200,000,000 | 230,198,000 | |
| 第42回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,251,000 | |
| 第45回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 202,860,000 | |
| 第61回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,108,000 | |
| 第62回地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 407,864,000 | |
| 第63回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,853,000 | |
| 第67回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,637,000 | |
| 第101回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,774,000 | |
| 第106回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 201,302,000 | |
| 第342回東京交通債券 | 100,000,000 | 102,759,000 | |
| 第51回政府保証関西国際空港債券 | 100,000,000 | 102,846,000 | |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 10,149,000 | 10,211,314 | |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 12,218,000 | 12,525,527 | |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 10,540,000 | 10,617,996 | |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 13,698,000 | 14,241,673 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 23,224,000 | 23,755,132 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 13,865,000 | 14,528,578 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 36,072,000 | 37,082,016 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 13,614,000 | 14,133,510 | |
| 第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 14,686,000 | 15,453,490 | |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 22,912,000 | 23,156,241 | |
| 第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 17,760,000 | 18,840,163 | |
| 第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,508,000 | 38,932,496 | |
| 第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 55,479,000 | 58,788,322 | |
| 第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 20,432,000 | 21,684,890 | |
| 第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,192,000 | 23,636,033 | |
| 第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 11,061,000 | 11,222,158 | |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 24,952,000 | 26,750,041 | |
| 第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 24,310,000 | 26,049,623 | |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 12,408,000 | 12,708,521 | |
| 第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,374,000 | 51,424,948 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 13,254,000 | 13,706,756 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 25,108,000 | 26,701,855 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 24,604,000 | 26,027,587 | |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 11,975,000 | 12,239,288 | |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 12,920,000 | 13,363,026 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 24,748,000 | 25,565,426 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 31,535,000 | 33,416,378 | |
| 第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 26,423,000 | 28,037,973 | |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 51,164,000 | 54,129,977 | |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 25,837,000 | 27,270,695 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 11,905,000 | 12,278,578 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 57,922,000 | 61,156,943 | |
| 第52回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 116,709,000 | |
| 第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 12,727,000 | 13,174,990 | |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,596,000 | 81,957,671 | |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,582,000 | 38,604,252 | |
| 第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 39,900,000 | 42,140,784 | |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 76,886,000 | 81,292,336 | |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 119,490,000 | 125,848,062 | |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,626,000 | 40,534,124 | |
| 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 44,181,000 | 46,118,336 | |
| 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,886,000 | 94,700,294 | |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,824,000 | 81,650,606 | |
| 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 44,439,000 | 46,858,703 | |
| 第95回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,938,000 | |
| 第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 66,019,000 | 68,408,227 | |
| 第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,128,000 | 85,201,473 | |
| 第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 83,719,000 | 84,560,375 | |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,064,000 | 84,905,480 | |
| 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 85,290,000 | 86,011,553 | |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,655,000 | 85,493,084 | |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,104,000 | 87,172,550 | |
| 第130回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 234,260,000 | |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,025,000 | 90,212,593 | |
| 第167回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,927,000 | |
| 第226回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,825,000 | |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,528,000 | 24,112,200 | |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 26,156,000 | 27,082,445 | |

| | | | | |
|--------|---------------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 12,562,000 | 12,936,221 | |
| | 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 12,108,000 | 12,397,017 | |
| | 第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 26,434,000 | 27,325,618 | |
| | い第810号農林債 | 300,000,000 | 300,333,000 | |
| | 第12回国際協力機構債券 | 100,000,000 | 101,026,000 | |
| | 第45回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 101,234,000 | |
| | 第85回中日本高速道路株式会社社債 | 300,000,000 | 300,132,000 | |
| | 第20回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 101,738,000 | |
| | 第23回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 101,752,000 | |
| 特殊債券合計 | | 10,772,778,000 | 11,590,909,198 | |
| 社債券 | 第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債 | 200,000,000 | 200,750,000 | |
| | 第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,129,000 | |
| | 第30回東レ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,457,000 | |
| | 第56回住友化学株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 201,020,000 | |
| | 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 | 100,747,000 | |
| | 第13回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 100,306,000 | |
| | 第16回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 101,896,000 | |
| | 第22回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,172,000 | |
| | 第63回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 112,983,000 | |
| | 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 | 114,144,000 | |
| | 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 | 101,426,000 | |
| | 第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,012,000 | |
| | 第8回住友信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 112,301,000 | |
| | 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 | 101,456,000 | |
| | 第24回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,141,000 | |
| | 第9回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 111,103,000 | |
| | 第17回NTTファイナンス株式会社無担保社 債 | 200,000,000 | 201,596,000 | |
| | 第93回トヨタファイナンス株式会社無担保社 債 | 400,000,000 | 400,160,000 | |
| | 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 | 100,043,000 | |
| | 第58回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 125,631,000 | |

| | | | |
|-------------------------|---------------|-----------------|--|
| 第38回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,659,000 | |
| 第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 121,380,000 | |
| 第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 115,293,000 | |
| 第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 116,785,000 | |
| 第45回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 100,184,000 | |
| 第27回KDDI株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,862,000 | |
| 第472回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,539,000 | |
| 第508回東北電力株式会社社債 | 200,000,000 | 203,254,000 | |
| 第37回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 200,000,000 | 200,668,000 | |
| 第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 101,309,000 | |
| 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 | 101,445,000 | |
| 社債券合計 | 3,900,000,000 | 4,049,851,000 | |
| 合計 | | 130,019,090,608 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 360,106,290 | 101,589,326 |
| 金銭信託 | 541,173,851 | 105,268,890 |
| コール・ローン | 554,800,539 | 241,566,316 |
| 国債証券 | 151,493,147,031 | 161,434,643,407 |
| 派生商品評価勘定 | - | 1,325,008 |
| 未収入金 | 603,699,765 | 653,000,000 |
| 未収利息 | 1,214,583,803 | 1,174,280,811 |
| 前払費用 | 24,133,730 | 20,257,638 |
| 流動資産合計 | 154,791,645,009 | 163,731,931,396 |
| 資産合計 | 154,791,645,009 | 163,731,931,396 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 489,197 |
| 未払金 | - | 647,205,081 |
| 未払解約金 | 24,888,000 | 265,826,302 |
| 未払利息 | 1,600 | 699 |
| その他未払費用 | 96,959 | 9,108 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 流動負債合計 | 24,986,559 | 913,530,387 |
| 負債合計 | 24,986,559 | 913,530,387 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 84,222,011,513 | 84,390,597,281 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 70,544,646,937 | 78,427,803,728 |
| 元本等合計 | 154,766,658,450 | 162,818,401,009 |
| 純資産合計 | 154,766,658,450 | 162,818,401,009 |
| 負債純資産合計 | 154,791,645,009 | 163,731,931,396 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|---------------------------|--|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | | |
|----|-----------------|-----------------|
| 項目 | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|----|-----------------|-----------------|

| | | |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 84,222,011,513口 | 84,390,597,281口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.8376円 (10,000口当たりの純資産額 18,376円) | 1口当たり純資産額 1.9293円 (10,000口当たりの純資産額 19,293円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|---|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 4月27日現在)

該当事項はありません。

（2021年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（注）1．時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|--|
| 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 92,716,959,106円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,574,435,093円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 12,069,382,686円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 21,729,513,907円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 624,392,248円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,639,945,488円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 795,329,382円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 129,517,808円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 7,529,832円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,214,262円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 86,193,258円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 124,470,791円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 70,383,469円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 145,145,162円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 22,380,605円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 71,914,897円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 92,768,309円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 72,967,241円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 5,928,646円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 62,281,421円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 62,871,730円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 127,695,973円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 45,528,590円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 20,498,377円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 42,824,955円 |
| 三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド | 3,298,976円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 392,647円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 1,011,591円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 493,390円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,121,849円 |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 1,998,553,072円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 65,167,979円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用> | 9,424,682,581円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用> | 4,879,897,341円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用> | 10,719,433,443円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定> | 35,972,335円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定> | 89,375,303円 |
| 世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定> | 383,602円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用> | 618,347,209円 |
| S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定> | 107,986,579円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用> | 1,121,811,212円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,345,145,307円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,698,058,269円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 5,414,915,975円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,474,614円 |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 9,204,968,865円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 362,540,257円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 155,841,347円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 99,751,871円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 35,912,561円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 12,525,068円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 128,196,997円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 486,454,418円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 144,536,692円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 41,239,972円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,161,186円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,191,024,810円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 18,574,156円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 1,842,966,759円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 1,211,426,201円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 4,904,594,450円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 517,849,138円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 39,007,369円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 40,310,514円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 34,933,875円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 43,080,625円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 165,294,757円 |
| 合計 | 84,222,011,513円 |

(2021年 4月26日現在)

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 84,222,011,513円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 11,191,601,392円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 11,023,015,624円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 23,534,936,984円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 729,649,813円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,025,052,215円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,054,240,718円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 147,217,912円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 6,940,706円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,769,951円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 94,042,578円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 178,438,989円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 114,062,243円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 213,016,075円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 24,082,222円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 139,530,302円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 165,360,909円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 88,010,634円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 82,884,377円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,098,149円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 70,276,236円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 46,159,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 110,380,542円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 33,794,045円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 22,772,725円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 82,278,579円 |
| 三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド | 123,896,191円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 9,281,514円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 24,027,031円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 15,516,979円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,832,778円 |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,338,391,074円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 53,057,364円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用> | 8,328,869,926円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用> | 4,860,208,256円 |
| S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用> | 11,174,840,543円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定> | 35,901,694円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定> | 97,373,210円 |
| S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用> | 740,287,615円 |
| S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定> | 121,217,577円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用> | 1,100,173,191円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用> | 1,455,394,432円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用> | 1,680,280,937円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用> | 5,267,062,313円 |
| S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定> | 619,895円 |
| S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定> | 8,780,087,672円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用) | 345,222,445円 |
| S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定> | 154,703,653円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用> | 90,561,097円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用> | 35,408,120円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用> | 11,874,819円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用> | 108,523,473円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用> | 453,166,105円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用> | 119,259,614円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用> | 42,530,817円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用> | 5,288,637円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用> | 1,117,376,981円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A<適格機関投資家限定> | 715,810,156円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A<適格機関投資家限定> | 1,078,469,323円 |

| | |
|---|-----------------|
| S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 > | 3,029,032,100円 |
| S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 > | 474,627,289円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 > | 47,517,572円 |
| S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 > | 64,301,287円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 > | 177,723,755円 |
| S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 > | 149,075,586円 |
| S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 > | 956,808,220円 |
| 合計 | 84,390,597,281円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|-----------------------|--------------|--------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B 0.125 | 1,800,000.00 | 1,800,070.30 | |
| | | US TREASURY N/B 0.125 | 4,300,000.00 | 4,292,441.41 | |
| | | US TREASURY N/B 0.125 | 8,000,000.00 | 7,983,437.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.125 | 5,700,000.00 | 5,683,746.10 | |
| | | US TREASURY N/B 0.125 | 7,700,000.00 | 7,664,207.01 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 5,000,000.00 | 5,007,812.50 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 7,700,000.00 | 7,709,625.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 3,000,000.00 | 2,999,765.64 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 2,400,000.00 | 2,361,093.74 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 3,300,000.00 | 3,241,992.20 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 2,000,000.00 | 1,960,234.38 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 3,000,000.00 | 2,973,515.64 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 2,000,000.00 | 1,966,171.88 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 3,000,000.00 | 2,945,742.18 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 4,700,000.00 | 4,483,175.79 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 0.375 | 7,800,000.00 | 7,413,656.25 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 1,500,000.00 | 1,495,488.28 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 3,000,000.00 | 2,898,867.18 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 3,000,000.00 | 2,893,828.14 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 4,400,000.00 | 4,238,093.77 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 1,500,000.00 | 1,462,968.75 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 1,000,000.00 | 963,320.31 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 3,200,000.00 | 3,078,875.00 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 7,500,000.00 | 6,931,933.57 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 8,800,000.00 | 8,102,531.27 | |
| US TREASURY N/B 0.75 | 6,700,000.00 | 6,491,148.47 | |
| US TREASURY N/B 0.875 | 7,000,000.00 | 6,578,632.82 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 1,500,000.00 | 1,532,402.34 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 2,000,000.00 | 2,010,703.12 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 3,500,000.00 | 3,359,726.58 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 3,000,000.00 | 3,070,078.14 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 5,100,000.00 | 3,996,128.91 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,000,000.00 | 4,073,750.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 3,066,914.07 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 500,000.00 | 512,734.37 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,500,000.00 | 2,567,578.12 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 3,000,000.00 | 3,083,085.93 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 1,000,000.00 | 1,031,367.19 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 2,600,000.00 | 2,661,648.44 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 4,900,000.00 | 3,967,277.35 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,500,000.00 | 3,567,402.33 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,074,765.64 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 3,000,000.00 | 3,077,343.75 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 2,000,000.00 | 2,071,718.76 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 1,500,000.00 | 1,545,234.37 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 1,000,000.00 | 1,027,304.69 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 4,500,000.00 | 4,506,855.48 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 2,000,000.00 | 2,040,000.00 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,400,000.00 | 3,469,593.75 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,500,000.00 | 3,581,484.37 | |

