

## 【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】	令和1年9月17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 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040 1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

以下上記ファンドを総称して、「当ファンド」ということがあり、また、それぞれを各ファンドと  
いうことがあります。また、各ファンドをそれぞれ<2010>、<2020>、<2030>、  
<2040>と略称することがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド1兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本  
経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「TY2010」、「TY2020」、  
「TY2030」、「TY2040」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	電話番号	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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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】

無手数料です。

## (6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(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。

## (7) 【申込期間】

2019年9月18日から2020年3月17日まで

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

## (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

## (9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)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。

八 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。

二 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、他の投資信託への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ロ 各ファンドにつき定めるターゲット・イヤー 到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。
- 各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。  
 < 2 0 1 0 >・・・西暦2010年、 < 2 0 2 0 >・・・西暦2020年  
 < 2 0 3 0 >・・・西暦2030年、 < 2 0 4 0 >・・・西暦2040年
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金3,000億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。
- ニ 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）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券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

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	その他資産 ( ) <b>資産複合</b>

(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	<b>年1回</b>	<b>グローバル</b>		
一般		<b>(日本を含む)</b>		
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	日々	オセアニア		
社債	その他	中南米		
その他債券	( )	アフリカ	<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>	<b>なし</b>
クレジット属性				
( )				
不動産投信				
<b>その他資産</b>				
<b>(投資信託証券(資</b>				
<b>産複合(株式、債</b>		中近東(中東)		
<b>券)資産配分変更</b>				
<b>型))</b>		エマージング		
資産複合				
( )				
資産配分固定				
型				
資産配分変更				
型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

- 2001年3月13日 信託契約締結、設定、運用開始。  
(設定時の委託会社はさくら投信投資顧問株式会社)
- 2002年12月1日 三井住友アセットマネジメント株式会社が、合併によりファンドの委託会社としての業務を承継。「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」から「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」に名称を変更。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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(2019年7月31日現在)

## (ロ) 会社の沿革

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

## (ハ) 大株主の状況

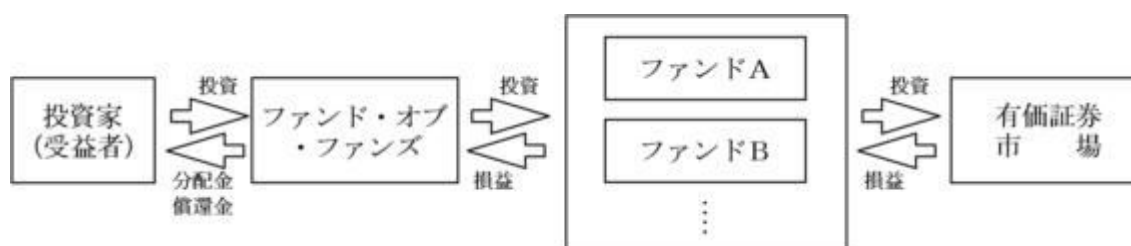
(2019年7月31日現在)

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】

## イ 基本方針



各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います(グローバル・バランス型ファンド)。

(ロ) 投資資産配分(基本アロケーション)は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、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し、原則として1年(計算期間)毎に見直します。

各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン(収益)の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク(損益の変動幅)が大きくなる傾向があります。

ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

(ハ) 期中の基本アロケーションとの乖離については、原則として四半期毎に見直し、必要に応じてリバランスを実施します。

(ニ) 主要投資対象とする投資信託は、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。

##### a . S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### b . S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

運用会社	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内債券
運用の基本方針	N O M U R A - B P I (総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### c . 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)

運用会社	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国株式
運用の基本方針	M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### d . 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>

運用会社	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

##### e . S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

運用会社	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建の短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

## ファンドの特色

**1** 他の投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。

**2** 各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

**3** ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

□ 「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）。

種々の特徴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。

※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。



## 各ファンドのターゲット・イヤー

<2010> …… 西暦2010年、 <2020> …… 西暦2020年  
<2030> …… 西暦2030年、 <2040> …… 西暦2040年

■投資資産配分(基本アロケーション)は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、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し、原則として1年(計算期間)毎に見直します。

- 各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン(収益)の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク(損益の変動幅)が大きくなる傾向があります。
- ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

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

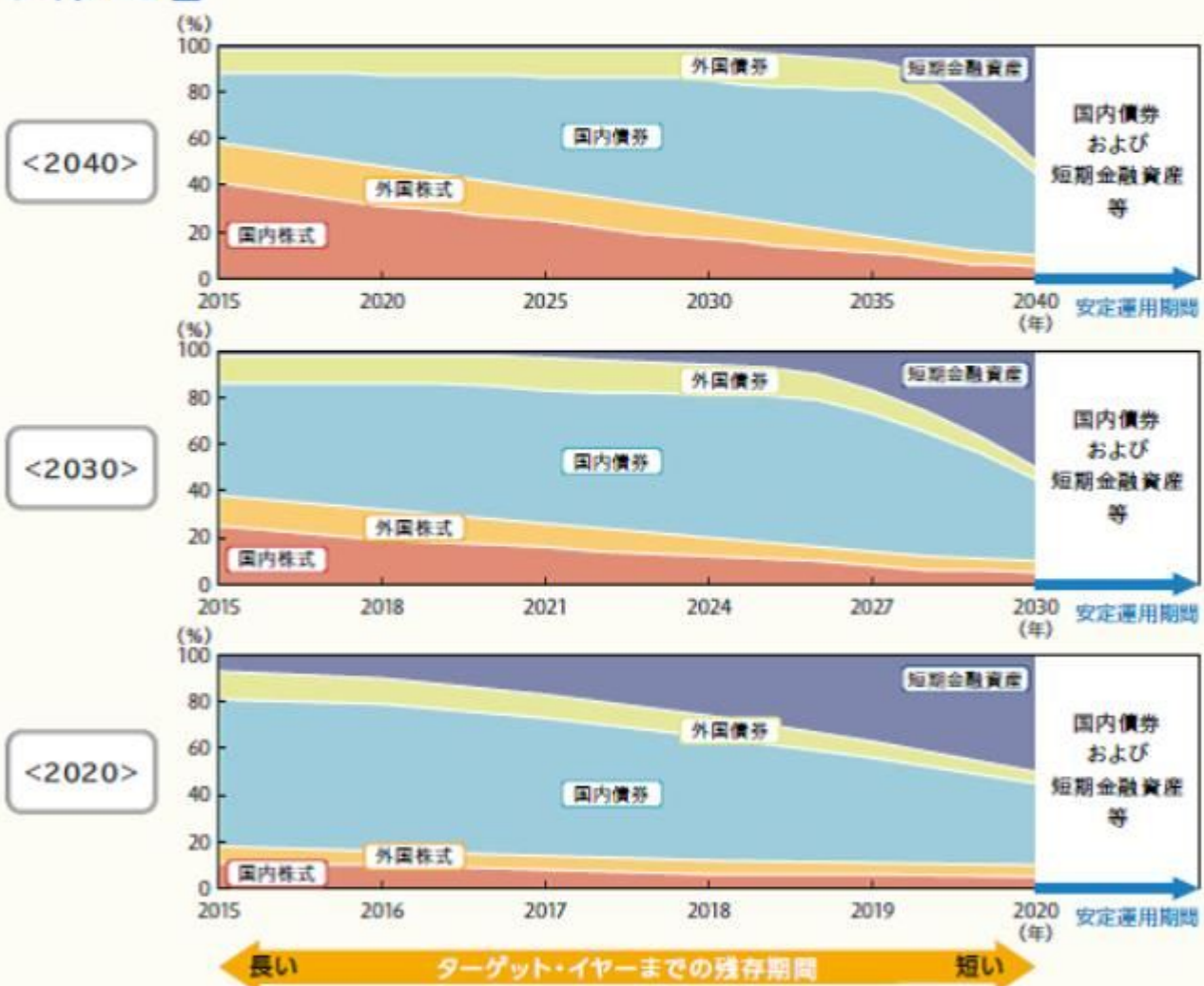
## 基本的な投資資産配分

### ▶基本アロケーション

■2019年7月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

	<2040>	<2030>	<2020>	<2010> 安定運用期間
国内株式	35%	19%	6%	5%
外国株式	17%	13%	6%	5%
国内債券	36%	54%	53%	35%
外国債券	10%	12%	9%	5%
短期金融資産	2%	2%	26%	50%

### ▶イメージ図



※上記は、各決算時点での基本資産配分を表しています。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージであり、将来、実際上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

<2010>

**安定運用期間**

(国内債券および短期金融資産等による運用)  
※ターゲット・イヤー到達(2010年12月決算時)



## 投資対象とする投資信託の運用プロセス

### ▶ SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

### ▶ SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりベンチマークから外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。