| | | | |
|-----------------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,000,000.00 | 4,097,968.76 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,087,070.32 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,089,765.64 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,103,710.93 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,700,000.00 | 4,884,144.53 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,550,000.00 | 4,726,490.22 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,900,000.00 | 4,041,679.70 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,000,000.00 | 3,105,820.32 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 4,450,000.00 | 4,522,486.31 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 3,200,000.00 | 2,763,624.98 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1,800,000.00 | 1,827,773.44 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,400,000.00 | 2,440,218.74 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 1,600,000.00 | 1,628,000.00 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,054,140.64 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,058,242.18 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,070,312.50 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000.00 | 3,085,078.14 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,700,000.00 | 2,786,273.45 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 11,800,000.00 | 12,307,953.18 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 850,000.00 | 887,386.72 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 2,400,000.00 | 2,500,781.25 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 4,000,000.00 | 4,101,562.52 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 2,000,000.00 | 2,033,125.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,054,023.43 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,058,242.18 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,700,000.00 | 1,738,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 4,800,000.00 | 4,914,562.51 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000.00 | 3,079,921.89 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,800,000.00 | 1,886,835.94 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,400,000.00 | 1,470,875.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,200,000.00 | 3,360,375.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 1,100,000.00 | 1,010,109.37 | |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000.00 | 3,072,070.32 | |
| US TREASURY N/B 2 | 3,500,000.00 | 3,599,394.54 | |
| US TREASURY N/B 2 | 5,000,000.00 | 5,149,609.40 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 2 | 3,800,000.00 | 3,926,617.17 | |
| US TREASURY N/B 2 | 2,000,000.00 | 2,099,218.76 | |
| US TREASURY N/B 2 | 3,300,000.00 | 3,465,773.45 | |
| US TREASURY N/B 2 | 2,500,000.00 | 2,627,734.37 | |
| US TREASURY N/B 2 | 3,500,000.00 | 3,693,593.75 | |
| US TREASURY N/B 2 | 4,300,000.00 | 4,545,066.41 | |
| US TREASURY N/B 2 | 5,000,000.00 | 5,278,320.30 | |
| US TREASURY N/B 2 | 2,800,000.00 | 2,651,250.00 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 2,500,000.00 | 2,553,417.97 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000.00 | 3,071,953.14 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,133,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,100,000.00 | 3,250,035.16 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 2,000,000.00 | 2,102,968.76 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 6,500,000.00 | 6,840,996.11 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,500,000.00 | 3,695,917.96 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,000,000.00 | 4,227,343.76 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 1,800,000.00 | 1,905,609.38 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 4,900,000.00 | 5,201,082.01 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 900,000.00 | 956,882.81 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,300,000.00 | 4,390,199.20 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,000,000.00 | 3,158,085.93 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,200,000.00 | 2,319,109.38 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,800,000.00 | 4,016,421.89 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 1,500,000.00 | 1,593,046.87 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 6,300,000.00 | 6,694,980.45 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,100,000.00 | 3,297,867.20 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,000,000.00 | 4,273,906.24 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 5,800,000.00 | 6,201,921.89 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,400,000.00 | 4,704,390.63 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,200,000.00 | 4,486,289.05 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,400,000.00 | 4,697,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,850,000.00 | 2,858,126.94 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 3,500,000.00 | 3,502,324.21 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 1,200,000.00 | 1,247,343.75 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 3,700,000.00 | 3,916,507.83 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 2.375 | 5,600,000.00 | 5,963,562.52 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 4,900,000.00 | 5,274,964.85 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 4,900,000.00 | 5,265,011.73 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 1,900,000.00 | 1,953,363.28 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,000,000.00 | 5,261,914.05 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,700,000.00 | 6,072,726.59 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,400,000.00 | 3,651,546.89 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,700,000.00 | 6,158,226.58 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 4,100,000.00 | 4,321,175.77 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 2,900,000.00 | 3,051,796.87 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 3,600,000.00 | 3,788,156.26 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000.00 | 4,182,500.00 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 1,900,000.00 | 2,019,195.32 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 2,300,000.00 | 2,484,449.21 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,400,000.00 | 4,777,609.36 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 2,700,000.00 | 2,933,929.70 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,700,000.00 | 5,138,421.87 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,900,000.00 | 3,049,304.70 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 1,000,000.00 | 1,053,515.63 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,114,218.76 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 3,800,000.00 | 4,024,585.92 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,200,000.00 | 4,467,093.75 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 5,100,000.00 | 5,449,628.91 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,168,203.12 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,600,000.00 | 5,001,242.17 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,100,000.00 | 2,285,062.50 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,800,000.00 | 5,280,375.02 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000.00 | 2,208,437.50 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 300,000.00 | 331,031.25 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 3,800,000.00 | 4,193,210.92 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 1,500,000.00 | 1,655,859.37 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 1,000,000.00 | 1,065,820.31 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,000,000.00 | 2,135,312.50 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,200,000.00 | 2,399,718.75 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 1,100,000.00 | 1,201,449.21 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,500,000.00 | 2,740,234.37 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 5,000,000.00 | 5,546,289.05 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,800,000.00 | 4,218,445.32 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 2,400,000.00 | 2,700,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,700,000.00 | 4,164,667.97 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 3,600,000.00 | 4,058,156.26 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 1,400,000.00 | 1,587,140.63 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000.00 | 4,400,625.00 | |
| US TREASURY N/B 3 | 3,100,000.00 | 3,415,933.58 | |
| US TREASURY N/B 3 | 800,000.00 | 918,750.00 | |
| US TREASURY N/B 3 | 3,500,000.00 | 4,020,351.58 | |
| US TREASURY N/B 3 | 3,000,000.00 | 3,448,359.39 | |
| US TREASURY N/B 3 | 2,700,000.00 | 3,108,269.53 | |
| US TREASURY N/B 3 | 2,500,000.00 | 2,883,593.75 | |
| US TREASURY N/B 3 | 2,200,000.00 | 2,538,851.56 | |
| US TREASURY N/B 3 | 3,100,000.00 | 3,585,585.95 | |
| US TREASURY N/B 3 | 5,400,000.00 | 6,253,875.00 | |
| US TREASURY N/B 3 | 3,800,000.00 | 4,409,632.82 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 4,200,000.00 | 4,742,882.80 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 1,100,000.00 | 1,287,000.00 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 1,000,000.00 | 1,171,406.25 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,300,000.00 | 2,690,820.32 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 3,300,000.00 | 3,869,250.00 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,400,000.00 | 2,840,812.51 | |
| US TREASURY N/B 3.375 | 3,000,000.00 | 3,655,312.50 | |
| US TREASURY N/B 3.375 | 3,100,000.00 | 3,840,125.00 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 800,000.00 | 981,125.00 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 2,400,000.00 | 3,027,937.51 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 3,600,000.00 | 4,551,609.38 | |
| US TREASURY N/B 3.75 | 1,500,000.00 | 1,914,257.82 | |
| US TREASURY N/B 3.75 | 700,000.00 | 900,019.53 | |
| US TREASURY N/B 3.875 | 500,000.00 | 646,406.25 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 1,000,000.00 | 1,343,593.75 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 600,000.00 | 813,140.62 | |
| US TREASURY N/B 4.375 | 500,000.00 | 675,507.81 | |

| | | | | |
|-------|-----------------------|----------------|----------------|------------------|
| | US TREASURY N/B 4.375 | 700,000.00 | 956,703.12 | |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 1,400,000.00 | 1,921,062.50 | |
| | US TREASURY N/B 4.375 | 300,000.00 | 414,210.93 | |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 750,000.00 | 1,010,859.37 | |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 200,000.00 | 274,187.50 | |
| | US TREASURY N/B 4.5 | 1,000,000.00 | 1,385,546.88 | |
| | US TREASURY N/B 4.625 | 600,000.00 | 846,328.12 | |
| | US TREASURY N/B 4.75 | 900,000.00 | 1,297,757.81 | |
| | US TREASURY N/B 5 | 500,000.00 | 715,820.31 | |
| | US TREASURY N/B 5.25 | 500,000.00 | 642,226.56 | |
| | US TREASURY N/B 5.375 | 320,000.00 | 433,250.00 | |
| | US TREASURY N/B 5.5 | 500,000.00 | 647,695.31 | |
| | US TREASURY N/B 6 | 1,000,000.00 | 1,247,109.38 | |
| | US TREASURY N/B 6.125 | 1,000,000.00 | 1,315,234.38 | |
| | US TREASURY N/B 6.25 | 800,000.00 | 911,312.50 | |
| | 米ドル 小計 | 630,570,000.00 | 661,053,049.20 | (71,321,013,478) |
| カナダドル | CANADA-GOV'T 0.5 | 1,700,000.00 | 1,704,199.00 | |
| | CANADA-GOV'T 0.5 | 600,000.00 | 591,624.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1 | 3,000,000.00 | 3,030,420.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1 | 1,300,000.00 | 1,293,045.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.25 | 3,400,000.00 | 3,339,140.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,000,000.00 | 2,049,800.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,030,930.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,900,000.00 | 2,978,590.00 | |
| | CANADA-GOV'T 1.75 | 1,100,000.00 | 1,129,315.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2 | 1,200,000.00 | 1,245,732.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2 | 1,900,000.00 | 2,001,517.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,000,000.00 | 1,050,760.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,400,000.00 | 1,486,786.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.25 | 1,100,000.00 | 1,178,573.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.5 | 2,100,000.00 | 2,229,108.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 1,800,000.00 | 1,850,400.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 1,100,000.00 | 1,266,265.00 | |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 500,000.00 | 594,160.00 | |

| | | | | |
|--------|--------------------|----------------|----------------|-----------------|
| | CANADA-GOV'T 3.5 | 1,300,000.00 | 1,675,986.00 | |
| | CANADA-GOV'T 4 | 1,500,000.00 | 2,017,635.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5 | 1,450,000.00 | 2,093,684.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 250,000.00 | 334,615.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 500,000.00 | 720,020.00 | |
| | カナダドル 小計 | 34,100,000.00 | 36,892,304.00 | (3,193,397,834) |
| メキシコペソ | MEXICAN BONOS 10 | 32,000,000.00 | 36,623,680.00 | |
| | MEXICAN BONOS 5.75 | 20,000,000.00 | 19,913,000.00 | |
| | MEXICAN BONOS 6.5 | 28,000,000.00 | 28,547,596.00 | |
| | MEXICAN BONOS 7.5 | 25,000,000.00 | 26,742,490.00 | |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 1,000,000.00 | 1,073,967.20 | |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 18,000,000.00 | 19,119,654.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8 | 27,000,000.00 | 28,870,020.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8 | 5,000,000.00 | 5,170,500.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 23,000,000.00 | 25,923,900.30 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 40,000,000.00 | 44,067,172.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | 219,000,000.00 | 236,051,979.50 | (1,284,217,189) |
| ユーロ | BELGIAN 0326 4 | 500,000.00 | 716,660.00 | |
| | BELGIAN 0.1 | 700,000.00 | 711,830.00 | |
| | BELGIAN 0.4 | 300,000.00 | 292,128.00 | |
| | BELGIAN 0.8 | 800,000.00 | 845,808.00 | |
| | BELGIAN 0.8 | 1,000,000.00 | 1,073,410.00 | |
| | BELGIAN 0.8 | 1,000,000.00 | 1,078,780.00 | |
| | BELGIAN 0291 5.5 | 1,100,000.00 | 1,551,528.00 | |
| | BELGIAN 0304 5 | 1,400,000.00 | 2,311,148.00 | |
| | BELGIAN 0320 4.25 | 1,200,000.00 | 2,039,868.00 | |
| | BELGIAN 0324 4.5 | 700,000.00 | 875,056.00 | |
| | BELGIAN 0325 4.25 | 1,700,000.00 | 1,820,122.00 | |
| | BELGIAN 0328 2.25 | 1,500,000.00 | 1,595,265.00 | |
| | BELGIAN 0332 2.6 | 2,300,000.00 | 2,536,762.00 | |
| | BELGIAN 0333 3 | 700,000.00 | 954,037.00 | |
| | BELGIAN 0338 0.5 | 1,000,000.00 | 1,038,970.00 | |
| | BELGIAN 0338 2.25 | 500,000.00 | 712,850.00 | |
| | BELGIAN 0344 1.45 | 400,000.00 | 465,464.00 | |

| | | | |
|-------------------|--------------|--------------|--|
| BELGIAN 0347 0.9 | 1,300,000.00 | 1,416,038.00 | |
| BELGIAN 0348 1.7 | 500,000.00 | 616,295.00 | |
| BELGIAN 0353 0.65 | 400,000.00 | 342,260.00 | |
| BELGIAN 1 | 1,400,000.00 | 1,507,786.00 | |
| BELGIAN 1 | 1,000,000.00 | 1,101,470.00 | |
| BELGIAN 1.25 | 400,000.00 | 454,012.00 | |
| BELGIAN 1.6 | 850,000.00 | 1,020,986.00 | |
| BELGIAN 1.9 | 1,000,000.00 | 1,241,160.00 | |
| BELGIAN 2.15 | 500,000.00 | 716,855.00 | |
| BELGIAN 3.75 | 800,000.00 | 1,348,144.00 | |
| BTPS 0.35 | 2,700,000.00 | 2,741,634.00 | |
| BTPS 0.5 | 1,000,000.00 | 1,019,280.00 | |
| BTPS 0.65 | 2,000,000.00 | 2,045,760.00 | |
| BTPS 0.85 | 1,700,000.00 | 1,758,565.00 | |
| BTPS 0.9 | 2,250,000.00 | 2,286,112.50 | |
| BTPS 0.9 | 1,200,000.00 | 1,213,872.00 | |
| BTPS 0.95 | 2,000,000.00 | 2,047,240.00 | |
| BTPS 0.95 | 2,000,000.00 | 2,048,060.00 | |
| BTPS 0.95 | 800,000.00 | 830,376.00 | |
| BTPS 0.95 | 1,800,000.00 | 1,839,402.00 | |
| BTPS 1 | 1,000,000.00 | 1,017,010.00 | |
| BTPS 1.2 | 1,000,000.00 | 1,015,110.00 | |
| BTPS 1.25 | 1,600,000.00 | 1,692,160.00 | |
| BTPS 1.35 | 2,000,000.00 | 2,034,300.00 | |
| BTPS 1.45 | 2,000,000.00 | 2,050,420.00 | |
| BTPS 1.45 | 1,800,000.00 | 1,899,324.00 | |
| BTPS 1.45 | 1,000,000.00 | 1,059,190.00 | |
| BTPS 1.45 | 600,000.00 | 619,428.00 | |
| BTPS 1.5 | 2,700,000.00 | 2,867,751.00 | |
| BTPS 1.6 | 1,200,000.00 | 1,288,956.00 | |
| BTPS 1.65 | 1,200,000.00 | 1,300,452.00 | |
| BTPS 1.65 | 1,800,000.00 | 1,944,234.00 | |
| BTPS 1.7 | 500,000.00 | 487,190.00 | |
| BTPS 1.85 | 1,000,000.00 | 1,061,990.00 | |
| BTPS 1.85 | 1,000,000.00 | 1,076,670.00 | |

| | | | |
|-----------|--------------|--------------|--|
| BTPS 2 | 1,300,000.00 | 1,415,999.00 | |
| BTPS 2 | 1,600,000.00 | 1,770,448.00 | |
| BTPS 2.05 | 1,500,000.00 | 1,660,545.00 | |
| BTPS 2.1 | 1,000,000.00 | 1,100,730.00 | |
| BTPS 2.2 | 2,300,000.00 | 2,565,650.00 | |
| BTPS 2.25 | 1,200,000.00 | 1,369,764.00 | |
| BTPS 2.45 | 1,100,000.00 | 1,280,598.00 | |
| BTPS 2.45 | 900,000.00 | 1,034,694.00 | |
| BTPS 2.5 | 600,000.00 | 655,866.00 | |
| BTPS 2.5 | 2,100,000.00 | 2,333,646.00 | |
| BTPS 2.7 | 1,550,000.00 | 1,867,827.50 | |
| BTPS 2.8 | 300,000.00 | 351,282.00 | |
| BTPS 2.8 | 900,000.00 | 1,076,994.00 | |
| BTPS 2.95 | 1,300,000.00 | 1,617,187.00 | |
| BTPS 3 | 3,500,000.00 | 4,179,315.00 | |
| BTPS 3.1 | 900,000.00 | 1,142,802.00 | |
| BTPS 3.25 | 1,500,000.00 | 1,978,725.00 | |
| BTPS 3.35 | 850,000.00 | 1,088,705.50 | |
| BTPS 3.45 | 1,400,000.00 | 1,915,130.00 | |
| BTPS 3.5 | 4,400,000.00 | 5,475,096.00 | |
| BTPS 3.75 | 1,500,000.00 | 1,694,910.00 | |
| BTPS 3.85 | 900,000.00 | 1,317,807.00 | |
| BTPS 4 | 2,600,000.00 | 3,603,496.00 | |
| BTPS 4.5 | 2,300,000.00 | 2,524,457.00 | |
| BTPS 4.5 | 1,000,000.00 | 1,133,900.00 | |
| BTPS 4.5 | 1,800,000.00 | 2,183,778.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,500,000.00 | 2,788,150.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,000,000.00 | 2,614,220.00 | |
| BTPS 4.75 | 1,600,000.00 | 2,569,472.00 | |
| BTPS 5 | 1,000,000.00 | 1,194,630.00 | |
| BTPS 5 | 2,070,000.00 | 3,064,966.20 | |
| BTPS 5 | 1,800,000.00 | 2,844,918.00 | |
| BTPS 5 | 1,700,000.00 | 2,708,610.00 | |
| BTPS 5.5 | 1,200,000.00 | 1,294,656.00 | |
| BTPS 5.5 | 2,000,000.00 | 2,176,640.00 | |

| | | | |
|----------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 5.75 | 1,700,000.00 | 2,605,046.00 | |
| BTPS 6 | 2,200,000.00 | 3,307,260.00 | |
| BTPS 6.5 | 1,700,000.00 | 2,370,480.00 | |
| BTPS 7.25 | 400,000.00 | 554,744.00 | |
| BTPS 9 | 300,000.00 | 369,936.00 | |
| BUNDESOBL-120 0 | 3,500,000.00 | 3,594,255.00 | |
| BUNDESOBL-176 0 | 2,000,000.00 | 2,020,200.00 | |
| BUNDESOBL-177 0 | 1,900,000.00 | 1,927,132.00 | |
| BUNDESOBL-178 0 | 1,600,000.00 | 1,628,624.00 | |
| BUNDESOBL-179 0 | 1,300,000.00 | 1,327,326.00 | |
| BUNDESOBL-180 0 | 1,100,000.00 | 1,126,752.00 | |
| BUNDESOBL-182 0 | 1,800,000.00 | 1,852,560.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 2,400,000.00 | 2,477,952.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 3,500,000.00 | 3,612,980.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 1,300,000.00 | 1,340,118.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 1,500,000.00 | 1,542,780.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 300,000.00 | 301,251.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0 | 2,300,000.00 | 2,114,873.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 3,800,000.00 | 3,984,072.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 2,900,000.00 | 3,054,628.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.25 | 1,900,000.00 | 2,002,087.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 2,500,000.00 | 2,614,750.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 1,900,000.00 | 2,005,146.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 3,400,000.00 | 3,626,610.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 0.5 | 2,100,000.00 | 2,245,824.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 1,300,000.00 | 1,374,490.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1 | 2,050,000.00 | 2,198,912.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.25 | 1,650,000.00 | 2,086,408.50 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,100,000.00 | 2,184,651.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 1,300,000.00 | 1,359,813.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 2,000,000.00 | 2,136,760.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 2,200,000.00 | 2,264,614.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 2,200,000.00 | 2,354,572.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2 | 2,000,000.00 | 2,126,780.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,200,000.00 | 3,388,110.00 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,500,000.00 | 3,927,450.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 1,200,000.00 | 1,998,060.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 1,800,000.00 | 2,947,410.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 950,000.00 | 1,682,526.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,600,000.00 | 2,217,040.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 2,000,000.00 | 3,312,200.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 1,650,000.00 | 3,141,501.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 5.5 | 900,000.00 | 1,418,634.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 5.625 | 1,000,000.00 | 1,420,720.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,200,000.00 | 1,428,108.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 500,000.00 | 795,340.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.5 | 1,000,000.00 | 1,446,910.00 | |
| FINNISH GOV'T 0 | 400,000.00 | 402,560.00 | |
| FINNISH GOV'T 0.125 | 300,000.00 | 295,434.00 | |
| FINNISH GOV'T 0.25 | 300,000.00 | 293,835.00 | |
| FINNISH GOV'T 0.5 | 400,000.00 | 424,064.00 | |
| FINNISH GOV'T 0.5 | 800,000.00 | 847,528.00 | |
| FINNISH GOV'T 0.75 | 500,000.00 | 541,340.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.125 | 200,000.00 | 225,906.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.375 | 300,000.00 | 370,140.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.5 | 1,000,000.00 | 1,043,470.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.625 | 1,000,000.00 | 1,032,320.00 | |
| FINNISH GOV'T 2 | 600,000.00 | 648,060.00 | |
| FINNISH GOV'T 2.625 | 500,000.00 | 733,670.00 | |
| FINNISH GOV'T 2.75 | 600,000.00 | 735,534.00 | |
| FINNISH GOV'T 4 | 1,000,000.00 | 1,195,430.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,200,000.00 | 2,215,576.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,000,000.00 | 2,025,460.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 4,000,000.00 | 4,073,360.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 1,200,000.00 | 1,226,400.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,100,000.00 | 2,147,838.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 4,500,000.00 | 4,540,140.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0 | 2,900,000.00 | 2,902,610.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.25 | 2,900,000.00 | 3,008,431.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 900,000.00 | 724,653.00 | |

| | | | |
|--------------------|--------------|--------------|--|
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 2,900,000.00 | 3,024,903.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 3,500,000.00 | 3,672,725.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.5 | 2,800,000.00 | 2,949,828.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.75 | 2,500,000.00 | 2,680,825.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.75 | 3,200,000.00 | 3,435,264.00 | |
| FRANCE O.A.T. 0.75 | 1,800,000.00 | 1,756,944.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1 | 2,050,000.00 | 2,193,479.50 | |
| FRANCE O.A.T. 1 | 2,500,000.00 | 2,709,725.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.25 | 2,700,000.00 | 3,052,539.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.25 | 2,400,000.00 | 2,718,216.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.5 | 3,850,000.00 | 4,427,769.50 | |
| FRANCE O.A.T. 1.5 | 2,400,000.00 | 2,842,128.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 4,200,000.00 | 4,411,722.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 2,600,000.00 | 2,820,038.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 2,400,000.00 | 2,948,472.00 | |
| FRANCE O.A.T. 1.75 | 800,000.00 | 1,039,040.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2 | 2,200,000.00 | 2,883,408.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 1,900,000.00 | 1,983,296.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 3,400,000.00 | 3,703,654.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.5 | 3,500,000.00 | 4,324,705.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.75 | 3,850,000.00 | 4,633,013.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3 | 4,000,000.00 | 4,145,560.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 1,700,000.00 | 2,690,777.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 2,500,000.00 | 3,003,775.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 2,000,000.00 | 3,213,880.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,370,000.00 | 2,652,237.80 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 1,400,000.00 | 2,836,834.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,000,000.00 | 4,495,480.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.5 | 2,600,000.00 | 4,579,510.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.75 | 2,200,000.00 | 3,568,400.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.5 | 2,750,000.00 | 4,016,980.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.75 | 2,100,000.00 | 3,466,974.00 | |
| FRANCE O.A.T. 6 | 3,000,000.00 | 3,894,810.00 | |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 600,000.00 | 710,670.00 | |
| IRISH GOVT 0 | 400,000.00 | 403,632.00 | |

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| IRISH GOVT 0.9 | 700,000.00 | 757,064.00 | |
| IRISH GOVT 1 | 1,000,000.00 | 1,073,640.00 | |
| IRISH GOVT 1.1 | 1,600,000.00 | 1,759,360.00 | |
| IRISH GOVT 1.3 | 600,000.00 | 679,944.00 | |
| IRISH GOVT 1.35 | 500,000.00 | 565,905.00 | |
| IRISH GOVT 1.5 | 400,000.00 | 474,660.00 | |
| IRISH GOVT 1.7 | 300,000.00 | 360,849.00 | |
| IRISH GOVT 2 | 1,000,000.00 | 1,303,380.00 | |
| IRISH GOVT 2.4 | 600,000.00 | 733,968.00 | |
| IRISH GOVT 3.4 | 500,000.00 | 558,055.00 | |
| IRISH GOVT 3.9 | 500,000.00 | 543,180.00 | |
| IRISH GOVT 5.4 | 800,000.00 | 986,024.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0 | 1,000,000.00 | 1,019,250.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0 | 1,900,000.00 | 1,936,632.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 1,900,000.00 | 1,970,110.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.25 | 500,000.00 | 522,325.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.5 | 1,700,000.00 | 1,793,143.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.5 | 800,000.00 | 847,112.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.75 | 1,300,000.00 | 1,398,163.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.75 | 1,000,000.00 | 1,082,180.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 1.75 | 1,600,000.00 | 1,688,320.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2 | 1,000,000.00 | 1,087,330.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.25 | 1,500,000.00 | 1,553,910.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 1,000,000.00 | 1,302,960.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.75 | 1,200,000.00 | 1,945,464.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 700,000.00 | 754,243.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 1,300,000.00 | 2,244,034.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,600,000.00 | 2,585,184.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 5.5 | 700,000.00 | 982,576.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0 | 1,100,000.00 | 1,116,225.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0 | 900,000.00 | 910,179.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0.5 | 800,000.00 | 845,536.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0.5 | 550,000.00 | 582,021.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0.75 | 900,000.00 | 961,236.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0.75 | 700,000.00 | 752,640.00 | |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| REP OF AUSTRIA 0.75 | 800,000.00 | 841,056.00 | |
| REP OF AUSTRIA 0.85 | 150,000.00 | 143,887.50 | |
| REP OF AUSTRIA 1.2 | 1,000,000.00 | 1,079,640.00 | |
| REP OF AUSTRIA 1.5 | 200,000.00 | 271,146.00 | |
| REP OF AUSTRIA 1.5 | 700,000.00 | 871,500.00 | |
| REP OF AUSTRIA 1.65 | 1,100,000.00 | 1,188,264.00 | |
| REP OF AUSTRIA 1.75 | 1,000,000.00 | 1,060,300.00 | |
| REP OF AUSTRIA 2.4 | 900,000.00 | 1,167,192.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.15 | 600,000.00 | 966,258.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.4 | 1,100,000.00 | 1,170,873.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.65 | 1,000,000.00 | 1,042,370.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.8 | 700,000.00 | 1,485,792.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.15 | 1,000,000.00 | 1,616,690.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.85 | 500,000.00 | 633,835.00 | |
| REP OF AUSTRIA 6.25 | 1,000,000.00 | 1,420,090.00 | |
| SPANISH GOV'T 0 | 1,000,000.00 | 1,012,950.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.25 | 1,000,000.00 | 1,021,400.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.4 | 2,000,000.00 | 2,018,940.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.45 | 500,000.00 | 507,495.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.5 | 1,000,000.00 | 1,020,410.00 | |
| SPANISH GOV'T 0.8 | 400,000.00 | 421,256.00 | |
| SPANISH GOV'T 1 | 300,000.00 | 276,741.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.2 | 500,000.00 | 514,390.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.25 | 2,000,000.00 | 2,171,360.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.3 | 2,700,000.00 | 2,920,590.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.4 | 1,500,000.00 | 1,643,610.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.4 | 1,600,000.00 | 1,755,984.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.45 | 400,000.00 | 364,408.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.45 | 2,600,000.00 | 2,849,574.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.45 | 2,900,000.00 | 3,198,236.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.5 | 1,200,000.00 | 1,316,100.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.6 | 1,700,000.00 | 1,833,263.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.85 | 2,400,000.00 | 2,763,216.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.95 | 2,600,000.00 | 2,886,130.00 | |
| SPANISH GOV'T 1.95 | 1,700,000.00 | 1,958,230.00 | |

| | | | | |
|-----|--------------------|----------------|------------------------------------|--|
| | SPANISH GOV'T 2.15 | 2,400,000.00 | 2,666,496.00 | |
| | SPANISH GOV'T 2.35 | 1,300,000.00 | 1,572,467.00 | |
| | SPANISH GOV'T 2.7 | 1,550,000.00 | 2,069,234.50 | |
| | SPANISH GOV'T 2.75 | 2,100,000.00 | 2,332,974.00 | |
| | SPANISH GOV'T 2.9 | 1,400,000.00 | 1,921,178.00 | |
| | SPANISH GOV'T 3.45 | 1,100,000.00 | 1,738,143.00 | |
| | SPANISH GOV'T 3.8 | 1,400,000.00 | 1,579,844.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.2 | 1,650,000.00 | 2,484,009.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.4 | 2,000,000.00 | 2,247,900.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.65 | 1,800,000.00 | 2,184,210.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.7 | 1,500,000.00 | 2,509,725.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.8 | 3,000,000.00 | 3,439,020.00 | |
| | SPANISH GOV'T 4.9 | 1,500,000.00 | 2,541,060.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.15 | 1,500,000.00 | 2,068,155.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.15 | 1,200,000.00 | 2,197,428.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.4 | 2,250,000.00 | 2,486,070.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.75 | 1,500,000.00 | 2,371,455.00 | |
| | SPANISH GOV'T 5.9 | 500,000.00 | 661,155.00 | |
| | SPANISH GOV'T 6 | 2,200,000.00 | 3,200,120.00 | |
| | ユーロ 小計 | 429,990,000.00 | 508,948,783.00 (66,443,263,620) | |
| 英債券 | UK TSY GILT 0.125 | 700,000.00 | 701,176.00 | |
| | UK TSY GILT 0.125 | 1,500,000.00 | 1,487,265.00 | |
| | UK TSY GILT 0.375 | 1,000,000.00 | 963,370.00 | |
| | UK TSY GILT 0.5 | 1,800,000.00 | 1,811,124.00 | |
| | UK TSY GILT 0.625 | 1,700,000.00 | 1,729,155.00 | |
| | UK TSY GILT 0.625 | 500,000.00 | 468,900.00 | |
| | UK TSY GILT 0.75 | 2,650,000.00 | 2,692,373.50 | |
| | UK TSY GILT 0.875 | 1,000,000.00 | 1,015,880.00 | |
| | UK TSY GILT 1 | 1,600,000.00 | 1,642,720.00 | |
| | UK TSY GILT 1.25 | 1,200,000.00 | 1,259,088.00 | |
| | UK TSY GILT 1.25 | 700,000.00 | 702,338.00 | |
| | UK TSY GILT 1.5 | 1,000,000.00 | 1,060,720.00 | |
| | UK TSY GILT 1.5 | 1,700,000.00 | 1,786,598.00 | |
| | UK TSY GILT 1.625 | 550,000.00 | 666,363.50 | |