### ▶ SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法によりポートフォリオを構築します。

### ▶ SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近づけたポートフォリオを構築します。

### ▶ SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

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

※実際の運用は、各投資信託がそれぞれ投資対象とするマザーファンドで行います。



#### 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

#### 層化抽出法とは

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

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

## 追加的記載事項

■投資対象とする投資信託の投資方針等

### ▶SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

形 態	国内籍投資信託
主要投資対象	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>● 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年11月30日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.081*%(税抜き0.075%) *消費税率が10%となった場合は年0.0825%となります。
その他の費用	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、監査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。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
委託会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。



## ▶SMAM・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

形 態	国内籍投資信託
主要投資対象	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドおよび日本の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。
ベンチマーク	NOMURA-BPI(総合)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>● 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年6月20日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.054%*(税抜き0.05%) *消費税率が10%となった場合は年0.055%となります。
その他の費用	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、監査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。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%
委託会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。

## ▶ SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

形態	国内籍投資信託
主要投資対象	外国株式インデックス・マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマーク	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 株式への実質投資割合には、制限を設けません。</li> <li>● 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決算日	原則として毎年11月30日(休業日の場合は翌営業日)
信託報酬	純資産総額に対して年0.081%*(税抜き0.075%) *消費税率が10%となった場合は年0.0825%となります。
その他の費用	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、監査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。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
委託会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。



## ▶ SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

形 態	国内籍投資信託
主要投資対象	外国債券パッシブ・マザーファンド
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより、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	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ul>
決 算 日	原則として毎年12月17日(休業日の場合は翌営業日)
信 託 報 酬	純資産総額に対して年0.0648%*(税抜き0.06%) *消費税率が10%となった場合は年0.066%となります。
その他の費用	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、監査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。
申 込 手 数 料	ありません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
委 託 会 社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	三井住友信託銀行株式会社
購 入 の 可 否	日本において一般投資者は購入できません。

## ▶SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

形 態	国内籍投資信託	
主要投資対象	マネーインカム・マザーファンド	
運用の基本方針	マザーファンドへの投資を通じて、主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。	
ベンチマーク	ありません。	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
決算日	原則として毎年4月13日(休業日の場合は翌営業日)	
信託報酬	各月の最終営業日の翌日から翌月の最終営業日までの信託報酬率は、当該各月の最終5営業日における無担保コール翌日物レート(年率)の平均値(当該平均率)に応じ、次に掲げる率となります。なお、信託報酬率は月次で見直されます。	
	当該平均率の水準	信託報酬率
	当該平均値が0.25%未満の場合	当該平均値に0.4を乗じた率(下限は0%)
	当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合	年0.1%
	当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	年0.14%
	当該平均値が1.00%以上の場合	年0.18%
	(注)上記信託報酬率は税抜き	
その他の費用	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。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	一部解約時に0.01%	
委託会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	
購入の可否	日本において一般投資者は購入できません。	

## (2)【投資対象】

## イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める証券投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

#### 八 投資対象とする金融商品

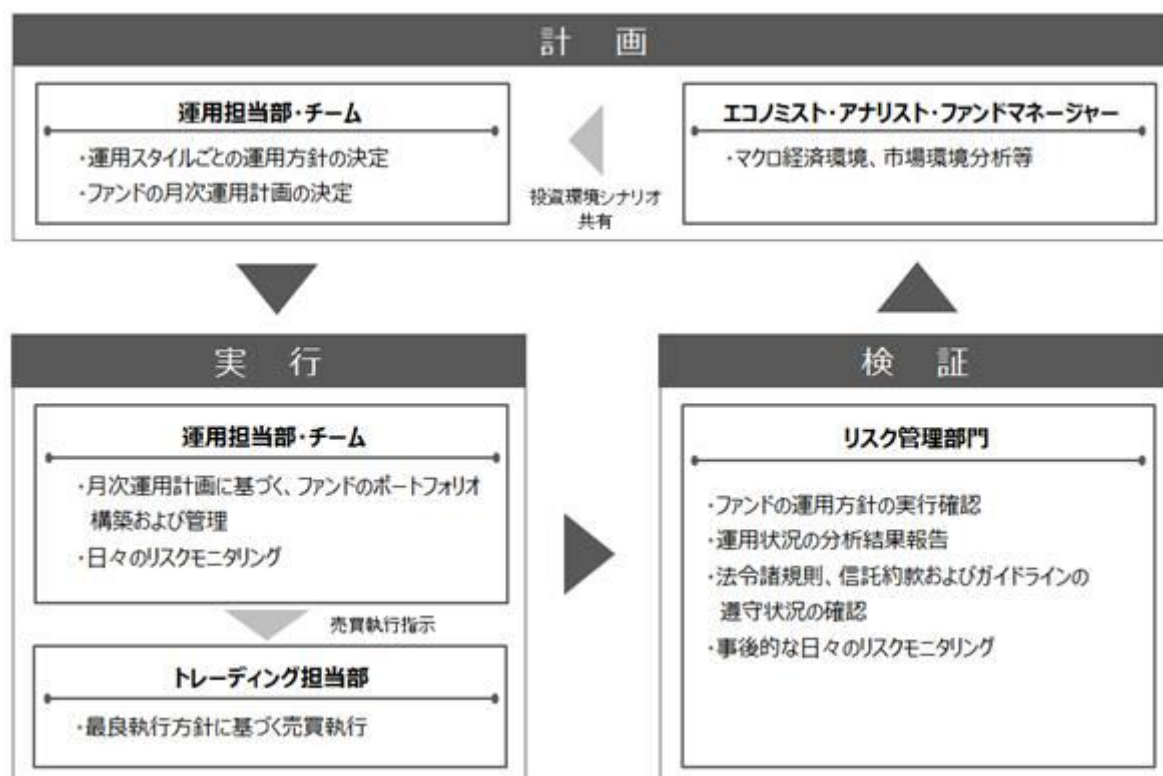
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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ファンドの名称、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。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

#### ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

### （4）【分配方針】

毎年1回（原則として12月20日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、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、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等は、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を設けず、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 投資信託証券への投資を除いては、C P、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- 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 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償還金の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。
- （二）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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。

[参考情報:投資対象とする投資信託の概要]

[S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)]

(1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社  
ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)は、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本の株式に投資し、T O P I X(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、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、T O P I X(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

マザーファンドにおいては、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、T O P I X(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

東証株価指数(T O P I X)は、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、東京証券取引所は「S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

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

## (3) その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.081%<sup>\*</sup>（税抜き0.075%）  
\*消費税率が10%となった場合は年0.0825%となります。
- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
- ニ 決算日 原則として毎年11月30日（休業日の場合は翌営業日）
- ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

## 〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## (1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券および日本の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
- (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

マザーファンドにおいては、主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA - BPI（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、NOMURA - BPI（総合）を用いて行われる委託会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## ハ 主な投資制限

- (イ) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ハ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (3) その他

- イ 信託報酬  
このファンドの信託財産の純資産総額に年0.054%<sup>\*</sup>(税抜き0.05%)を乗じて得た額  
<sup>\*</sup>消費税率が10%となった場合は年0.055%となります。
- ロ 手数料  
取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額  
取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%
- ニ 決算日  
毎年1回(原則として6月20日)
- ホ 購入の可否  
日本において一般投資者は購入できません。

[ 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) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

### (2) 投資方針等

- イ 基本方針  
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)は、外国株式インデックス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

マザーファンドにおいては、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)はM S C I インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、M S C I インクが有しています。また、M S C I インクは「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)」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

#### ハ 主な投資制限

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

### (3) その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.081%<sup>\*</sup>（税抜き0.075%）  
\*消費税率が10%となった場合は年0.0825%となります。
- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
- ニ 決算日 原則として毎年11月30日（休業日の場合は翌営業日）
- ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

〔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) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

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>は、外国債券パッシブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

マザーファンド受益証券への投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより実質的に以下の運用を行います。

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

マザーファンドにおいては、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

F T S E世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。FTSE Fixed Income LLCは「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>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

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



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

(3) その他

- イ 信託報酬 純資産総額に対して年0.0648%<sup>\*</sup>(税抜き0.06%)  
\*消費税率が10%となった場合は年0.066%となります。
- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
- ニ 決算日 原則として毎年12月17日(休業日の場合は翌営業日)
- ホ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

[S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>]

(1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

- イ 基本方針  
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、マネーインカム・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。また、市況動向によっては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に直接投資を行うことがあります。

ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

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

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

マザーファンドにおいては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ハ 主な投資制限

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

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

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に以下の率（信託報酬率）を乗じて得た額。なお、信託報酬率は月次で見直すものとし、各月の最終営業日の翌日から翌月の最終営業日までの信託報酬率は、当該各月の最終5営業日における無担保コール翌日物レート（年率）の平均値（当該平均率）に応じ、次に掲げる率とします。

当該平均率の水準	信託報酬率
当該平均値が0.25%未満の場合	当該平均値に0.4を乗じた率 （下限は0%）
当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合	年0.1%
当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	年0.14%
当該平均値が1.00%以上の場合	年0.18%

（注）上記信託報酬率は税抜き

- ロ 申込手数料 ありません。
- ハ 信託財産留保額 一部解約時に0.01%
- ニ 決算日 原則として毎年4月13日（休業日の場合は翌営業日）
- ホ ベンチマーク ありません。
- ヘ 購入の可否 日本において一般投資者は購入できません。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。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。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）信用リスク

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

## （二）為替変動リスク

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

## （ホ）カントリーリスク

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

## （ヘ）市場流動性リスク

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

## （ト）換金制限等に関する留意点

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

## （チ）収益分配金に関する留意事項

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



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

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

## ロ 投資リスクの管理体制

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### <2010>

年間騰落率：  
2014年8月～2019年7月

分配金再投資基準価額：  
2014年8月～2019年7月



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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

ファンド：  
2014年8月～2019年7月

他の資産クラス：  
2014年8月～2019年7月



#### <2020>

年間騰落率：  
2014年8月～2019年7月

分配金再投資基準価額：  
2014年8月～2019年7月



ファンド：  
2014年8月～2019年7月

他の資産クラス：  
2014年8月～2019年7月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

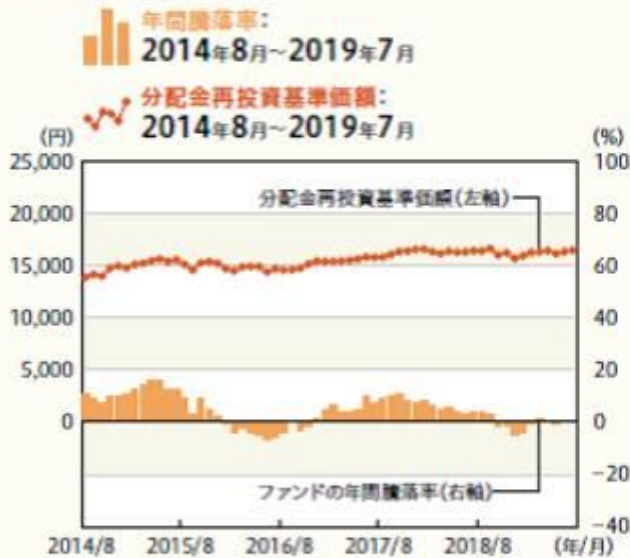
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

▶<2030>



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

## 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 【 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。

### ▶ <2040>



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## (1) 【申込手数料】

無手数料です。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.5292%<sup>\*</sup>（税抜き0.49%）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。なお、各ファンドのターゲットイヤーに属する決算日の翌日以降年0.432%<sup>\*</sup>（税抜き0.4%）となります。

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。

\*消費税率が10%となった場合はターゲットイヤーの決算日までは年0.539%、ターゲットイヤーの決算日翌日以降は年0.44%となります。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

	委託会社	販売会社	受託会社
ターゲットイヤーの 決算日まで	年0.15%	年0.3%	年0.04%
ターゲットイヤーの 決算翌日以降	年0.06%		

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	ファンド運用の指図等の対価
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の信託報酬を含めた総額は、各ファンドの基本アロケーション（2019年7月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.18%（税抜き）で計算しております。

< 2010 >	年0.559440% <sup>*</sup> （税抜き0.5180%）程度
< 2020 >	年0.623916% <sup>*</sup> （税抜き0.5777%）程度
< 2030 >	年0.595944% <sup>*</sup> （税抜き0.5518%）程度
< 2040 >	年0.601128% <sup>*</sup> （税抜き0.5566%）程度

\*消費税率が10%となった場合は、<2010>は年0.5698%、<2020>は年0.63547%、<2030>は年0.60698%、<2040>は年0.61226%となります。

## (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0.00324%<sup>\*</sup>（税抜き0.003%）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、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。

\*消費税率が10%となった場合は年0.0033%となります。

- 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等は、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、

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。

当ファンドが組み入れる他の投資信託は、その委託会社、受託会社の業務の対価として、信託報酬を支払います。また、その他、当該他の投資信託の諸経費は、その信託財産から支弁されます。この費用は、当該他の投資信託の基準価額に反映され、結果的に当ファンドがその持分にに応じて負担することになります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。

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

#### (5)【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

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

##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

##### ハ 収益分配金の課税について

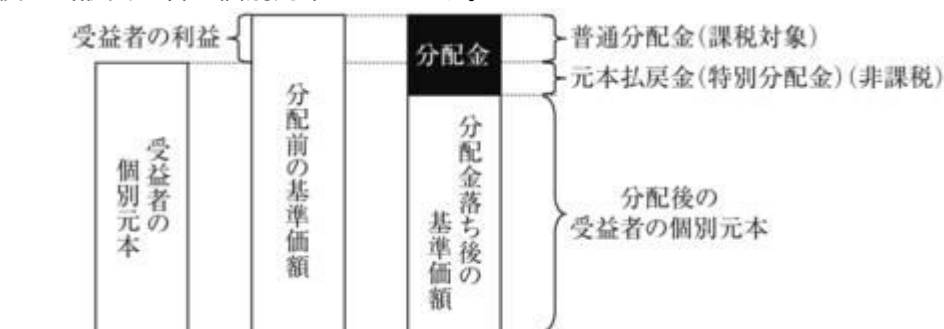
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」「(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)」の区分があります。

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





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、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

### (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、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、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。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません(約款規定なし)。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2019年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

2019年 7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	472,615,491	99.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,153,997	0.24
合計(純資産総額)		473,769,488	100.00

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

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

2019年 7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	1,329,520,796	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,342,581	0.10
合計(純資産総額)		1,330,863,377	100.00

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

2019年 7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
-------	------	-------------	-------------

投資信託受益証券	日本	1,776,414,365	99.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,508,782	0.14
合計(純資産総額)		1,778,923,147	100.00

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

2019年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	2,690,544,263	99.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,210,750	0.16
合計(純資産総額)		2,694,755,013	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

## イ 主要投資銘柄

2019年7月31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	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	235,084,564	1.0067	236,680,788	1.0064	236,589,105	49.94
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	124,758,941	1.2937	161,408,501	1.327	165,555,114	34.94
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	13,341,802	1.7376	23,183,115	1.7633	23,525,599	4.97
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	14,421,820	1.5885	22,909,767	1.6294	23,498,913	4.96
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	8,233,289	2.4933	20,528,627	2.8478	23,446,760	4.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2019年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

## イ 主要投資銘柄

2019年 7月31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	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	531,190,385	1.2937	687,252,228	1.327	704,889,640	52.96
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	343,140,715	1.0067	345,470,361	1.0064	345,336,815	25.95
日本	投資信託受益 証券	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>	67,651,952	1.7376	117,553,993	1.7633	119,290,686	8.96
日本	投資信託受益 証券	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)	28,110,520	2.4841	69,831,788	2.8478	80,053,138	6.02
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	49,067,459	1.587	77,874,164	1.6294	79,950,517	6.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030

#### イ 主要投資銘柄

2019年 7月31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	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	721,858,334	1.2947	934,622,796	1.327	957,906,009	53.85
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	208,585,596	1.5862	330,865,355	1.6294	339,869,370	19.11
日本	投資信託受益 証券	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)	81,328,659	2.4861	202,197,116	2.8478	231,607,755	13.02
日本	投資信託受益 証券	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>	120,414,236	1.7377	209,248,995	1.7633	212,326,422	11.94
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	34,484,111	1.0067	34,718,292	1.0064	34,704,809	1.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.86
合計	99.86

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

## イ 主要投資銘柄

2019年 7月31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	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	729,725,436	1.2953	945,248,284	1.327	968,345,653	35.93
日本	投資信託受益 証券	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）	578,943,670	1.5869	918,746,551	1.6294	943,330,815	35.01
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 外国株式バッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用）	160,679,824	2.4867	399,575,533	2.8478	457,584,002	16.98
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	152,455,774	1.7379	264,967,015	1.7633	268,825,266	9.98
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	52,124,928	1.0067	52,478,926	1.0064	52,458,527	1.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.84
合計	99.84

## 【投資不動産物件】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

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9期 (2009年12月21日)	301,495,735	301,495,735	10,921	10,921
第10期 (2010年12月20日)	324,751,925	324,751,925	10,941	10,941
第11期 (2011年12月20日)	329,392,588	329,392,588	10,818	10,818
第12期 (2012年12月20日)	348,417,250	348,417,250	11,198	11,198
第13期 (2013年12月20日)	406,358,497	406,358,497	11,884	11,884
第14期 (2014年12月22日)	490,170,412	490,170,412	12,303	12,303
第15期 (2015年12月21日)	524,035,669	524,035,669	12,346	12,346
第16期 (2016年12月20日)	553,177,646	553,177,646	12,457	12,457
第17期 (2017年12月20日)	527,274,484	527,274,484	12,663	12,663
第18期 (2018年12月20日)	504,406,220	504,406,220	12,491	12,491
2018年 7月末日	511,059,148		12,610	
8月末日	509,721,350		12,604	
9月末日	510,731,679		12,649	
10月末日	508,222,673		12,513	
11月末日	506,878,711		12,562	
12月末日	502,849,455		12,453	
2019年 1月末日	503,048,150		12,522	
2月末日	505,885,386		12,603	
3月末日	501,530,299		12,636	