| | | | |
|------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------|
| | UK TSY GILT 1.625 | 1,900,000.00 | 2,048,523.00 |
| | UK TSY GILT 1.625 | 500,000.00 | 551,140.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 1,200,000.00 | 1,228,512.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 1,900,000.00 | 2,073,090.00 |
| | UK TSY GILT 1.75 | 750,000.00 | 834,360.00 |
| | UK TSY GILT 2 | 1,100,000.00 | 1,185,052.00 |
| | UK TSY GILT 2.25 | 2,700,000.00 | 2,841,075.00 |
| | UK TSY GILT 2.5 | 1,600,000.00 | 2,343,760.00 |
| | UK TSY GILT 2.75 | 1,300,000.00 | 1,414,257.00 |
| | UK TSY GILT 3.25 | 1,600,000.00 | 2,233,216.00 |
| | UK TSY GILT 3.5 | 1,650,000.00 | 2,411,227.50 |
| | UK TSY GILT 3.5 | 1,450,000.00 | 2,702,669.50 |
| | UK TSY GILT 3.75 | 1,200,000.00 | 1,975,656.00 |
| | UK TSY GILT 4 | 1,700,000.00 | 3,192,362.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,100,000.00 | 1,371,205.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 900,000.00 | 1,221,381.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,050,000.00 | 1,510,824.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,450,000.00 | 2,195,314.50 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,300,000.00 | 1,998,074.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,500,000.00 | 2,478,450.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 900,000.00 | 1,546,722.00 |
| | UK TSY GILT 4.25 | 1,700,000.00 | 3,157,274.00 |
| | UK TSY GILT 4.5 | 1,100,000.00 | 1,583,560.00 |
| | UK TSY GILT 4.5 | 1,350,000.00 | 2,189,605.50 |
| | UK TSY GILT 4.75 | 1,150,000.00 | 1,576,960.50 |
| | UK TSY GILT 4.75 | 1,200,000.00 | 1,897,836.00 |
| | UK TSY GILT 5 | 1,300,000.00 | 1,541,410.00 |
| | UK TSY GILT 6 | 650,000.00 | 911,410.50 |
| | 英債券 小計 | 54,800,000.00 | 70,201,998.00 (10,515,557,280) |
| スウェーデンクローナ | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 4,000,000.00 | 4,174,000.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 0.75 | 6,000,000.00 | 6,248,040.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 1 | 6,400,000.00 | 6,761,600.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 7,000,000.00 | 7,320,530.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 2.5 | 5,000,000.00 | 5,542,950.00 |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 8,000,000.00 | 8,337,440.00 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | SWEDISH GOVRMNT 3.5 | 4,600,000.00 | 6,757,768.00 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 41,000,000.00 | 45,142,328.00 | (580,981,761) |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOV'T 1.375 | 2,000,000.00 | 2,004,860.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.5 | 3,500,000.00 | 3,591,385.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 3,000,000.00 | 3,107,130.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 1.75 | 2,700,000.00 | 2,800,602.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 2 | 6,000,000.00 | 6,190,980.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 2 | 9,000,000.00 | 9,501,660.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 3 | 4,000,000.00 | 4,269,240.00 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 30,200,000.00 | 31,465,857.00 | (409,685,458) |
| デンマーククローネ | DENMARK - BULLET 0.25 | 1,300,000.00 | 1,219,920.00 | |
| | DENMARK - BULLET 0.5 | 11,100,000.00 | 11,669,430.00 | |
| | DENMARK - BULLET 0.5 | 4,000,000.00 | 4,216,000.00 | |
| | DENMARK - BULLET 1.5 | 5,000,000.00 | 5,255,000.00 | |
| | DENMARK - BULLET 1.75 | 6,000,000.00 | 6,600,000.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4.5 | 10,500,000.00 | 18,625,950.00 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 37,900,000.00 | 47,586,300.00 | (835,615,428) |
| ポーランドズロチ | POLAND GOVT BOND | 6,000,000.00 | 6,000,539.70 | |
| | POLAND GOVT BOND 1.25 | 1,800,000.00 | 1,752,012.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 4,900,000.00 | 5,105,212.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 1,000,000.00 | 1,065,760.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 3,000,000.00 | 3,257,130.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.5 | 3,000,000.00 | 3,269,310.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 2.75 | 5,900,000.00 | 6,523,217.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 3.25 | 6,900,000.00 | 7,654,032.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 2,400,000.00 | 2,594,040.00 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 34,900,000.00 | 37,221,252.70 | (1,067,334,309) |
| オーストラリアドル | AUSTRALIAN GOVT. 0.25 | 900,000.00 | 884,431.80 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 1.5 | 3,300,000.00 | 3,241,590.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 1.75 | 600,000.00 | 488,196.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 1,500,000.00 | 1,550,970.00 | |

| | | | | |
|------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.25 | 3,000,000.00 | 3,210,600.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.5 | 1,350,000.00 | 1,459,215.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 2,500,000.00 | 2,698,242.50 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,600,000.00 | 1,767,040.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,800,000.00 | 1,991,779.20 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 3,300,000.00 | 3,640,890.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 800,000.00 | 868,480.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3 | 1,400,000.00 | 1,511,832.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 1,900,000.00 | 2,106,340.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 2,100,000.00 | 2,401,140.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.25 | 2,550,000.00 | 2,890,425.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 3.75 | 1,200,000.00 | 1,456,044.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 2,650,000.00 | 3,108,450.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 1,400,000.00 | 1,803,760.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 1,600,000.00 | 1,952,800.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 1,400,000.00 | 1,550,066.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 1,500,000.00 | 1,603,800.00 | |
| | オーストラリアドル 小計 | 38,350,000.00 | 42,186,091.50 (3,530,553,997) | |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOV'T 2.25 | 1,000,000.00 | 1,042,470.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.625 | 400,000.00 | 435,400.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 1,200,000.00 | 1,259,160.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 400,000.00 | 454,000.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.75 | 700,000.00 | 801,500.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.875 | 400,000.00 | 445,308.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3 | 700,000.00 | 755,720.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.125 | 800,000.00 | 829,590.64 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.375 | 650,000.00 | 762,775.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.5 | 1,500,000.00 | 1,701,600.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 7,750,000.00 | 8,487,523.64 (690,629,798) | |
| マレーシアリングット | MALAYSIA GOVT 3.418 | 7,000,000.00 | 7,132,183.10 | |
| | MALAYSIA GOVT 3.502 | 7,900,000.00 | 8,199,562.47 | |
| | MALAYSIA GOVT 3.955 | 5,300,000.00 | 5,602,500.15 | |
| | MALAYSIA GOVT 4.498 | 5,000,000.00 | 5,502,402.50 | |
| | MALAYSIA GOVT 4.736 | 4,500,000.00 | 4,776,418.35 | |

| | | | |
|---------------|-------------------|---------------|--------------------------------------|
| マレーシアリングット 小計 | | 29,700,000.00 | 31,213,066.57 (820,579,034) |
| イスラエルシュケル | ISRAEL FIXED 0.75 | 6,200,000.00 | 6,254,994.00 |
| | ISRAEL FIXED 1.5 | 2,900,000.00 | 2,997,875.00 |
| | ISRAEL FIXED 2.25 | 1,500,000.00 | 1,658,355.00 |
| | ISRAEL FIXED 3.75 | 3,700,000.00 | 4,881,114.00 |
| | ISRAEL FIXED 6.25 | 5,000,000.00 | 6,558,600.00 |
| イスラエルシュケル 小計 | | 19,300,000.00 | 22,350,938.00 (741,814,221) |
| 合計 | | | 161,434,643,407 (161,434,643,407) |

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|------------|----------|------------|
| 米ドル | 国債証券 205銘柄 | 43.8% | 44.2% |
| カナダドル | 国債証券 23銘柄 | 2.0% | 2.0% |
| メキシコペソ | 国債証券 10銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券 281銘柄 | 40.8% | 41.2% |
| 英ポンド | 国債証券 42銘柄 | 6.5% | 6.5% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 7銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 7銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| デンマーククローネ | 国債証券 6銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 9銘柄 | 0.7% | 0.7% |
| オーストラリアドル | 国債証券 21銘柄 | 2.2% | 2.2% |
| シンガポールドル | 国債証券 10銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| マレーシアリングット | 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% |

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。

マネープール・マザーファンド

貸借対照表

| | (2020年 4月27日現在) | (2021年 4月26日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 114,743,936,896 | 9,358,922,331 |
| コール・ローン | 117,633,174,472 | 21,476,434,249 |
| 国債証券 | - | 140,573,607,440 |
| 地方債証券 | 83,974,427,179 | 25,118,583,522 |
| 特殊債券 | 31,428,756,697 | 8,240,812,665 |
| 現先取引勘定 | - | 150,039,000,000 |
| 未収利息 | 76,708,748 | 70,318,149 |
| 前払費用 | 9,767,609 | 2,907,787 |
| 流動資産合計 | 347,866,771,601 | 354,880,586,143 |
| 資産合計 | 347,866,771,601 | 354,880,586,143 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 3,399,391,680 | - |
| 未払解約金 | 9,000,000,000 | - |
| 未払利息 | 339,331 | 62,163 |
| その他未払費用 | 12,756,053 | 1,644,919 |
| 流動負債合計 | 12,412,487,064 | 1,707,082 |
| 負債合計 | 12,412,487,064 | 1,707,082 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 334,872,062,439 | 354,525,983,575 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 582,222,098 | 352,895,486 |
| 元本等合計 | 335,454,284,537 | 354,878,879,061 |
| 純資産合計 | 335,454,284,537 | 354,878,879,061 |
| 負債純資産合計 | 347,866,771,601 | 354,880,586,143 |

注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （2020年 4月27日現在） | （2021年 4月26日現在） |
|-----------------------|--|--|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 334,872,062,439口 | 354,525,983,575口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0017円 (10,000口当たりの純資産額 10,017円) | 1口当たり純資産額 1.0010円 (10,000口当たりの純資産額 10,010円) |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
|------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年 4月26日現在) |
|-------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

| |
|--|
| 自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日 |
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。 |

(その他の注記)

| (2020年 4月27日現在) | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 402,242,829,873円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 32,441,585,746円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 99,812,353,180円 |
| 2020年 4月27日現在における元本の内訳 | |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル) | 144,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド) | 3,474,833円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(中国元) | 12,046,048円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル) | 50,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(円) | 11,000,000円 |
| 三井住友・公益債券投信(毎月決算型) | 8,874,310円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型) | 4,305,812円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |
| 北米エネルギーファンド(毎月決算型) | 9,964,130円 |
| 北米エネルギーファンド(年2回決算型) | 996,413円 |
| 三井住友・公益債券投信(資産成長型) | 941,890円 |
| 日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド | 9,958,176円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 毎月分配型(為替ヘッジなし) | 39,857円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 毎月分配型(為替ヘッジあり) | 239,199円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 資産成長型(為替ヘッジなし) | 39,857円 |
| アッシュモア新興国短期社債ファンド 資産成長型(為替ヘッジあり) | 229,232円 |
| B N P バリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) | 1,485,087円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジあり) | 279,064円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジなし) | 1,275,775円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジあり) | 1,953,537円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジなし) | 2,960,215円 |
| 三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| 三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |
| S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 3 < 適格機関投資家限定 > | 334,605,745,855円 |
| 合計 | 334,872,062,439円 |

| (2021年 4月26日現在) | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 334,872,062,439円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 32,847,424,987円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 13,193,503,851円 |
| 2021年 4月26日現在における元本の内訳 | |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド (ブラジルリアル) | 144,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド (南アランド) | 3,474,833円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド (中国元) | 12,046,048円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド (豪ドル) | 50,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド (円) | 11,000,000円 |
| 三井住友・公益債券投信 (毎月決算型) | 8,874,310円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジ型) | 4,305,812円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド (為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |
| 三井住友・公益債券投信 (資産成長型) | 941,890円 |
| 日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド | 9,958,176円 |
| B N P パリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり) | 1,485,087円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド (為替ヘッジあり) | 279,064円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド (為替ヘッジなし) | 1,275,775円 |
| 米国優先リートファンド (為替ヘッジあり) | 1,953,537円 |
| 米国優先リートファンド (為替ヘッジなし) | 2,960,215円 |
| 三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| 三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |
| S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 3 < 適格機関投資家限定 > | 354,271,175,679円 |
| 合計 | 354,525,983,575円 |