4月末日	505,663,278		12,650	
5月末日	485,336,964		12,590	
6月末日	481,685,232		12,651	
7月末日	473,769,488		12,685	

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

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9期 (2009年12月21日)	364,838,536	364,838,536	10,782	10,782
第10期 (2010年12月20日)	460,154,017	460,154,017	10,871	10,871
第11期 (2011年12月20日)	503,354,494	503,354,494	10,466	10,466
第12期 (2012年12月20日)	605,756,824	605,756,824	11,419	11,419
第13期 (2013年12月20日)	792,418,477	792,418,477	13,210	13,210
第14期 (2014年12月22日)	1,042,332,411	1,042,332,411	14,223	14,223
第15期 (2015年12月21日)	1,219,971,427	1,219,971,427	14,395	14,395
第16期 (2016年12月20日)	1,350,077,224	1,350,077,224	14,620	14,620
第17期 (2017年12月20日)	1,407,255,564	1,407,255,564	15,080	15,080
第18期 (2018年12月20日)	1,344,375,344	1,344,375,344	14,809	14,809
2018年 7月末日	1,374,857,914		14,984	
8月末日	1,372,095,018		14,970	
9月末日	1,377,028,094		15,055	
10月末日	1,352,867,764		14,824	
11月末日	1,356,421,991		14,917	
12月末日	1,336,450,387		14,728	
2019年 1月末日	1,337,296,639		14,841	
2月末日	1,331,656,180		14,967	
3月末日	1,332,644,531		15,033	
4月末日	1,332,284,463		15,045	
5月末日	1,323,908,876		14,965	
6月末日	1,326,754,637		15,068	
7月末日	1,330,863,377		15,122	

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

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9期 (2009年12月21日)	214,049,126	214,049,126	10,168	10,168
第10期 (2010年12月20日)	266,798,732	266,798,732	10,308	10,308

第11期	(2011年12月20日)	273,003,638	273,003,638	9,525	9,525
第12期	(2012年12月20日)	367,329,083	367,329,083	10,766	10,766
第13期	(2013年12月20日)	541,345,607	541,345,607	13,445	13,445
第14期	(2014年12月22日)	773,129,050	773,129,050	14,814	14,814
第15期	(2015年12月21日)	1,197,113,384	1,197,113,384	15,141	15,141
第16期	(2016年12月20日)	1,379,800,736	1,379,800,736	15,465	15,465
第17期	(2017年12月20日)	1,688,498,803	1,688,498,803	16,512	16,512
第18期	(2018年12月20日)	1,655,096,771	1,655,096,771	15,856	15,856
	2018年 7月末日	1,712,895,516		16,405	
	8月末日	1,710,410,755		16,379	
	9月末日	1,727,868,221		16,605	
	10月末日	1,660,368,263		16,012	
	11月末日	1,685,053,233		16,199	
	12月末日	1,636,926,487		15,674	
	2019年 1月末日	1,668,045,906		15,928	
	2月末日	1,704,638,969		16,235	
	3月末日	1,719,081,498		16,294	
	4月末日	1,754,495,309		16,406	
	5月末日	1,735,487,630		16,128	
	6月末日	1,759,636,947		16,318	
	7月末日	1,778,923,147		16,441	

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

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9期	(2009年12月21日)	188,270,881	188,270,881	9,559	9,559
第10期	(2010年12月20日)	231,956,041	231,956,041	9,713	9,713
第11期	(2011年12月20日)	230,424,744	230,424,744	8,586	8,586
第12期	(2012年12月20日)	287,659,579	287,659,579	10,038	10,038
第13期	(2013年12月20日)	445,842,340	445,842,340	13,541	13,541
第14期	(2014年12月22日)	588,648,311	588,648,311	15,256	15,256
第15期	(2015年12月21日)	1,837,523,740	1,837,523,740	15,742	15,742
第16期	(2016年12月20日)	2,076,188,532	2,076,188,532	16,160	16,160
第17期	(2017年12月20日)	2,421,821,587	2,421,821,587	17,845	17,845
第18期	(2018年12月20日)	2,468,219,622	2,468,219,622	16,732	16,732
	2018年 7月末日	2,516,329,047		17,731	
	8月末日	2,534,095,552		17,676	
	9月末日	2,617,544,450		18,063	
	10月末日	2,483,689,379		17,058	
	11月末日	2,540,124,728		17,335	



12月末日	2,423,991,177		16,435
2019年 1月末日	2,502,327,864		16,816
2月末日	2,576,105,659		17,289
3月末日	2,602,577,158		17,295
4月末日	2,664,662,294		17,525
5月末日	2,599,469,264		17,015
6月末日	2,653,412,968		17,259
7月末日	2,694,755,013		17,439

## 【分配の推移】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第18期	2017年12月21日～2018年12月20日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第18期	2017年12月21日～2018年12月20日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第18期	2017年12月21日～2018年12月20日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第9期	2008年12月23日～2009年12月21日	0
第10期	2009年12月22日～2010年12月20日	0
第11期	2010年12月21日～2011年12月20日	0
第12期	2011年12月21日～2012年12月20日	0
第13期	2012年12月21日～2013年12月20日	0
第14期	2013年12月21日～2014年12月22日	0
第15期	2014年12月23日～2015年12月21日	0
第16期	2015年12月22日～2016年12月20日	0
第17期	2016年12月21日～2017年12月20日	0
第18期	2017年12月21日～2018年12月20日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

	収益率（％）
第9期	3.2
第10期	0.2
第11期	1.1
第12期	3.5
第13期	6.1
第14期	3.5
第15期	0.3
第16期	0.9

第17期	1.7
第18期	1.4
第19期(中間期)	1.3

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

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

	収益率(%)
第9期	6.5
第10期	0.8
第11期	3.7
第12期	9.1
第13期	15.7
第14期	7.7
第15期	1.2
第16期	1.6
第17期	3.1
第18期	1.8
第19期(中間期)	1.8

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

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030

	収益率(%)
第9期	9.0
第10期	1.4
第11期	7.6
第12期	13.0
第13期	24.9
第14期	10.2
第15期	2.2
第16期	2.1
第17期	6.8
第18期	4.0
第19期(中間期)	3.0

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

#### 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2040

	収益率（％）
第9期	11.2
第10期	1.6
第11期	11.6
第12期	16.9
第13期	34.9
第14期	12.7
第15期	3.2
第16期	2.7
第17期	10.4
第18期	6.2
第19期（中間期）	3.2

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	64,237,153	13,713,349
第10期	56,241,790	35,487,520
第11期	50,688,810	43,023,358
第12期	33,162,080	26,499,660
第13期	71,424,035	40,643,048
第14期	84,271,259	27,787,920
第15期	81,915,864	55,862,170
第16期	73,067,241	53,460,656
第17期	26,200,366	53,890,527
第18期	24,358,795	36,936,618
第19期（中間期）	13,002,951	33,749,034

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	95,242,920	12,283,196
第10期	111,793,677	26,894,086
第11期	87,891,359	30,227,601
第12期	85,709,743	36,186,583
第13期	124,684,453	55,291,960

第14期	174,116,846	41,116,178
第15期	173,855,110	59,244,453
第16期	133,314,585	57,348,024
第17期	90,276,024	80,540,222
第18期	53,255,891	78,624,091
第19期（中間期）	19,318,117	43,632,144

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	63,896,452	9,917,639
第10期	58,503,162	10,182,239
第11期	47,890,237	20,123,017
第12期	65,335,257	10,757,941
第13期	97,849,986	36,394,176
第14期	146,378,903	27,109,912
第15期	326,685,857	57,957,924
第16期	162,461,354	60,911,862
第17期	210,104,041	79,693,554
第18期	110,295,872	89,087,950
第19期（中間期）	59,116,020	24,875,981

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

### 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	57,723,829	17,613,224
第10期	52,737,375	10,883,373
第11期	49,611,557	20,043,137
第12期	48,930,836	30,725,942
第13期	84,609,174	41,944,386
第14期	92,910,684	36,318,727
第15期	941,205,290	159,802,718
第16期	268,656,486	151,120,292
第17期	276,886,193	204,549,164
第18期	289,306,770	171,293,472
第19期（中間期）	127,192,256	65,245,500

（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

## S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

2019年 7月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	10,862,451,529	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,580,562	0.01
合計(純資産総額)		10,860,870,967	100.00

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2019年 7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	165,798,754,690	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,198,199,681	1.31
合計(純資産総額)		167,996,954,371	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	2,283,025,000	1.35
合計	買建	-	2,283,025,000	1.35