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|------|-----|----|
|----|----|------|-----|----|

| | | | | |
|-----------------------|-----------------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 国債証券 | 第969回国庫短期証券 | 2,120,000,000 | 2,120,074,200 | |
| | 第970回国庫短期証券 | 13,020,000,000 | 13,020,716,100 | |
| | 第972回国庫短期証券 | 12,580,000,000 | 12,580,930,920 | |
| | 第974回国庫短期証券 | 1,820,000,000 | 1,820,171,080 | |
| | 第976回国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 10,001,160,000 | |
| | 第977回国庫短期証券 | 18,560,000,000 | 18,562,524,160 | |
| | 第979回国庫短期証券 | 10,640,000,000 | 10,641,659,840 | |
| | 第981回国庫短期証券 | 5,030,000,000 | 5,030,885,280 | |
| | 第983回国庫短期証券 | 20,000,000,000 | 20,004,040,000 | |
| | 第984回国庫短期証券 | 20,000,000,000 | 20,004,440,000 | |
| | 第986回国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 10,002,430,000 | |
| | 第987回国庫短期証券 | 10,000,000,000 | 10,002,630,000 | |
| | 第990回国庫短期証券 | 6,780,000,000 | 6,781,945,860 | |
| | 国債証券合計 | | 140,550,000,000 | 140,573,607,440 |
| 地方債証券 | 第7回東京都公募公債(7年) | 100,000,000 | 100,208,000 | |
| | 第696回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,171,000 | |
| | 第697回東京都公募公債 | 750,000,000 | 751,192,500 | |
| | 第698回東京都公募公債 | 300,000,000 | 300,450,000 | |
| | 第699回東京都公募公債 | 1,200,000,000 | 1,204,752,000 | |
| | 第701回東京都公募公債 | 1,700,000,000 | 1,706,545,000 | |
| | 第702回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,668,000 | |
| | 第703回東京都公募公債 | 1,100,000,000 | 1,106,996,000 | |
| | 第704回東京都公募公債 | 900,000,000 | 905,607,000 | |
| | 第705回東京都公募公債 | 170,000,000 | 171,586,100 | |
| | 第706回東京都公募公債 | 200,000,000 | 201,688,000 | |
| | 第707回東京都公募公債 | 500,000,000 | 503,815,000 | |
| | 第12回1号宮城県公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,996,000 | |
| | 平成23年度第3回静岡県公募公債 | 103,290,000 | 103,387,092 | |
| | 平成23年度第5回静岡県公募公債 | 200,000,000 | 200,396,000 | |
| | 平成23年度第6回静岡県公募公債 | 170,000,000 | 170,486,200 | |
| | 平成23年度第9回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,601,000 | |
| | 平成24年度第1回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,038,000 | |
| | 平成23年度第3回愛知県公募公債(10年) | 250,000,000 | 250,255,000 | |
| | 平成23年度第4回愛知県公募公債(10年) | 1,900,000,000 | 1,903,819,000 | |
| 平成23年度第7回愛知県公募公債(10年) | 600,000,000 | 601,692,000 | | |
| 平成23年度第9回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 200,864,000 | | |

| | | | |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| 平成23年度第11回愛知県公募公債(10年) | 1,000,000,000 | 1,005,140,000 | |
| 平成23年度第17回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 201,504,000 | |
| 平成29年度第3回愛知県公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,998,000 | |
| 平成23年度第1回広島県公募公債 | 385,630,000 | 386,015,630 | |
| 平成23年度第3回広島県公募公債 | 400,000,000 | 401,832,000 | |
| 平成23年度第2回埼玉県公募公債 | 400,000,000 | 400,376,000 | |
| 平成23年度第4回埼玉県公募公債 | 700,000,000 | 702,093,000 | |
| 平成23年度第6回埼玉県公募公債 | 400,000,000 | 402,024,000 | |
| 平成23年度第9回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,737,000 | |
| 平成23年度第10回埼玉県公募公債 | 300,000,000 | 302,436,000 | |
| 平成24年度第1回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,037,000 | |
| 平成28年度第7回埼玉県公募公債(5年) | 700,000,000 | 699,951,000 | |
| 平成23年度第5回福岡県公募公債 | 1,100,000,000 | 1,105,511,000 | |
| 平成23年度第8回福岡県公募公債 | 1,000,000,000 | 1,006,740,000 | |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債 | 300,000,000 | 300,603,000 | |
| 平成28年度第2回福岡県公募公債 | 900,000,000 | 899,964,000 | |
| 平成28年度第7回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,003,000 | |
| 平成23年度第4回大阪市公募公債 | 450,000,000 | 451,246,500 | |
| 平成23年度第6回大阪市公募公債 | 350,000,000 | 351,449,000 | |
| 平成28年度第5回大阪市公募公債(5年) | 300,000,000 | 299,973,000 | |
| 平成29年度第1回大阪市公募公債(5年) | 200,000,000 | 199,996,000 | |
| 第23回名古屋市公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,998,000 | |
| 第476回名古屋市公募公債(10年) | 200,000,000 | 200,800,000 | |
| 第477回名古屋市公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,665,000 | |
| 第478回名古屋市公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,936,000 | |
| 平成23年度第4回京都市公募公債 | 450,000,000 | 453,114,000 | |
| 平成28年度第1回京都市公募公債 | 300,000,000 | 299,988,000 | |
| 平成28年度第3回京都市公募公債 | 100,000,000 | 99,994,000 | |
| 平成23年度第1回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 200,180,000 | |
| 平成23年度第2回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 200,520,000 | |
| 平成23年度第4回横浜市公募公債 | 450,000,000 | 452,542,500 | |
| 平成23年度第5回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 302,268,000 | |
| 第45回横浜市公募公債(5年) | 400,000,000 | 399,964,000 | |
| 第46回横浜市公募公債(5年) | 1,400,000,000 | 1,399,958,000 | |
| 平成23年度第3回福井県公募公債 | 100,000,000 | 101,014,000 | |

| | | | | |
|------------------|----------------------------|----------------|-----------------|--|
| | 平成23年度第1回岡山県公募公債（10年） | 300,000,000 | 301,800,000 | |
| 地方債証券合計 | | 25,028,920,000 | 25,118,583,522 | |
| 特殊債券 | 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 588,600,000 | 588,676,518 | |
| | 第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 536,500,000 | 537,063,325 | |
| | 第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 943,000,000 | 945,018,020 | |
| | 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 197,000,000 | 197,567,360 | |
| | 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 206,000,000 | 207,058,840 | |
| | 第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 315,000,000 | 316,899,450 | |
| | 第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 409,600,000 | 412,659,712 | |
| | 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 711,000,000 | 715,955,670 | |
| | 第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2,967,000,000 | 2,989,756,890 | |
| | 第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 424,000,000 | 427,442,880 | |
| | 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年） | 100,000,000 | 100,339,000 | |
| | 第26回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 400,000,000 | 400,984,000 | |
| | 第29回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,483,000 | |
| | 第34回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,802,000 | |
| 第211回政府保証預金保険機構債 | 200,000,000 | 200,106,000 | | |
| 特殊債券合計 | | 8,197,700,000 | 8,240,812,665 | |
| 合計 | | | 173,933,003,627 | |

（注）上記以外に現先取引勘定に含まれる国債証券150,039,000,000円があります。

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3期中間計算期間(2021年 4月27日から2021年10月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第2期 (2021年 4月26日現在) | 第3期中間計算期間 (2021年10月26日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 32,087 | 77,090 |
| 金銭信託 | 178,733 | 25,449 |
| コール・ローン | 410,147 | 753,749 |
| 投資証券 | 2,163,992 | 2,744,418 |
| 親投資信託受益証券 | 40,186,403 | 49,825,802 |
| 流動資産合計 | 42,971,362 | 53,426,508 |
| 資産合計 | | |
| 42,971,362 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 6,146 | 7,926 |
| 未払委託者報酬 | 67,443 | 87,245 |
| 未払利息 | 1 | - |
| その他未払費用 | 1,169 | 1,524 |
| 流動負債合計 | 74,759 | 96,695 |
| 負債合計 | | |
| 74,759 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 38,314,969 | 44,859,528 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 4,581,634 | 8,470,285 |
| (分配準備積立金) | 4,398,102 | 4,183,247 |
| 元本等合計 | 42,896,603 | 53,329,813 |
| 純資産合計 | | |
| 42,896,603 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 42,971,362 | | |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第2期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日 | 第3期中間計算期間 自 2021年 4月27日 至 2021年10月26日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 25,225 | 43,239 |
| 有価証券売買等損益 | 3,057,060 | 2,801,461 |
| 為替差損益 | 36,981 | 138,680 |
| 営業収益合計 | 3,045,304 | 2,983,380 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 19 | 170 |
| 受託者報酬 | 4,802 | 7,926 |
| 委託者報酬 | 52,771 | 87,245 |
| その他費用 | 960 | 4,119 |
| 営業費用合計 | 58,552 | 99,460 |
| 営業利益又は営業損失() | 2,986,752 | 2,883,920 |
| 経常利益又は経常損失() | 2,986,752 | 2,883,920 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 2,986,752 | 2,883,920 |
| 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() | - | 77,482 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 4,341,955 | 4,581,634 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 1,341,813 |
| 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 | - | 1,341,813 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 131,204 | 259,600 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 259,600 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 131,204 | - |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 1,486,407 | 8,470,285 |

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第3期中間計算期間 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第2期 (2021年4月26日現在) | 第3期中間計算期間 (2021年10月26日現在) |
|-------------------------|---|---|
| 1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数 | 38,314,969口 | 44,859,528口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.1196円 (1万口当たりの純資産額11,196円) | 1口当たり純資産額 1.1888円 (1万口当たりの純資産額11,888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3期中間計算期間 (2021年10月26日現在) |
|----|------------------------------|
| | |

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

(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2期 (2021年4月26日現在) | 第3期中間計算期間 (2021年10月26日現在) |
|-----------|-----------------------|------------------------------|
| 期首元本額 | 30,000,000円 | 38,314,969円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,314,969円 | 8,659,297円 |
| 期中一部解約元本額 | -円 | 2,114,738円 |

(参考)

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「マネープール・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 727,633,001 | 134,939,988 |
| コール・ローン | 1,668,590,743 | 3,996,668,559 |
| 株式 | 187,837,731,440 | 196,719,417,670 |
| 派生商品評価勘定 | 1,611,200 | 44,111,800 |
| 未収配当金 | 1,741,114,046 | 1,626,909,221 |
| 前払金 | 83,065,000 | 81,564,000 |
| 差入委託証拠金 | 13,270,000 | 228,165,000 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 流動資産合計 | 192,073,015,430 | 202,831,776,238 |
| 資産合計 | 192,073,015,430 | 202,831,776,238 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 84,886,300 | 53,725,500 |
| 未払解約金 | 497,729,231 | 198,076,515 |
| 未払利息 | 4,829 | - |
| その他未払費用 | 57,245 | 6,993 |
| 流動負債合計 | 582,677,605 | 251,809,008 |
| 負債合計 | 582,677,605 | 251,809,008 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 60,391,040,010 | 60,086,340,961 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 131,099,297,815 | 142,493,626,269 |
| 元本等合計 | 191,490,337,825 | 202,579,967,230 |
| 純資産合計 | 191,490,337,825 | 202,579,967,230 |
| 負債純資産合計 | 192,073,015,430 | 202,831,776,238 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引 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。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|---------------------------|---|---|
| 1. 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 3,306,000,000円 | |
| 2. 当計算期間の末日にお ける受益権の総数 | 60,391,040,010口 | 60,086,340,961口 |
| 3. 1単位あたり純資産の 額 | 1口あたり純資産額 3.1708円 (1万口当たりの純資産額31,708円) | 1口あたり純資産額 3.3715円 (1万口当たりの純資産額33,715円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時 価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借 対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券(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26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | 東証株価指数先 物 | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |
| | 小計 | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |
| 合計 | | 3,747,610,100 | - | 3,664,335,000 | 83,275,100 |

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|----|----|------|-----------|----|------|
| | | | うち 1年超 | | |

| | | | | | |
|------|--------------------|---------------|---|---------------|-----------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | TOPIX 先物 0312 月 | 5,850,303,700 | - | 5,840,690,000 | 9,613,700 |
| | 小計 | 5,850,303,700 | - | 5,840,690,000 | 9,613,700 |
| 合 計 | | 5,850,303,700 | - | 5,840,690,000 | 9,613,700 |

(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おります。

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26日現在) | |
|----------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 66,420,614,464円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,321,155,755円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,350,730,209円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,377,992,498円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 882,687,081円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,279,019,277円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,170,940,243円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 121,064,129円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 4,744,492円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 20,265,196円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 59,910,031円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 126,034,866円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 99,406,160円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 198,180,525円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 1,201,230,099円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド | 16,039,342,551円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,754,988円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 464,864,383円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 302,064,707円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 48,431,067円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 23,321,027円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 134,683,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 112,157,344円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 371,384,457円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 185,233,234円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 216,782,444円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 24,448,491円 |

| | |
|--|-----------------|
| 三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド | 223,855,528円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 11,130,956円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 50,852,277円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 47,513,827円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 3,257,418円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 3,065,048,127円 |
| バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 > | 18,087,538円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 > | 129,489,749円 |
| SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 > | 2,117,958,002円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 > | 1,802,540,670円 |
| SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 > | 6,769,935,339円 |
| SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 > | 42,846,949円 |
| SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 > | 175,681,640円 |
| SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 > | 800,989,888円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 > | 49,447,751円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 > | 279,517,682円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 > | 888,393,536円 |
| SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 > | 684,285,651円 |
| SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 > | 2,094,565,514円 |
| SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 > | 373,938円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 > | 45,653,025円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 > | 54,101,733円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 > | 35,991,493円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 > | 17,007,263円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 > | 132,156,315円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 > | 271,614,480円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 > | 72,269,436円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 > | 43,489,672円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 > | 7,479,610円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 > | 50,100,640円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 > | 670,876,217円 |
| SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用) | 175,567,216円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 > | 280,176,797円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 > | 127,955,140円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 > | 692,837,428円 |
| SMAM・世界バランスファンド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 < 適格機関投資家限定 > | 382,523,535円 |
| 合計 | 60,391,040,010円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|-------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 60,391,040,010円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 5,102,959,165円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 5,407,658,214円 |

2021年10月26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 | 9,410,967,534円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 887,281,842円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 4,261,145,683円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 3,230,328,474円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 122,716,629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) | 20,294,826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) | 140,321,069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) | 215,364,926円 |
| 国内株式指数ファンド(TOPIX) | 1,349,113,853円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド | 17,819,417,220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) | 245,881,102円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 161,501,917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) | 464,107,361円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 246,091,068円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 278,193,880円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 31,785,016円 |
| 三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド | 412,789,731円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 14,139,633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) | 67,312,759円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 3,948,544円 |
| 日興FWS・日本株インデックス | 89,598,188円 |
| 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド | 3,121,974円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 2,862,570,510円 |
| バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定> | 15,238,174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> | 1,882,666,073円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用> | 1,646,490,072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> | 739,472,782円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定> | 46,344,355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> | 856,981,897円 |
| SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用> | 603,443,066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> | 368,975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> | 34,163,089円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 16,669,461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> | 7,375,595円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 45,592,595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) | 176,816,377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> | 290,900,811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2016-04<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<適格機関投資家限定> | 94,429,189円 |
| 合計 | 60,086,340,961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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,942,451,000 | 5,916,612,402 |
| 金銭信託 | 302,937,580 | 18,908,245 |
| コール・ローン | 695,167,542 | 560,026,640 |
| 株式 | 283,850,458,884 | 330,067,414,981 |
| 投資証券 | 6,801,473,940 | 8,095,845,576 |
| 派生商品評価勘定 | 59,535,179 | 240,622,684 |
| 未収入金 | 45,617,843 | - |
| 未収配当金 | 309,276,064 | 206,890,513 |
| 差入委託証拠金 | 1,650,022,983 | 2,642,385,343 |
| 流動資産合計 | 295,656,941,015 | 347,748,706,384 |
| 資産合計 | 295,656,941,015 | 347,748,706,384 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 372,922 | 120,655 |
| 前受金 | 59,485,972 | - |
| 未払解約金 | 1,041,495,833 | 556,120,082 |
| 未払利息 | 2,012 | - |
| その他未払費用 | 20,043 | 1,703 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 流動負債合計 | 1,101,376,782 | 556,242,440 |
| 負債合計 | 1,101,376,782 | 556,242,440 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 57,943,987,779 | 59,601,096,574 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 236,611,576,454 | 287,591,367,370 |
| 元本等合計 | 294,555,564,233 | 347,192,463,944 |
| 純資産合計 | 294,555,564,233 | 347,192,463,944 |
| 負債純資産合計 | 295,656,941,015 | 347,748,706,384 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 57,943,987,779口 | 59,601,096,574口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 5.0835円 (1万口当たりの純資産額50,835円) | 1口当たり純資産額 5.8253円 (1万口当たりの純資産額58,253円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券(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26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | SPMINI 2106 | 2,876,715,575 | - | 2,925,410,378 | 48,694,803 |
| | SPI200 2106 | 145,020,124 | - | 146,917,795 | 1,897,671 |
| | FTSE 2106 | 174,694,085 | - | 175,703,670 | 1,009,585 |
| | DJ EUR 2106 | 618,765,224 | - | 626,649,139 | 7,883,915 |
| | 小計 | 3,815,195,008 | - | 3,874,680,982 | 59,485,974 |
| | 合計 | 3,815,195,008 | - | 3,874,680,982 | 59,485,974 |