## S M A M ・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

2019年 7月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	31,626,179,169	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,003,265	0.01
合計(純資産総額)		31,624,175,904	100.00

## 国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

2019年 7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	90,307,487,480	77.54
地方債証券	日本	8,947,846,000	7.68
特殊債券	日本	10,491,779,909	9.01
社債券	日本	5,465,285,000	4.69
	フランス	100,491,000	0.09
	オーストラリア	100,268,000	0.09
	小計	5,666,044,000	4.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,047,250,295	0.90
合計(純資産総額)		116,460,407,684	100.00

## SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

2019年 7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	5,921,295,772	99.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,410,689	0.07
合計(純資産総額)		5,925,706,461	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2019年 7月31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	118,718,567,647	63.37
	イギリス	10,891,878,497	5.81
	カナダ	6,929,533,201	3.70
	スイス	6,765,886,736	3.61
	フランス	6,734,113,690	3.59
	ドイツ	5,652,737,039	3.02
	オーストラリア	4,174,106,844	2.23
	アイルランド	3,360,099,580	1.79
	オランダ	3,304,802,816	1.76

	スペイン	1,919,201,059	1.02
	香港	1,811,298,232	0.97
	スウェーデン	1,589,973,747	0.85
	イタリア	1,247,637,845	0.67
	デンマーク	1,121,272,789	0.60
	シンガポール	831,740,189	0.44
	バミューダ	773,044,351	0.41
	フィンランド	765,849,350	0.41
	ベルギー	692,624,595	0.37
	ジャージー	640,316,220	0.34
	ケイマン諸島	439,558,280	0.23
	ノルウェー	432,426,658	0.23
	イスラエル	397,261,188	0.21
	キュラソー	258,872,601	0.14
	ルクセンブルグ	200,514,439	0.11
	ニュージーランド	173,935,639	0.09
	オーストリア	150,997,161	0.08
	ポルトガル	103,274,719	0.06
	リベリア	97,873,160	0.05
	パプアニューギニア	32,144,220	0.02
	英ヴァージン諸島	24,246,826	0.01
	マン島	19,123,993	0.01
	モーリシャス	8,688,164	0.00
	小計	180,263,601,475	96.22
投資証券	アメリカ	3,469,539,383	1.85
	オーストラリア	582,512,606	0.31
	フランス	190,606,098	0.10
	香港	148,088,582	0.08
	イギリス	109,013,732	0.06
	シンガポール	90,019,545	0.05
	カナダ	32,811,095	0.02
	小計	4,622,591,041	2.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,464,230,238	1.31
合計(純資産総額)		187,350,422,754	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	1,587,192,919	0.84
	買建	ドイツ	364,700,702	0.19
	買建	イギリス	130,214,799	0.06
	買建	オーストラリア	113,837,393	0.06
合計	買建	-	2,195,945,813	1.15

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		165,324,410	0.08
	売建		258,780,700	0.13

## 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＞

2019年 7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
親投資信託受益証券	日本	3,094,175,773	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		251,140	0.01
合計(純資産総額)		3,093,924,633	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年 7月31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	72,801,272,007	46.56
	フランス	15,585,975,622	9.97
	イタリア	13,950,596,507	8.92
	ドイツ	9,676,992,478	6.19
	イギリス	9,647,351,045	6.17
	スペイン	8,905,319,996	5.70
	ベルギー	3,891,755,444	2.49
	オーストラリア	3,099,925,902	1.98
	カナダ	2,968,952,097	1.90

	オランダ	2,902,407,667	1.86
	オーストリア	2,373,354,301	1.52
	アイルランド	1,368,552,496	0.88
	メキシコ	1,194,091,449	0.76
	フィンランド	1,062,589,072	0.68
	ポーランド	946,708,434	0.61
	南アフリカ	877,561,265	0.56
	デンマーク	817,128,726	0.52
	マレーシア	755,637,795	0.48
	シンガポール	665,671,544	0.43
	スウェーデン	538,416,510	0.34
	ノルウェー	386,163,280	0.25
	小計	154,416,423,637	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,939,967,473	1.24
合計(純資産総額)		156,356,391,110	100.00

## S M A M ・ マネーインカムファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

2019年 7月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	693,194,797	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		970	0.00
合計(純資産総額)		693,195,767	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

2019年 7月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
特殊債券	日本	1,974,274,108	76.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		593,437,660	23.11
合計(純資産総額)		2,567,711,768	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

## イ 主要投資銘柄

2019年 7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)	4,365,410,734	2.5858	11,288,079,076	2.4883	10,862,451,529	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 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)

2019年 7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	818,800	6,793.06	5,562,157,528	7,180.00	5,878,984,000	3.50
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	572,300	4,742.05	2,713,875,215	5,680.00	3,250,664,000	1.93
日本	株式	ソニー	電気機器	493,000	5,908.12	2,912,703,160	5,859.00	2,888,487,000	1.72
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,988,600	621.54	3,100,614,444	529.00	2,638,969,400	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	492,900	4,674.36	2,303,992,044	4,996.00	2,462,528,400	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	641,600	4,375.58	2,807,372,128	3,658.00	2,346,972,800	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	36,100	61,470.28	2,219,077,108	63,770.00	2,302,097,000	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	510,800	4,165.83	2,127,905,964	3,844.00	1,963,515,200	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	502,800	3,110.80	1,564,110,240	3,690.00	1,855,332,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	619,500	3,191.16	1,976,923,620	2,772.00	1,717,254,000	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	42,100	34,404.96	1,448,448,816	40,590.00	1,708,839,000	1.02

日本	株式	KDDI	情報・通信業	592,700	2,661.02	1,577,186,554	2,875.50	1,704,308,850	1.01
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,833,600	187.62	1,844,980,032	157.00	1,543,875,200	0.92
日本	株式	三菱商事	卸売業	507,500	3,063.22	1,554,584,150	2,958.50	1,501,438,750	0.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	259,000	5,591.31	1,448,149,290	5,797.00	1,501,423,000	0.89
日本	株式	花王	化学	178,400	8,353.92	1,490,339,328	8,194.00	1,461,809,600	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,800	23,330.78	1,535,165,324	22,065.00	1,451,877,000	0.86
日本	株式	信越化学工業	化学	126,900	10,077.65	1,278,853,785	11,160.00	1,416,204,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	69,800	19,290.84	1,346,500,632	19,870.00	1,386,926,000	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	100,200	12,578.07	1,260,322,614	13,670.00	1,369,734,000	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	210,300	4,151.47	873,054,141	6,244.00	1,313,113,200	0.78
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	130,600	10,308.09	1,346,236,554	10,020.00	1,308,612,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	330,600	3,281.62	1,084,903,572	3,944.00	1,303,886,400	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	88,400	15,023.20	1,328,050,880	14,735.00	1,302,574,000	0.78
日本	株式	HOYA	精密機器	148,100	6,891.11	1,020,573,391	8,464.00	1,253,518,400	0.75
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	455,800	2,621.85	1,195,039,230	2,620.00	1,194,196,000	0.71
日本	株式	資生堂	化学	146,000	7,217.74	1,053,790,040	8,178.00	1,193,988,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	82,900	11,298.60	936,653,940	14,380.00	1,192,102,000	0.71
日本	株式	キヤノン	電気機器	394,900	3,213.04	1,268,829,496	3,010.00	1,188,649,000	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	303,300	4,933.32	1,496,275,956	3,800.00	1,152,540,000	0.69

## □ 種類別・業種別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.27
		建設業	2.73
		食料品	4.01
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.25

医薬品	5.43
石油・石炭製品	0.59
ゴム製品	0.75
ガラス・土石製品	0.84
鉄鋼	0.84
非鉄金属	0.74
金属製品	0.57
機械	4.99
電気機器	13.63
輸送用機器	7.74
精密機器	2.12
その他製品	2.17
電気・ガス業	1.66
陸運業	4.62
海運業	0.17
空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	8.91
卸売業	4.90
小売業	4.58
銀行業	5.77
証券、商品先物取引業	0.71
保険業	2.33
その他金融業	1.08
不動産業	2.39
サービス業	5.17
合計	98.69