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|----|--------------|-------------|-----------|-------------|--------|
| | | | うち 1年超 | | |
| | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 169,433,700 | - | 169,385,320 | 48,380 |
| | イギリス・ポンド | 8,965,740 | - | 8,987,382 | 21,642 |

| | | | | | |
|-----------|-------------|-------------|---|-------------|---------|
| 市場取引以外の取引 | イスラエル・シユケル | 330,160 | - | 331,894 | 1,734 |
| | オーストラリア・ドル | 4,159,600 | - | 4,184,500 | 24,900 |
| | カナダ・ドル | 15,563,400 | - | 15,580,614 | 17,214 |
| | シンガポール・ドル | 811,440 | - | 813,690 | 2,250 |
| | スイス・フラン | 11,771,100 | - | 11,813,200 | 42,100 |
| | スウェーデン・クローナ | 2,690,100 | - | 2,702,700 | 12,600 |
| | デンマーク・クローネ | 1,046,580 | - | 1,053,600 | 7,020 |
| | ニュージーランド・ドル | 772,557 | - | 776,893 | 4,336 |
| | ノルウェー・クローネ | 387,150 | - | 390,600 | 3,450 |
| | ユーロ | 50,680,070 | - | 50,915,339 | 235,269 |
| | 香港・ドル | 834,420 | - | 834,000 | 420 |
| | 小計 | 267,446,017 | - | 267,769,732 | 323,715 |
| | 合計 | 267,446,017 | - | 267,769,732 | 323,715 |

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | S&P 500 EMINI FUT DEC21 | 6,378,169,230 | - | 6,589,231,678 | 211,062,448 |
| | SPI 200 FUTURES DEC21 | 313,312,104 | - | 316,707,840 | 3,395,736 |
| | FTSE 100 IDX FUT DEC21 | 375,030,506 | - | 383,698,639 | 8,668,133 |
| | EURO STOXX 50 DEC21 | 1,303,247,668 | - | 1,320,626,108 | 17,378,440 |
| | 小計 | 8,369,759,508 | - | 8,610,264,265 | 240,504,757 |
| | 合計 | 8,369,759,508 | - | 8,610,264,265 | 240,504,757 |

(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おります。

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。

| 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 | | | | |
| | イギリス・ポンド | 1,566,014 | - | 1,566,181 | 167 |
| | イスラエル・シケル | 353,916 | - | 355,651 | 1,735 |
| | デンマーク・クローネ | 712,140 | - | 710,024 | 2,116 |
| | ノルウェー・クローネ | 136,139 | - | 136,294 | 155 |
| | 小計 | 2,768,209 | - | 2,768,150 | 59 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 341,425,923 | - | 341,486,100 | 60,177 |
| | カナダ・ドル | 15,625,720 | - | 15,626,179 | 459 |
| | オーストラリア・ドル | 11,086,032 | - | 11,091,600 | 5,568 |
| | 香港・ドル | 4,392,058 | - | 4,392,000 | 58 |
| | シンガポール・ドル | 1,690,000 | - | 1,690,148 | 148 |
| | ニュージーランド・ドル | 815,590 | - | 815,668 | 78 |
| | イギリス・ポンド | 26,625,060 | - | 26,625,077 | 17 |
| | イスラエル・シケル | 1,421,600 | - | 1,422,604 | 1,004 |
| | スイス・フラン | 18,572,350 | - | 18,548,085 | 24,265 |
| | デンマーク・クローネ | 3,373,070 | - | 3,372,614 | 456 |
| | ノルウェー・クローネ | 1,090,320 | - | 1,090,352 | 32 |
| | スウェーデン・クローナ | 5,026,209 | - | 5,027,400 | 1,191 |
| | ユーロ | 66,068,176 | - | 66,026,950 | 41,226 |
| | 小計 | 497,212,108 | - | 497,214,777 | 2,669 |
| | 合計 | 499,980,317 | - | 499,982,927 | 2,728 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|--------------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 58,066,751,593円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 16,895,224,068円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 17,017,987,882円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 28,763,062,087円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 278,659,320円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,185,860,476円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 826,468,614円 |
| S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 68,282,666円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 1,307,216円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 6,153,493円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 17,918,101円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 44,256,436円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 43,724,486円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 93,759,250円 |
| 外国株式指数ファンド | 597,608,127円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド | 9,332,591,971円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 226,710,914円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 247,923,480円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 161,310,710円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 53,042,866円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,361,494円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 93,387,800円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 79,384,983円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 253,475,380円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 124,628,072円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 143,424,749円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 31,364,778円 |
| 三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド | 185,695,612円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 3,502,496円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 13,766,131円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 11,897,831円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,957,599円 |
| S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ) | 36,164,679円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 765,606,897円 |
| バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定> | 5,449,180円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定> | 42,227,299円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 890,427,813円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 1,017,321,892円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 4,322,684,584円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 13,987,860円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 76,827,086円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 582,908,081円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 46,776,376円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 123,376,353円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 563,978,699円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 436,244,612円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 1,003,186,093円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 241,876円 |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 249,141,886円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 90,384,153円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 11,959,916円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 9,138,921円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 4,880,615円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 27,135,381円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 73,803,151円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 168,068,608円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 80,082,212円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 2,365,412,561円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 154,088,266円 |
| SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定> | 1,460,825,276円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 12,940,494円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 34,488,574円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 28,712,764円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 341,028,483円 |
| 合計 | 57,943,987,779円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 57,943,987,779円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,609,604,798円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 4,952,496,003円 |
| 2021年10月26日現在の元本の内訳 | |
| 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> | 754,017,690円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 884,665,283円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 3,766,910,960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> | 508,707,107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> | 41,029,721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> | 510,117,050円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 371,995,110円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 873,854,212円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 227,271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) | 227,128,858円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 78,333,839円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 9,597,233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> | 4,348,376円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 22,770,609円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 64,251,389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> | 145,115,763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> | 927,325,600円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 128,276,293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WR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2016-04<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<適格機関投資家限定> | 131,275,000円 |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 31,234,035,202円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 260,968,189円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 1,108,836,917円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 785,283,856円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 64,288,597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) | 5,971,411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) | 18,181,041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) | 48,258,013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) | 50,891,732円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 95,367,319円 |
| 外国株式指数ファンド | 721,548,115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 | 11,767,184,814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) | 81,506,744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) | 112,027,509円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 97,443,623円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 326,221,210円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 165,604,661円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 191,249,851円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 37,988,186円 |
| 三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド | 453,719,500円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 4,124,633円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 17,010,479円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 15,929,544円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,093,613円 |

| | |
|-------------------------------|-----------------|
| SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ) | 97,766,435円 |
| 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり) | 25,178,476円 |
| 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし) | 78,336,776円 |
| 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド | 8,199,219円 |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 620,998,111円 |
| バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定> | 4,307,046円 |
| 合計 | 59,601,096,574円 |

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|--------------|----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 251,077,719 | 526,579,090 |
| 金銭信託 | 762,512,013 | 97,960,231 |
| コール・ローン | 1,749,778,290 | 2,901,397,742 |
| 株式 | 9,586,932,925 | 10,527,265,791 |
| 投資信託受益証券 | 497,674,247 | 625,378,247 |
| 投資証券 | 912,831,155 | 1,287,130,172 |
| 派生商品評価勘定 | 16,583,310 | 108,590,275 |
| 未収入金 | 16,081,391 | 81,620 |
| 未収配当金 | 12,315,820 | 7,612,153 |
| 差入委託証拠金 | 785,870,472 | 844,333,381 |
| 流動資産合計 | 14,591,657,342 | 16,926,328,702 |
| 資産合計 | 14,591,657,342 | 16,926,328,702 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 33,807,564 | 42,450,007 |
| 前受金 | 121,915 | - |
| 未払金 | - | 6,208,183 |
| 未払解約金 | 290,000 | 56,513,166 |
| 未払利息 | 5,064 | - |
| その他未払費用 | 64,023 | 5,694 |
| 流動負債合計 | 34,288,566 | 105,177,050 |
| 負債合計 | 34,288,566 | 105,177,050 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 8,325,755,557 | 9,423,435,311 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 6,231,613,219 | 7,397,716,341 |
| 元本等合計 | 14,557,368,776 | 16,821,151,652 |
| 純資産合計 | 14,557,368,776 | 16,821,151,652 |
| 負債純資産合計 | 14,591,657,342 | 16,926,328,702 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 8,325,755,557口 | 9,423,435,311口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.7485円 (1万口当たりの純資産額17,485円) | 1口当たり純資産額 1.7850円 (1万口当たりの純資産額17,850円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |

| | |
|------------|---|
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
|------------|---|

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|---------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | MSCIE 2106 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| | 小計 | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |
| 合計 | | 3,557,460,207 | - | 3,557,582,122 | 121,915 |

(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 | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 小計 | 2,684,900,000 | - | 2,664,838,702 | 20,061,298 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| | 小計 | 157,000,000 | - | 154,284,871 | 2,715,129 |
| 合計 | | 2,841,900,000 | - | 2,819,123,573 | 17,346,169 |

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-----------|---------------|------------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | MSCIE 2112 | 4,452,535,009 | - | 4,427,417,850 | 25,117,159 |
| | 小計 | 4,452,535,009 | - | 4,427,417,850 | 25,117,159 |
| 合計 | | 4,452,535,009 | - | 4,427,417,850 | 25,117,159 |

(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おります。

- 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 | | 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 | 2,986,400,000 | - | 3,077,657,427 | 91,257,427 |
| | 小計 | 2,986,400,000 | - | 3,077,657,427 | 91,257,427 |
| 合 計 | | 2,986,400,000 | - | 3,077,657,427 | 91,257,427 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|--------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 5,713,549,870円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 4,826,668,980円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 2,214,463,293円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 4,212,467,456円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 2,168,457,848円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 423,316,544円 |

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 466,719,046円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 305,570,265円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 36,830,971円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 19,428,099円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 51,180,927円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 38,730,510円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 184,820,124円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 125,451,007円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 215,280,733円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 45,405,336円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,767,956円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 29,328,735円 |
| 合 計 | 8,325,755,557円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 8,325,755,557円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,118,789,613円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,021,109,859円 |
| 2021年10月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド | 5,382,168,685円 |
| 三井住友・DC新興国株式インデックスファンド | 2,478,044,747円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 109,075,509円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 255,242,269円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 167,576,278円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 25,388,285円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 73,565,217円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 53,525,661円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 210,078,988円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 160,872,013円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 266,222,892円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 61,829,402円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 3,351,825円 |
| 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり) | 53,990,483円 |
| 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし) | 86,059,148円 |
| 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド | 1,502,268円 |
| S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 34,941,641円 |
| 合 計 | 9,423,435,311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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|------|----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 115,436,377 | 10,975,266 |

| | | |
|-------------|-----------------|-----------------|
| コール・ローン | 264,898,208 | 325,066,740 |
| 国債証券 | 105,830,132,390 | 109,286,833,410 |
| 地方債証券 | 8,548,198,020 | 10,797,334,372 |
| 特殊債券 | 11,590,909,198 | 10,879,166,139 |
| 社債券 | 4,049,851,000 | 5,541,104,500 |
| 未収入金 | 147,505,200 | 155,000,000 |
| 未収利息 | 272,216,894 | 261,024,308 |
| 前払費用 | 3,189,756 | 5,664,975 |
| 流動資産合計 | 130,822,337,043 | 137,262,169,710 |
| 資産合計 | 130,822,337,043 | 137,262,169,710 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 121,292,855 | 18,290,000 |
| 未払利息 | 766 | - |
| その他未払費用 | 12,631 | 1,144 |
| 流動負債合計 | 121,306,252 | 18,291,144 |
| 負債合計 | 121,306,252 | 18,291,144 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 102,129,036,469 | 107,465,774,735 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 28,571,994,322 | 29,778,103,831 |
| 元本等合計 | 130,701,030,791 | 137,243,878,566 |
| 純資産合計 | 130,701,030,791 | 137,243,878,566 |
| 負債純資産合計 | 130,822,337,043 | 137,262,169,710 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項 目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （2021年4月26日現在） | （2021年10月26日現在） |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 102,129,036,469口 | 107,465,774,735口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.2798円 （1万口当たりの純資産額12,798円） | 1口当たり純資産額 1.2771円 （1万口当たりの純資産額12,771円） |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | （2021年10月26日現在） |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（国債証券、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26日現在） | |
|-----------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 105,756,496,620円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 20,315,447,294円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 23,942,907,445円 |
| 2021年4月26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） | 6,095,887,942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 |
| S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型） | 700,095,955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） | 184,825,933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） | 433,396,306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） | 578,861,248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） | 261,394,053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） | 405,524,676円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型） | 136,367,739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) | 1,247,380,644円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 401,741,595円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 588,869,057円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 120,192,626円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 34,443,552円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 93,363,201円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 77,139,001円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 128,231,732円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 35,509,835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> | 1,590,676,701円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 14,416,480,636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> | 291,860,981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> | 124,997,220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> | 2,221,232,701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> | 9,293,268,718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) | 1,258,717,162円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 469,800,479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> | 182,525,240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> | 1,623,185,800円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 2,259,171,883円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 791,362,877円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 219,084,514円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,227,758円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 298,258,456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<適格機関投資家限定> | 3,349,108,014円 |
| 合計 | 102,129,036,469円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|-------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 102,129,036,469円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 10,976,587,516円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 5,639,849,250円 |