## S M A M ・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

## イ 主要投資銘柄

2019年 7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	国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド	22,059,133,131	1.4371	31,703,306,247	1.4337	31,626,179,169	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内債券(NOMURA - B P I) マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年 7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	第127回利付国債(5年)	1,225,000,000	100.57	1,232,080,500	100.49	1,231,027,000	0.100	2021/3/20	1.06
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,165,000,000	102.87	1,198,540,350	102.65	1,195,895,800	1.200	2021/6/20	1.03
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	103.00	1,133,077,000	102.81	1,130,965,000	1.100	2021/9/20	0.97
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,057,000,000	102.60	1,084,503,140	102.45	1,082,917,640	0.100	2026/6/20	0.93
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	1,050,000,000	102.64	1,077,757,400	102.59	1,077,237,000	0.100	2029/3/20	0.92
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,020,000,000	102.68	1,047,336,000	102.46	1,045,102,200	1.300	2021/3/20	0.90
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	985,000,000	102.14	1,006,098,700	101.94	1,004,128,700	1.200	2020/12/20	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	970,000,000	102.69	996,160,900	102.54	994,676,800	0.100	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	960,000,000	102.50	984,057,600	102.36	982,665,600	0.100	2026/3/20	0.84
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	955,000,000	102.81	981,873,700	102.73	981,100,150	0.100	2027/6/20	0.84
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	945,000,000	102.75	971,015,850	102.63	969,891,300	0.100	2026/12/20	0.83
日本	国債証券	第131回利付国債(5年)	955,000,000	100.93	963,967,450	100.84	963,098,400	0.100	2022/3/20	0.83
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	930,000,000	102.77	955,818,100	102.76	955,677,300	0.100	2028/6/20	0.82
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	920,000,000	102.70	944,886,000	102.67	944,600,800	0.100	2028/12/20	0.81
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	905,000,000	102.73	929,706,500	102.69	929,407,850	0.100	2028/9/20	0.80
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	900,000,000	103.23	929,097,000	103.06	927,549,000	0.600	2023/3/20	0.80
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	883,000,000	104.22	920,306,750	104.05	918,787,990	0.400	2025/9/20	0.79
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	850,000,000	104.28	886,388,500	104.08	884,688,500	0.800	2023/6/20	0.76
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	850,000,000	101.66	864,118,500	101.53	863,005,000	0.100	2023/12/20	0.74
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	850,000,000	101.47	862,529,000	101.37	861,679,000	0.100	2023/6/20	0.74
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	835,000,000	102.80	858,381,050	102.77	858,137,850	0.100	2028/3/20	0.74

日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	830,000,000	101.25	840,399,900	101.14	839,495,200	0.100	2022/12/20	0.72
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	750,000,000	101.72	762,973,000	101.61	762,127,500	0.100	2024/3/20	0.65
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	750,000,000	101.36	760,207,500	101.24	759,345,000	0.100	2023/3/20	0.65
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	595,000,000	117.86	701,308,650	117.47	698,958,400	1.200	2034/12/20	0.60
日本	国債証券	第400回利付国債(2年)	670,000,000	100.60	674,083,200	100.53	673,584,500	0.100	2021/5/1	0.58
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	540,000,000	123.17	665,150,400	122.74	662,796,000	1.700	2032/9/20	0.57
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	655,000,000	100.67	659,401,600	100.57	658,779,350	0.100	2021/6/20	0.57
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	640,000,000	102.80	657,945,600	102.68	657,177,600	0.100	2027/3/20	0.56
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	635,000,000	102.81	652,875,250	102.77	652,640,300	0.100	2027/12/20	0.56

## □ 種類別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.54
地方債証券	7.68
特殊債券	9.01
社債券	4.87
合計	99.10

## 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)

### イ 主要投資銘柄

2019年 7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	1,609,660,135	3.4603	5,569,906,966	3.6786	5,921,295,772	99.93

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.93
合計	99.93

## 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）

2019年 7月31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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	323,250	12,064.47	3,899,840,574	15,247.62	4,928,794,458	2.63
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	208,925	19,451.99	4,064,007,428	22,681.85	4,738,807,433	2.53
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,525	182,887.83	3,387,997,147	206,256.29	3,820,897,943	2.04
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	105,950	15,394.28	1,631,024,813	21,406.42	2,268,010,792	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,973	118,387.18	1,654,224,078	133,099.20	1,859,795,256	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	145,075	11,898.25	1,726,139,025	12,557.69	1,821,807,979	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,309	119,048.79	1,584,420,458	133,409.91	1,775,552,625	0.95
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	118,379	15,715.86	1,860,428,075	14,349.17	1,698,640,537	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	135,716	9,437.87	1,280,870,956	11,537.01	1,565,757,148	0.84
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	188,103	8,516.28	1,601,939,622	8,186.02	1,539,815,672	0.82
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	77,547	15,305.20	1,186,872,593	19,721.41	1,529,336,895	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	110,491	10,218.67	1,129,071,995	13,081.34	1,445,370,603	0.77
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	406,563	3,039.74	1,235,848,740	3,355.88	1,364,380,543	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	57,917	23,430.38	1,357,017,828	22,576.47	1,307,561,899	0.70
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	80,104	12,580.51	1,007,749,333	15,745.19	1,261,253,116	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	40,445	21,821.43	882,567,753	30,219.30	1,222,219,686	0.65



アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	324,288	3,326.55	1,078,762,452	3,713.31	1,204,183,560	0.64
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	195,046	5,164.74	1,007,362,970	6,134.90	1,196,587,861	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	42,708	30,273.62	1,292,925,866	27,695.59	1,182,823,480	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	50,063	19,294.46	965,938,751	23,613.99	1,182,187,201	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	84,596	12,899.91	1,091,281,091	13,508.29	1,142,747,944	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	183,214	6,429.31	1,177,940,555	6,152.28	1,127,184,414	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	199,254	5,181.04	1,032,343,263	5,616.68	1,119,147,551	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	178,977	5,325.53	953,147,884	5,836.14	1,044,534,972	0.56
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	247,189	4,911.61	1,214,097,052	4,214.14	1,041,690,437	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	115,002	8,480.43	975,267,377	9,046.45	1,040,360,165	0.56
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	192,595	5,793.77	1,115,851,364	5,274.47	1,015,836,935	0.54
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・ 娯楽	200,119	4,280.41	856,592,569	4,788.85	958,340,113	0.51
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	96,061	8,761.94	841,680,766	9,956.90	956,469,790	0.51
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	31,274	28,097.46	878,720,083	29,221.09	913,860,650	0.49

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.72
		素材	4.33
		資本財	6.89
		商業・専門サービス	1.26
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	1.08
		耐久消費財・アパレル	1.86
		消費者サービス	1.94
		メディア・娯楽	6.02
		小売	4.81
		食品・生活必需品小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	4.96
		家庭用品・パーソナル用品	2.15
		ヘルスケア機器・サービス	4.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.68
		銀行	7.77
		各種金融	4.25
		保険	3.86
		不動産	0.84
		ソフトウェア・サービス	9.63
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29		
電気通信サービス	2.31		
公益事業	3.39		
半導体・半導体製造装置	3.04		
投資証券			2.47
合計			98.68

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;

イ 主要投資銘柄

2019年 7月31日現在

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

日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,736,934,868	1.7540	3,046,583,759	1.7814	3,094,175,773	100.01
----	-----------	------------------	---------------	--------	---------------	--------	---------------	--------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 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)

2019年 7月31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 2.25	7,600,000	10,888.03	827,490,423	11,080.43	842,112,778	2.250	2026/3/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,900,000	11,038.04	761,624,869	11,395.31	786,276,905	2.625	2029/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	6,700,000	10,846.61	726,723,379	11,611.74	777,987,170	2.875	2028/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	10,867.39	673,778,490	11,268.85	698,668,935	2.750	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,541.47	664,112,925	11,069.39	697,372,042	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,100,000	10,872.48	663,221,737	11,250.18	686,261,059	2.750	2023/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	11,217.09	639,374,219	11,850.24	675,464,107	3.125	2028/11/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,482.26	674,113,315	13,365.80	668,290,136	3.000	2022/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,800,000	10,905.32	632,508,700	11,321.47	656,645,625	2.625	2025/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,370.77	627,432,123	10,647.56	644,177,912	1.625	2026/5/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	19,371.00	561,759,278	22,207.34	644,012,870	4.500	2041/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,714.62	610,733,340	11,185.67	637,583,549	2.500	2024/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,630.42	595,303,744	11,130.50	623,308,420	2.375	2024/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,600,000	10,330.57	578,512,346	11,064.30	619,601,080	2.250	2027/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,416.70	593,752,402	10,828.35	617,216,092	1.750	2023/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	10,838.53	596,119,562	10,956.51	602,608,259	2.625	2020/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,544.02	579,921,172	10,925.95	600,927,734	2.000	2023/2/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000	19,623.08	549,446,375	21,236.48	594,621,644	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,300,000	10,744.44	569,455,657	10,871.63	576,196,856	2.000	2020/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,388.70	540,212,400	11,077.03	576,005,887	2.250	2027/2/15	0.37

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	10,856.36	553,674,426	11,291.77	575,880,270	2.750	2024/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,352.20	538,314,597	11,069.39	575,608,670	2.250	2027/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,727.11	557,809,907	11,052.42	574,725,970	2.250	2024/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,000,000	10,829.20	541,460,065	11,377.49	568,874,690	2.750	2025/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	11,066.00	553,300,125	11,144.08	557,204,375	3.625	2021/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	10,743.47	537,173,875	11,143.23	557,161,940	2.500	2023/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	10,743.47	515,686,920	11,489.52	551,497,382	2.750	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,900,000	10,868.34	532,548,935	11,221.32	549,844,866	2.750	2023/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	10,518.52	515,407,715	11,176.34	547,640,660	2.375	2027/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,000,000	10,820.88	541,044,244	10,943.78	547,189,125	2.375	2021/3/15	0.35