2021年10月26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) | 6,369,487,446円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 11,233,732,227円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 2,558,536,291円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 858,029,662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) | 679,198,952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) | 321,300,989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) | 465,163,579円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 152,480,163円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 2,507,644,800円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 1,182,022,038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) | 1,714,229,942円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 575,969,347円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 864,957,253円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 196,867,147円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 72,063,680円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 125,125,041円 |
| 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型) | 102,725,001円 |
| 三井住友DS・年金バランス50(標準型) | 178,197,275円 |
| 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型) | 53,398,812円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 5,826,533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> | 16,538,979,912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> | 121,919,952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> | 2,240,756,747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> | 972,355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) | 1,232,074,761円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 465,789,398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> | 181,991,771円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 43,914,593円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 1,512,864,695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> | 211,638,056円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,488,122円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 286,090,880円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,448,283,086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> | 431,707,118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> | 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<適格機関投資家限定> | 6,075,448,188円 |
| 合計 | 107,465,774,735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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 101,589,326 | 185,673,846 |
| 金銭信託 | 105,268,890 | 13,463,698 |
| コール・ローン | 241,566,316 | 398,769,398 |
| 国債証券 | 161,434,643,407 | 158,969,096,344 |
| 派生商品評価勘定 | 1,325,008 | - |
| 未収入金 | 653,000,000 | - |
| 未収利息 | 1,174,280,811 | 1,034,474,849 |
| 前払費用 | 20,257,638 | 30,260,532 |
| 流動資産合計 | 163,731,931,396 | 160,631,738,667 |
| 資産合計 | 163,731,931,396 | 160,631,738,667 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 489,197 | - |
| 未払金 | 647,205,081 | - |
| 未払解約金 | 265,826,302 | 9,747,717 |
| 未払利息 | 699 | - |
| その他未払費用 | 9,108 | 896 |
| 流動負債合計 | 913,530,387 | 9,748,613 |
| 負債合計 | 913,530,387 | 9,748,613 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 84,390,597,281 | 80,594,410,150 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 78,427,803,728 | 80,027,579,904 |
| 元本等合計 | 162,818,401,009 | 160,621,990,054 |
| 純資産合計 | 162,818,401,009 | 160,621,990,054 |
| 負債純資産合計 | 163,731,931,396 | 160,631,738,667 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 84,390,597,281口 | 80,594,410,150口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.9293円 (1万口当たりの純資産額19,293円) | 1口当たり純資産額 1.9930円 (1万口当たりの純資産額19,930円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|-------------------|-----------------|-------------|-----------|-------------|-----------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 309,432,427 | - | 309,153,111 | 279,316 |
| | イギリス・ポンド | 49,432,655 | - | 49,222,779 | 209,876 |
| | スウェーデン・ク ローナ | 26,903,934 | - | 26,965,931 | 61,997 |
| | ユーロ | 264,273,378 | - | 265,536,384 | 1,263,006 |
| | 小計 | 650,042,394 | - | 650,878,205 | 835,811 |
| 合計 | | 650,042,394 | - | 650,878,205 | 835,811 |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(2021年10月26日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|------------------------|-----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 84,222,011,513円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 11,191,601,392円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 11,023,015,624円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 23,534,936,984円 |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 729,649,813円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,025,052,215円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,054,240,718円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 147,217,912円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 6,940,706円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 28,769,951円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ) | 94,042,578円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ) | 178,438,989円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ) | 114,062,243円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 213,016,075円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 24,082,222円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 139,530,302円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 165,360,909円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 88,010,634円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 82,884,377円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050 | 13,098,149円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 70,276,236円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 46,159,136円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 110,380,542円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 33,794,045円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 22,772,725円 |
| 三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド | 82,278,579円 |
| 三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド | 123,896,191円 |
| 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) | 9,281,514円 |
| 三井住友D S・年金バランス50(標準型) | 24,027,031円 |
| 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) | 15,516,979円 |
| 三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,832,778円 |
| SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> | 2,338,391,074円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 53,057,364円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 8,328,869,926円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 4,860,208,256円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 11,174,840,543円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 35,901,694円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 97,373,210円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 740,287,615円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 121,217,577円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,100,173,191円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 1,455,394,432円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,680,280,937円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 5,267,062,313円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 619,895円 |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 8,780,087,672円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 345,222,445円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 154,703,653円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 90,561,097円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 35,408,120円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 11,874,819円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 108,523,473円 |

| | |
|---|-----------------|
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 453,166,105円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 119,259,614円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 42,530,817円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 5,288,637円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 1,117,376,981円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定> | 715,810,156円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定> | 1,078,469,323円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 3,029,032,100円 |
| SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定> | 474,627,289円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 47,517,572円 |
| SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 64,301,287円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 177,723,755円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 149,075,586円 |
| SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定> | 956,808,220円 |
| 合計 | 84,390,597,281円 |

(2021年10月26日現在)

開示対象ファンドの

| | |
|-------------------|-----------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 84,390,597,281円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 3,737,778,328円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 7,533,965,459円 |

2021年10月26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 | 24,383,526,755円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 749,413,440円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,110,402,373円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 1,115,145,641円 |
| SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型) | 71,130,982円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ) | 7,016,735円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ) | 30,106,834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) | 101,156,651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) | 143,032,695円 |
| 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ) | 244,503,858円 |
| 三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型) | 25,803,567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) | 79,924,121円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 55,214,305円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 16,253,170円 |
| 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) | 109,668,266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 | 107,529,581円 |
| 三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド | 209,741,789円 |

| | |
|---|-----------------|
| 三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型) | 12,000,934円 |
| 三井住友D S ・年金バランス50(標準型) | 33,037,411円 |
| 三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型) | 22,659,256円 |
| 三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060 | 2,188,969円 |
| 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし) | 43,511,218円 |
| 三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド | 3,393,039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> | 2,391,533,473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> | 7,593,922,949円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 4,660,754,134円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 10,766,626,042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> | 726,204,731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> | 1,446,325,136円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 1,582,948,990円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 4,985,448,850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> | 8,400,344,573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) | 338,430,451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> | 83,316,884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> | 99,632,015円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 433,259,066円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 111,499,201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> | 5,227,282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> | 661,340,146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> | 1,287,798,070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・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<適格機関投資家限定> | 171,352,184円 |
| 合計 | 80,594,410,150円 |

Jリート・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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|--------------|----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 29,114,056 | 3,090,868 |
| コール・ローン | 66,809,626 | 91,545,692 |
| 投資証券 | 8,029,616,750 | 8,005,189,240 |
| 派生商品評価勘定 | 4,736,400 | - |
| 未収入金 | 2,631,744 | - |
| 未収配当金 | 58,652,103 | 57,063,298 |
| 前払金 | - | 1,644,000 |
| 差入委託証拠金 | 3,330,000 | 1,930,000 |
| 流動資産合計 | 8,194,890,679 | 8,160,463,098 |
| 資産合計 | 8,194,890,679 | 8,160,463,098 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | - | 1,818,400 |
| 前受金 | 4,743,000 | - |
| 未払金 | - | 23,765,254 |
| 未払解約金 | 68,058,794 | 8,180,792 |
| 未払利息 | 193 | - |
| その他未払費用 | 2,229 | 208 |
| 流動負債合計 | 72,804,216 | 33,764,654 |
| 負債合計 | 72,804,216 | 33,764,654 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 3,071,522,148 | 2,998,520,244 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 5,050,564,315 | 5,128,178,200 |
| 元本等合計 | 8,122,086,463 | 8,126,698,444 |
| 純資産合計 | 8,122,086,463 | 8,126,698,444 |
| 負債純資産合計 | 8,194,890,679 | 8,160,463,098 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。 |

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

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 3,071,522,148口 | 2,998,520,244口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.6443円 (1万口当たりの純資産額26,443円) | 1口当たり純資産額 2.7102円 (1万口当たりの純資産額27,102円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|----|----|------|-----------|----|------|
| | | | うち 1年超 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|------|----------------|------------|---|------------|-----------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | 東証REIT指数先物 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| | 小計 | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |
| 合計 | | 56,628,600 | - | 61,365,000 | 4,736,400 |

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|------------------|------------|-----------|------------|-----------|
| | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | TREIT先物0312 月 | 42,968,400 | - | 41,150,000 | 1,818,400 |
| | 小計 | 42,968,400 | - | 41,150,000 | 1,818,400 |
| 合計 | | 42,968,400 | - | 41,150,000 | 1,818,400 |

(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おります。

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26日現在) | |
|---------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 2,079,734,759円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,566,048,223円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,574,260,834円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 316,132,317円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 348,559,330円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 238,816,451円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 84,560,850円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,588,375,824円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 9,834,653円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 35,461,155円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 25,278,674円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 80,153,697円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 41,281,247円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 33,683,493円 |

| | |
|--|----------------|
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 15,113,869円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,448,736円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド | 20,024,548円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 50,433,479円 |
| SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 31,132,085円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定> | 82,301,805円 |
| SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定> | 68,929,935円 |
| 合計 | 3,071,522,148円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|--|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,071,522,148円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 906,087,018円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 979,088,922円 |
| 2021年10月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 75,869,811円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 146,589,272円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 112,963,577円 |
| 三井住友・DC日本リートインデックスファンド | 1,770,092,689円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 12,217,183円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 45,321,144円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 32,778,233円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 107,017,652円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 56,950,535円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 44,697,473円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 19,033,863円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 1,674,353円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド | 48,671,501円 |
| 日興FWS・Jリートインデックス | 30,969,044円 |
| 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド | 610,389円 |
| SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定> | 4,468,570円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 1,956,903円 |
| SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 45,708,602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> | 94,060,983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> | 102,454,559円 |
| SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定> | 244,413,908円 |
| 合計 | 2,998,520,244円 |

外国リート・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26日現在)

(2021年10月26日現在)

資産の部

| | | |
|-------------|----------------|----------------|
| 流動資産 | | |
| 預金 | 44,482,747 | 141,670,781 |
| 金銭信託 | 28,588,674 | 1,103,809 |
| コール・ローン | 65,604,005 | 32,692,749 |
| 投資証券 | 11,519,480,828 | 16,649,199,170 |
| 派生商品評価勘定 | 17,814 | 10,841 |
| 未収入金 | 57,714,478 | 2,404,043 |
| 未収配当金 | 11,685,275 | 8,010,893 |
| 流動資産合計 | 11,727,573,821 | 16,835,092,286 |
| 資産合計 | | |
| | 11,727,573,821 | 16,835,092,286 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 49,052 | 44,531 |
| 未払金 | - | 92,677,214 |
| 未払解約金 | 142,622,000 | 2,000,000 |
| 未払利息 | 189 | - |
| その他未払費用 | 547 | 75 |
| 流動負債合計 | 142,671,788 | 94,721,820 |
| 負債合計 | | |
| | 142,671,788 | 94,721,820 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 4,897,225,610 | 5,977,052,819 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 6,687,676,423 | 10,763,317,647 |
| 元本等合計 | 11,584,902,033 | 16,740,370,466 |
| 純資産合計 | | |
| | 11,584,902,033 | 16,740,370,466 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 11,727,573,821 | 16,835,092,286 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 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26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 4,897,225,610口 | 5,977,052,819口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.3656円 (1万口当たりの純資産額23,656円) | 1口当たり純資産額 2.8008円 (1万口当たりの純資産額28,008円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券(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26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|----|--------------|-----------|-----------|-----------|------|
| | | | うち 1年超 | | |
| | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 2,500,000 | - | 2,499,953 | 47 |
| | イギリス・ポンド | 500,000 | - | 499,947 | 53 |
| | オーストラリア・ドル | 800,000 | - | 799,894 | 106 |

| | | | | | |
|-------------------|-------------|------------|---|------------|--------|
| 市場取引 以外の取 引 | ユーロ | 500,000 | - | 499,985 | 15 |
| | 小計 | 4,300,000 | - | 4,299,779 | 221 |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 37,991,360 | - | 37,976,928 | 14,432 |
| | イギリス・ポンド | 2,839,151 | - | 2,846,004 | 6,853 |
| | オーストラリア・ドル | 3,410,872 | - | 3,431,290 | 20,418 |
| | カナダ・ドル | 949,850 | - | 952,152 | 2,302 |
| | シンガポール・ドル | 1,785,168 | - | 1,790,118 | 4,950 |
| | ニュージーランド・ドル | 1,245,808 | - | 1,243,028 | 2,780 |
| | ユーロ | 2,205,070 | - | 2,219,378 | 14,308 |
| | 香港・ドル | 1,196,002 | - | 1,195,400 | 602 |
| | 小計 | 51,623,281 | - | 51,654,298 | 31,017 |
| | 合 計 | 55,923,281 | - | 55,954,077 | 31,238 |

(2021年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

| 区 分 | 種 類 | 契 約 額 等 | | 時 価 | 評 価 損 益 |
|-------------------|--------------|------------|--------------|------------|---------|
| | | | う ち 1 年 超 | | |
| 市場取引 以外の取 引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | アメリカ・ドル | 26,000,000 | - | 25,971,622 | 28,378 |
| | オーストラリア・ドル | 2,800,000 | - | 2,810,841 | 10,841 |
| | 香港・ドル | 900,000 | - | 898,471 | 1,529 |
| | イギリス・ポンド | 2,600,000 | - | 2,591,173 | 8,827 |
| | ユーロ | 1,700,000 | - | 1,694,203 | 5,797 |
| | 小計 | 34,000,000 | - | 33,966,310 | 33,690 |
| 合 計 | 34,000,000 | - | 33,966,310 | 33,690 | |

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算

期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

| (2021年4月26日現在) | |
|---|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 3,351,152,062円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,408,226,049円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 862,152,501円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 36,052,341円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 44,692,972円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 29,319,643円 |
| イオン・バランス戦略ファンド | 44,687,417円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 4,353,843,871円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 3,924,728円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 40,667,543円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 28,606,664円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 90,223,455円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 46,713,633円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 37,645,676円 |
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 51,093,218円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 583,824円 |
| 三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド | 17,098,546円 |
| S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 46,391,095円 |
| S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定> | 25,680,984円 |
| 合計 | 4,897,225,610円 |

| (2021年10月26日現在) | |
|---------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 4,897,225,610円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,563,344,296円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 483,517,087円 |
| 2021年10月26日現在の元本の内訳 | |
| アセットアロケーション・ファンド(安定型) | 19,396,868円 |
| アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) | 21,022,305円 |
| アセットアロケーション・ファンド(成長型) | 13,874,376円 |
| 三井住友・DC外国リートインデックスファンド | 5,173,971,773円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 4,587,512円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型) | 47,287,876円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型) | 33,658,907円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型) | 107,422,427円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型) | 57,923,181円 |
| 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型) | 45,783,835円 |

| | |
|--|----------------|
| 三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド | 59,379,722円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 593,880円 |
| 三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド | 81,832,849円 |
| 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり) | 8,961,079円 |
| 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし) | 28,002,984円 |
| 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド | 802,404円 |
| SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定> | 48,121,685円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定> | 4,943,783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> | 34,135,132円 |
| SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定> | 185,350,241円 |
| 合計 | 5,977,052,819円 |