## □ 種類別の投資比率

2019年 7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.76
合計	98.76

## S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >

### イ 主要投資銘柄

2019年 7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	マネーインカム・マザーファンド	686,399,443	1.0098	693,194,797	1.0099	693,194,797	100.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄

2019年 7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	特殊債券	第9 1回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	300,000,000	100.67	302,034,000	100.31	300,954,000	1.200	2019/10/31	11.72
日本	特殊債券	第3 回政府保証地 方公共団体金融機 構債券	300,000,000	100.52	301,560,000	100.07	300,213,000	1.500	2019/8/16	11.69
日本	特殊債券	第1 1 2回政府保 証日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	200,000,000	101.24	202,482,000	101.15	202,304,000	1.100	2020/7/31	7.88
日本	特殊債券	第9 3回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	201,000,000	100.90	202,813,020	100.48	201,972,840	1.400	2019/11/29	7.87
日本	特殊債券	第1 0回政府保証 地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	101.22	101,226,000	100.83	100,839,000	1.300	2020/3/13	3.93
日本	特殊債券	第9 8回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	101.07	101,072,000	100.68	100,684,000	1.300	2020/1/31	3.92
日本	特殊債券	第8 回政府保証地 方公共団体金融機 構債券	100,000,000	101.03	101,031,000	100.64	100,643,000	1.300	2020/1/20	3.92
日本	特殊債券	第9 5回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	100.87	100,873,000	100.51	100,513,000	1.200	2019/12/27	3.91
日本	特殊債券	第6 回政府保証株 式会社日本政策投 資銀行社債	100,000,000	100.83	100,835,000	100.47	100,475,000	1.200	2019/12/16	3.91
日本	特殊債券	第8 9回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	100.61	100,619,000	100.22	100,229,000	1.300	2019/9/30	3.90
日本	特殊債券	第1 4回政府保証 地方公共団体金融 機構債券（6年）	100,000,000	100.26	100,264,000	100.22	100,220,000	0.199	2020/6/18	3.90
日本	特殊債券	第2 0 3回政府保 証預金保険機構債	100,000,000	100.10	100,109,000	100.07	100,070,000	0.100	2020/1/17	3.90
日本	特殊債券	第8 5回政府保証 日本高速道路保 有・債務返済機構 債券	100,000,000	100.42	100,423,000	100.00	100,003,000	1.400	2019/7/31	3.89
日本	特殊債券	第5 回政府保証阪 神高速道路株式 社債券	64,600,000	101.24	65,404,270	100.85	65,154,268	1.300	2020/3/18	2.54

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年 7月30日現在

種類	投資比率 (%)
特殊債券	76.89
合計	76.89

投資不動産物件

## S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞

該当事項はありません。

## 国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

該当事項はありません。

## 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）

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。

## 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＞

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。

## S M A M ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

該当事項はありません。

## マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年 7月30日現在

種類	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	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	145	日本円	2,262,940,400	2,283,025,000	1.35

（注）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。

## S M A M ・ 年 金 国 内 債 券 パ ッ シ ブ フ ァ ン ド &lt; 適 格 機 関 投 資 家 限 定 &gt;

該当事項はありません。

## 国内債券 ( N O M U R A - B P I ) マ ザ ー フ ァ ン ド

該当事項はありません。

## 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 )

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

2019年 7月31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	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1909	買建	97	米ドル	14,532,316	1,578,790,810	14,609,655	1,587,192,919	0.84
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1909	買建	87	ユーロ	3,043,064	368,788,925	3,009,330	364,700,702	0.19
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1909	買建	9	オースト ラリアド ル	1,491,890.5	111,280,112	1,526,175	113,837,393	0.06
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1909	買建	13	英ポンド	972,261	128,309,284	986,700	130,214,799	0.06

(注) 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。

2019年 7月31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	米ドル	買建	1,100,000.00	119,757,000	119,493,000	0.06
	カナダドル	買建	80,000.00	6,617,200	6,612,800	0.00
	ユーロ	買建	160,000.00	19,408,800	19,390,400	0.01
	英ポンド	買建	50,000.00	6,646,750	6,598,000	0.00
	スイスフラン	買建	60,000.00	6,586,200	6,583,800	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	150,000.00	1,721,250	1,702,500	0.00
	ノルウェークローネ	買建	40,000.00	500,680	495,600	0.00
	デンマーククローネ	買建	70,000.00	1,137,150	1,136,100	0.00
	ニュージーランドドル	買建	7,000.00	505,400	502,810	0.00

香港ドル	買建	180,000.00	2,505,960	2,498,400	0.00
イスラエルシェケル	買建	10,000.00	310,000	311,000	0.00
米ドル	売建	1,700,000.00	184,603,000	184,654,000	0.09
カナダドル	売建	110,000.00	9,091,500	9,092,600	0.00
ユーロ	売建	240,000.00	29,078,400	29,085,600	0.01
英ポンド	売建	110,000.00	14,516,700	14,515,600	0.00
スイスフラン	売建	70,000.00	7,681,100	7,681,100	0.00
スウェーデンクローナ	売建	200,000.00	2,270,600	2,270,000	0.00
ノルウェークローネ	売建	50,000.00	620,000	619,500	0.00
デンマーククローネ	売建	90,000.00	1,460,250	1,460,700	0.00
香港ドル	売建	290,000.00	4,025,780	4,025,200	0.00
シンガポールドル	売建	60,000.00	4,754,100	4,754,400	0.00
イスラエルシェケル	売建	20,000.00	622,600	622,000	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。

#### 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>

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。

#### S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報



基準日:2019年7月31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

### <2010>



## 分配の推移

決算期	分配金
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12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。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

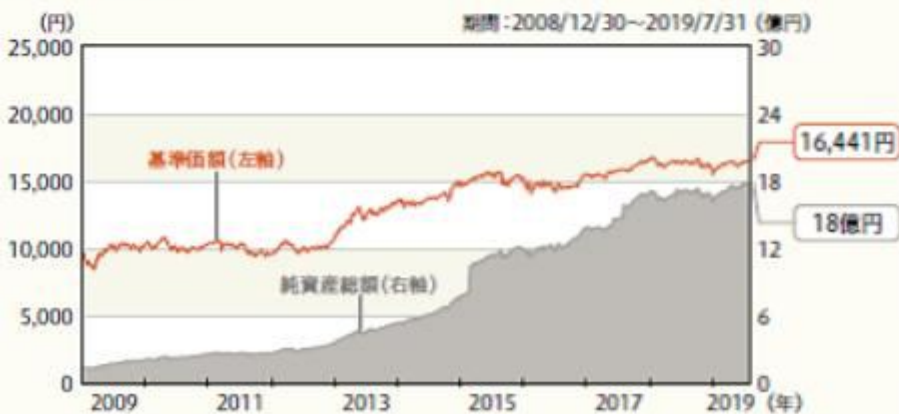
### <2020>



決算期	分配金
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12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。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

### <2030>



決算期	分配金
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12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。  
 ※最近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## ▶&lt;2040&gt;



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

## ▶&lt;2010&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.24
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	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	49.94
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	34.94
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	4.97
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	4.96
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	4.95

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ▶&lt;2020&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.10
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	52.96
日本	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド 〈適格機関投資家限定〉	25.95
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	8.96
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	6.02
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	6.01

## ▶&lt;2030&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.14
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	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	53.85
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	19.11
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	13.02
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	11.94
日本	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド 〈適格機関投資家限定〉	1.95

## ▶&lt;2040&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	日本	99.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.16
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	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブファンド 〈適格機関投資家限定〉	35.93
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	35.01
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	16.98
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド 〈適格機関投資家限定〉	9.98
日本	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド 〈適格機関投資家限定〉	1.95

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。



## ▶ 投資対象とする投資信託の現況

### ■ SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) (2019年7月30日現在)

#### 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(B号)	100.01

「国内株式インデックス・マザー・ファンド(B号)」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

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	3.50
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.93
日本	株式	ソニー	電気機器	1.72
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.37
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.02

### ■ SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> (2019年7月30日現在)

#### 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	国内債券(NOMURA-BPI)マザー・ファンド	100.01

「国内債券(NOMURA-BPI)マザー・ファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	0.100	2021/03/20	1.06
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	1.03
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1.100	2021/09/20	0.97
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	0.100	2026/06/20	0.93
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	0.100	2029/03/20	0.92
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	0.90
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.85
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	0.100	2026/03/20	0.84
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	0.100	2027/06/20	0.84

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託のマザー・ファンドのそれぞれの純資産総額に対する持分の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) (2019年7月31日現在)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	99.93

「外国株式インデックス・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.63
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	2.53
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.04
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.97
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	0.95
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.84
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.82

■SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> (2019年7月31日現在)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.01