マネープール・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

| | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|----------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | 9,358,922,331 | 873,133,248 |
| コール・ローン | 21,476,434,249 | 25,860,564,060 |
| 国債証券 | 140,573,607,440 | 29,644,665,350 |
| 地方債証券 | 25,118,583,522 | 73,707,811,886 |
| 特殊債券 | 8,240,812,665 | 10,318,223,452 |
| 現先取引勘定 | 150,039,000,000 | 200,132,000,000 |
| 未収利息 | 70,318,149 | 106,823,504 |
| 前払費用 | 2,907,787 | 14,468,213 |
| 流動資産合計 | 354,880,586,143 | 340,657,689,713 |
| 資産合計 | | |
| | 354,880,586,143 | 340,657,689,713 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | - | 540,949,600 |
| 未払利息 | 62,163 | - |
| その他未払費用 | 1,644,919 | 70,501 |
| 流動負債合計 | 1,707,082 | 541,020,101 |
| 負債合計 | | |
| | 1,707,082 | 541,020,101 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 354,525,983,575 | 339,935,919,283 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 352,895,486 | 180,750,329 |
| 元本等合計 | 354,878,879,061 | 340,116,669,612 |
| 純資産合計 | | |
| | 354,878,879,061 | 340,116,669,612 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 354,880,586,143 | 340,657,689,713 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自 2021年4月27日 至 2021年10月26日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (2021年4月26日現在) | (2021年10月26日現在) |
|-----------------------|---|---|
| 1. 当計算期間の末日における受益権の総数 | 354,525,983,575口 | 339,935,919,283口 |
| 2. 1単位当たり純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0010円 (1万口当たりの純資産額10,010円) | 1口当たり純資産額 1.0005円 (1万口当たりの純資産額10,005円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (2021年10月26日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| |
|----------------|
| (2021年4月26日現在) |
|----------------|

| | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 334,872,062,439円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 32,847,424,987円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 13,193,503,851円 |
| 2021年4月26日現在の元本の内訳 | |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル) | 144,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド) | 3,474,833円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(中国元) | 12,046,048円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル) | 50,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(円) | 11,000,000円 |
| 三井住友・公益債券投信(毎月決算型) | 8,874,310円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型) | 4,305,812円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |
| 三井住友・公益債券投信(資産成長型) | 941,890円 |
| 日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド | 9,958,176円 |
| B N P パリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) | 1,485,087円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジあり) | 279,064円 |
| 三井住友・新興国債券トータルリターン・ファンド(為替ヘッジなし) | 1,275,775円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジあり) | 1,953,537円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジなし) | 2,960,215円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |
| S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 3 <適格機関投資家限定> | 354,271,175,679円 |
| 合 計 | 354,525,983,575円 |

(2021年10月26日現在)

| | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 354,525,983,575円 |
| 同期中における追加設定元本額 | -円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 14,590,064,292円 |
| 2021年10月26日現在の元本の内訳 | |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(ブラジルリアル) | 144,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(南アランド) | 3,474,833円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(中国元) | 12,046,048円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(豪ドル) | 50,000,000円 |
| S M B C ・日興ニューワールド債券ファンド(円) | 11,000,000円 |
| 三井住友・公益債券投信(毎月決算型) | 8,874,310円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジ型) | 4,305,812円 |
| グローバル・ハイブリッド証券ファンド(為替ノーヘッジ型) | 1,026,625円 |
| 三井住友・公益債券投信(資産成長型) | 941,890円 |
| 日興グラビティ・ヨーロピアン・ファンド | 9,958,176円 |
| B N P パリバ・グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり) | 1,485,087円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジあり) | 1,953,537円 |
| 米国優先リートファンド(為替ヘッジなし) | 2,960,215円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050 | 897,182円 |
| 三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060 | 329,342円 |

SMAM・アセットバランスファンドVA25L3<適格機関投資家限定>

339,682,666,226円

合 計

339,935,919,283円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060

2021年11月30日現在

| | |
|----------------|-------------|
| 資産総額 | 53,434,550円 |
| 負債総額 | 20,802円 |
| 純資産総額（ - ） | 53,413,748円 |
| 発行済口数 | 45,889,617口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1640円 |
| （1万口当たり純資産額） | （11,640円） |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

| | |
|--------------|---------------|
| | 2021年11月30日現在 |
| 資本金の額 | 20億円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000,000株 |
| 発行済株式総数 | 33,870,060株 |

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年11月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

| | 本数(本) | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 735 | 9,493,408 |
| 単位型株式投資信託 | 102 | 551,354 |
| 追加型公社債投資信託 | 1 | 28,433 |
| 単位型公社債投資信託 | 190 | 428,557 |
| 合計 | 1,028 | 10,501,754 |

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

2 当社は、第36期(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第37期中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

| | (単位：千円) | |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| | 前事業年度 (2020年3月31日) | 当事業年度 (2021年3月31日) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 33,264,545 | 33,048,142 |
| 顧客分別金信託 | 300,021 | 300,036 |
| 前払費用 | 515,226 | 449,748 |
| 未収入金 | 602,605 | 132,419 |
| 未収委託者報酬 | 8,404,880 | 9,936,096 |
| 未収運用受託報酬 | 2,199,785 | 2,247,156 |
| 未収投資助言報酬 | 299,826 | 398,108 |
| 未収収益 | 37,702 | 39,975 |

| | | | |
|------------|---|-------------|-------------|
| その他の流動資産 | | 40,119 | 6,981 |
| 流動資産合計 | | 45,664,712 | 46,558,665 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | 1 | | |
| 建物 | | 101,609 | 1,509,450 |
| 器具備品 | | 783,224 | 870,855 |
| 土地 | | 710 | 710 |
| リース資産 | | 968 | 13,483 |
| 建設仮勘定 | | 66,498 | - |
| 有形固定資産合計 | | 953,010 | 2,394,500 |
| 無形固定資産 | | | |
| ソフトウェア | | 909,133 | 1,347,889 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 508,733 | 1,029,033 |
| のれん | | 34,397,824 | 3,654,491 |
| 顧客関連資産 | | 17,785,166 | 15,671,890 |
| 電話加入権 | | 12,739 | 12,727 |
| 商標権 | | 54 | 48 |
| 無形固定資産合計 | | 53,613,651 | 21,716,080 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | 19,436,480 | 22,866,282 |
| 関係会社株式 | | 11,246,398 | 11,246,398 |
| 長期差入保証金 | | 2,523,637 | 1,409,091 |
| 長期前払費用 | | 113,852 | 116,117 |
| 会員権 | | 90,479 | 90,479 |
| 貸倒引当金 | | 20,750 | 20,750 |
| 投資その他の資産合計 | | 33,390,098 | 35,707,619 |
| 固定資産合計 | | 87,956,760 | 59,818,200 |
| 資産合計 | | 133,621,473 | 106,376,866 |

(単位：千円)

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

| | | |
|--------------|-------------|-------------|
| 負債合計 | 19,502,164 | 21,331,554 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| その他資本剰余金 | 81,927,000 | 81,927,000 |
| 資本剰余金合計 | 90,555,984 | 90,555,984 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 60,000 | 60,000 |
| 別途積立金 | 1,476,959 | 1,476,959 |
| 繰越利益剰余金 | 19,364,265 | 10,281,242 |
| 利益剰余金合計 | 21,185,470 | 8,460,037 |
| 株主資本計 | 113,741,454 | 84,095,946 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 377,855 | 949,365 |
| 評価・換算差額等合計 | 377,855 | 949,365 |
| 純資産合計 | 114,119,309 | 85,045,311 |
| 負債・純資産合計 | 133,621,473 | 106,376,866 |

(2) 【損益計算書】

| | (単位：千円) | |
|-----------------|--|--|
| | 前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | 当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 54,615,133 | 50,610,457 |
| 運用受託報酬 | 9,389,058 | 9,450,169 |
| 投資助言報酬 | 1,303,595 | 1,270,584 |
| その他営業収益 | | |
| サービス支 hands 手数料 | 181,061 | 200,807 |
| その他 | 32,421 | 32,820 |
| 営業収益計 | 65,521,269 | 61,564,839 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 24,888,040 | 22,784,919 |
| 広告宣伝費 | 447,024 | 365,317 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 3,214,679 | 3,061,987 |
| 委託調査費 | 7,702,309 | 7,810,157 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 70,007 | 95,163 |
| 印刷費 | 612,249 | 554,920 |
| 協会費 | 45,117 | 40,044 |
| 諸会費 | 32,199 | 29,473 |
| 情報機器関連費 | 4,349,174 | 4,562,612 |
| 販売促進費 | 68,688 | 23,614 |
| その他 | 154,201 | 163,332 |
| 営業費用合計 | 41,583,691 | 39,491,542 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |

| | | |
|-----------|------------|------------|
| 役員報酬 | 264,325 | 277,027 |
| 給料・手当 | 9,789,691 | 9,280,730 |
| 賞与 | 914,702 | 950,630 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,726,013 | 1,501,855 |
| 交際費 | 30,898 | 11,815 |
| 寄付金 | 2,022 | 949 |
| 事務委託費 | 956,931 | 844,255 |
| 旅費交通費 | 249,359 | 21,023 |
| 租税公課 | 389,032 | 389,819 |
| 不動産賃借料 | 1,121,553 | 1,639,529 |
| 退職給付費用 | 797,158 | 790,144 |
| 固定資産減価償却費 | 3,044,658 | 3,040,894 |
| のれん償却費 | 2,645,986 | 2,645,986 |
| 諸経費 | 482,324 | 608,206 |
| 一般管理費合計 | 22,414,658 | 22,002,869 |
| 営業利益 | 1,522,919 | 70,426 |

(単位：千円)

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

当期純利益又は
当期純損失()

578,811

28,934,237

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (2020年3月31日) | 当事業年度 (2021年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 当座借越極度額の総額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |
| 借入実行残高 | - 千円 | - 千円 |
| 差引額 | 10,000,000千円 | 10,000,000千円 |

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|------|-------|----|--------|
| 千代田区 | 事業用資産 | 建物 | 46,417 |

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

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

当事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|----|-----|-----|------------|
| - | その他 | のれん | 28,097,346 |

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

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

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

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 本社移転費用

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2020年3月31日)

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|----|----------|----|----|
|----|----------|----|----|

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

（注2）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

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

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

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

当事業年度(2021年3月31日)

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

2.その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | (単位：千円) | |
|---------------|-------------------------|-------------------------|
| | 前事業年度 (2020年 3月 31日) | 当事業年度 (2021年 3月 31日) |
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 1,622,803 | 1,610,136 |
| 賞与引当金 | 530,059 | 464,389 |
| 調査費 | 178,573 | 247,208 |
| 未払金 | 162,557 | 206,090 |
| 未払事業税 | 46,423 | 66,891 |
| ソフトウェア償却 | 91,937 | 90,431 |
| 子会社株式評価損 | 114,876 | 114,876 |
| その他有価証券評価差額金 | 150,771 | 131,391 |
| その他 | 88,250 | 35,930 |
| 繰延税金資産小計 | 2,986,254 | 2,967,346 |
| 評価性引当額(注) | 193,485 | 218,966 |
| 繰延税金資産合計 | 2,792,768 | 2,748,380 |
| 繰延税金負債 | | |
| 無形固定資産 | 5,445,817 | 4,798,732 |
| その他有価証券評価差額金 | 310,488 | 516,605 |
| 繰延税金負債合計 | 5,756,306 | 5,315,338 |
| 繰延税金資産(負債)の純額 | 2,963,538 | 2,566,958 |

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

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

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の 名称又は 氏名 | 所在地 | 資本金、出資金 又は基金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権等の 所有(被所 有)割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|--------------------|-------------|-----------------|-------------------|------------------------|------------------|-------------|-----------|-----------|---------|
| 親会社 の子会社 | ㈱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 | | | 利益準備金 | 利益剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | その他利益剰余金 | | |
| | | | | | 配当準備積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 81,927,000 | 90,555,984 | 284,245 | 60,000 | 1,476,959 | 10,281,242 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 欠損填補 | | | 8,460,037 | 8,460,037 | | | | 8,460,037 |
| 中間純利益 | | | | | | | | 2,045,951 |
| 任意積立金の取崩 | | | | | | 60,000 | 1,476,959 | 1,536,959 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | 8,460,037 | 8,460,037 | - | 60,000 | 1,476,959 | 12,042,949 |
| 当中間期末残高 | 2,000,000 | 8,628,984 | 73,466,962 | 82,095,946 | 284,245 | - | - | 1,761,706 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------|------------|------------|--------------|------------|------------|
| | 利益剰余金 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| | 利益剰余金合計 | | | | |
| 当期首残高 | 8,460,037 | 84,095,946 | 949,365 | 949,365 | 85,045,311 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 欠損填補 | 8,460,037 | - | | | - |
| 中間純利益 | 2,045,951 | 2,045,951 | | | 2,045,951 |
| 任意積立金の取崩 | | | | | |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | 265,562 | 265,562 | 265,562 |
| 当中間期変動額合計 | 10,505,989 | 2,045,951 | 265,562 | 265,562 | 2,311,514 |
| 当中間期末残高 | 2,045,951 | 86,141,897 | 1,214,928 | 1,214,928 | 87,356,826 |

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

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

当該会計基準等の適用が中間財務諸表に及ぼす影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

発行済株式数に関する事項

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

1.金融商品の時価等に関する事項

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

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

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|------------------------|------------|------------|----|
| (1)現金及び預金 | 38,529,337 | 38,529,337 | - |
| (2)顧客分別金信託 | 300,038 | 300,038 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 10,909,133 | 10,909,133 | - |
| (4)未収運用受託報酬 | 2,723,571 | 2,723,571 | - |
| (5)未収投資助言報酬 | 399,072 | 399,072 | - |
| (6)投資有価証券 その他有価証券 | 21,960,848 | 21,960,848 | - |
| (7)投資その他の資産 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 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

 その他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

 長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

1.子会社株式

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

2.その他有価証券

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

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

(セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| 第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)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

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

□ 販売会社

- (イ) 名称 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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年6月8日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2020年4月28日から2021年4月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2021年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月22日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**中間監査意見**

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月30日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 菅野 雅子 |
|--------------------|-------|-------|

| | | |
|--------------------|-------|-------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 松井 貴志 |
|--------------------|-------|-------|

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2021年4月27日から2021年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060の2021年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年4月27日から2021年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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