「外国債券パッシブ・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

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 2.25	2.250	2026/03/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/08/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	3.125	2028/11/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2025/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/05/15	0.41

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託の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。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。



## ■SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> (2019年7月30日現在)

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	100.00

「マネーインカム・マザーファンド」が投資している有価証券の上位10銘柄は以下の通りです。

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2019/10/31	11.72
日本	特殊債券	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.500	2019/08/16	11.69
日本	特殊債券	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.100	2020/07/31	7.88
日本	特殊債券	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2019/11/29	7.87
日本	特殊債券	第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.300	2020/03/13	3.93
日本	特殊債券	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2020/01/31	3.92
日本	特殊債券	第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.300	2020/01/20	3.92
日本	特殊債券	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2019/12/27	3.91
日本	特殊債券	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.200	2019/12/16	3.91
日本	特殊債券	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2019/09/30	3.90

※比率は、投資対象とする投資信託、当該投資信託の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。

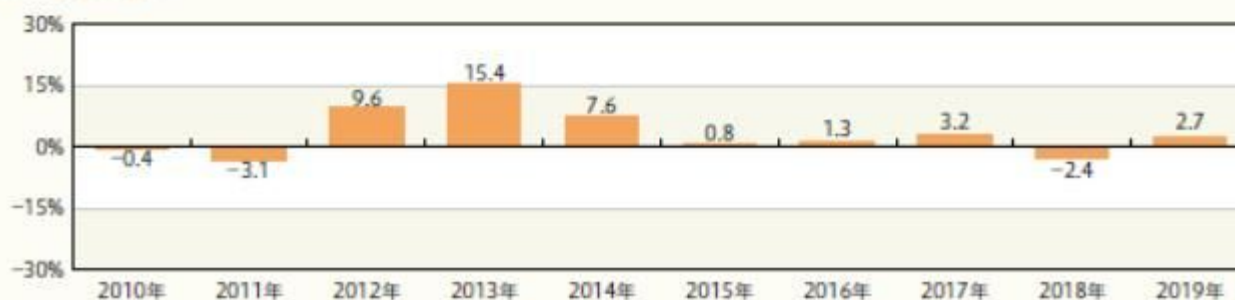
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### <2010>



### <2020>



※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年7月31日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## ▶&lt;2030&gt;



## ▶&lt;2040&gt;



※2019年のファンドの取益率は、年初から2019年7月31日までの騰落率を表示しています。  
 ※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## イ 申込方法

（イ）当ファンドの募集は、確定拠出年金および変額保険・変額年金の特別勘定による取得の申込みのみを対象とします。

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。

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。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

## 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。

#### 八 申込手数料

無手数料です。

#### 二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

申込単位の詳細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	電話番号	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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して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。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

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

## ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「TY2010」、「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」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	電話番号	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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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】

2001年3月13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12月21日から翌年12月20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、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異

議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
  - e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  - f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
  - 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、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
  - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)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。

## 八 信託約款の変更

- (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ができるものとし、あらかじめ、変更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)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

## 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

## ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の

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

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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。

#### 二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、委託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

#### 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18期(平成29年12月21日から平成30年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 (平成29年12月20日現在)	第18期 (平成30年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	125,328	3,122,396
コール・ローン	3,678,556	-
投資信託受益証券	525,808,626	503,348,203
未収入金	920,000	130,000
流動資産合計	530,532,510	506,600,599
資産合計	530,532,510	506,600,599
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	300,000	960,000
未払解約金	1,790,358	121,171
未払受託者報酬	115,911	110,506
未払委託者報酬	1,043,123	994,412
未払利息	10	-
その他未払費用	8,624	8,290
流動負債合計	3,258,026	2,194,379
負債合計	3,258,026	2,194,379
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	416,378,200	403,800,377
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	110,896,284	100,605,843
元本等合計	527,274,484	504,406,220
純資産合計	527,274,484	504,406,220
負債純資産合計	530,532,510	506,600,599

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自 至	平成28年12月21日 平成29年12月20日	自 至	平成29年12月21日 平成30年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		11,131,321		4,780,423
営業収益合計		11,131,321		4,780,423
営業費用				
支払利息		1,564		852
受託者報酬		232,879		222,294
委託者報酬		2,095,807		2,000,392
その他費用		17,543		17,340
営業費用合計		2,347,793		2,240,878
営業利益又は営業損失（ ）		8,783,528		7,021,301
経常利益又は経常損失（ ）		8,783,528		7,021,301
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,783,528		7,021,301
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		296,709		200,652
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		109,109,285		110,896,284
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,543,377		6,365,172
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,543,377		6,365,172
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,243,197		9,834,964
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,243,197		9,834,964
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（ ）		110,896,284		100,605,843

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第18期
	自平成29年12月21日 至平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期
	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	416,378,200口	403,800,377口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2663円 (10,000口当たりの純資産額 12,663円)	1口当たり純資産額 1.2491円 (10,000口当たりの純資産額 12,491円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期	第18期
	自平成28年12月21日 至平成29年12月20日	自平成29年12月21日 至平成30年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（8,486,936円）、収益調整金（67,303,293円）、および分配準備積立金（35,106,055円）より、分配対象収益は110,896,284円（1万口当たり2,663.33円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（63,161,585円）、および分配準備積立金（39,834,999円）より、分配対象収益は102,996,584円（1万口当たり2,550.66円）ですが、分配を行っておりません。</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	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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>

項目	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
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	第18期 (平成30年12月20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17期（自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	9,835,541円
合計	9,835,541円

第18期（自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	4,798,971円
合計	4,798,971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18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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17期 （平成29年12月20日現在）	第18期 （平成30年12月20日現在）
期首元本額	444,068,361円	416,378,200円
期中追加設定元本額	26,200,366円	24,358,795円
期中一部解約元本額	53,890,527円	36,936,618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

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	15,119,229	23,977,585	
	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）	9,568,521	23,668,693	
	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＞	14,519,980	25,229,917	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	137,051,622	177,262,567	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	251,499,247	253,209,441	
合計		427,758,599	503,348,203	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 (平成29年12月20日現在)	第18期 (平成30年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	289,263	6,766,487
コール・ローン	8,490,269	-
投資信託受益証券	1,402,764,356	1,342,919,968
未収入金	2,110,000	-
流動資産合計	1,413,653,888	1,349,686,455
資産合計	1,413,653,888	1,349,686,455
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	630,000	1,660,000
未払解約金	2,087,466	-
未払受託者報酬	298,663	296,238
未払委託者報酬	3,359,832	3,332,612
未払利息	23	-
その他未払費用	22,340	22,261
流動負債合計	6,398,324	5,311,111
負債合計	6,398,324	5,311,111
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	933,173,385	907,805,185
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	474,082,179	436,570,159
元本等合計	1,407,255,564	1,344,375,344
純資産合計	1,407,255,564	1,344,375,344
負債純資産合計	1,413,653,888	1,349,686,455

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第17期		第18期	
	自	平成28年12月21日 至 平成29年12月20日	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		49,519,245		17,544,388
営業収益合計		49,519,245		17,544,388
営業費用				
支払利息		3,562		1,946
受託者報酬		585,267		595,199
委託者報酬		6,584,049		6,695,885
その他費用		44,199		46,010
営業費用合計		7,217,077		7,339,040
営業利益又は営業損失 ( )		42,302,168		24,883,428
経常利益又は経常損失 ( )		42,302,168		24,883,428
当期純利益又は当期純損失 ( )		42,302,168		24,883,428
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 ( )		468,514		813,045
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		426,639,641		474,082,179
剰余金増加額又は欠損金減少額		42,834,537		26,481,720
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		42,834,537		26,481,720
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,225,653		39,923,357
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,225,653		39,923,357
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 ( )		474,082,179		436,570,159

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第18期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第17期	第18期
	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	933,173,385口	907,805,185口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5080円 (10,000口当たりの純資産額 15,080円)	1口当たり純資産額 1.4809円 (10,000口当たりの純資産額 14,809円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第17期	第18期
	自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（41,833,781円）、収益調整金（335,299,167円）、および分配準備積立金（169,418,732円）より、分配対象収益は546,551,680円（1万口当たり5,856.89円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（337,740,872円）、および分配準備積立金（193,952,714円）より、分配対象収益は531,693,586円（1万口当たり5,856.90円）ですが、分配を行っておりません。</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	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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>



項目	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
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	第18期 (平成30年12月20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17期（自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	45,711,721円
合計	45,711,721円

第18期（自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	17,603,033円
合計	17,603,033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18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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17期 (平成29年12月20日現在)	第18期 (平成30年12月20日現在)
期首元本額	923,437,583円	933,173,385円
期中追加設定元本額	90,276,024円	53,255,891円
期中一部解約元本額	80,540,222円	78,624,091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

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	64,986,055	103,061,384	
	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）	30,600,023	75,692,216	
	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＞	76,268,009	132,523,292	
	S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	619,591,738	801,379,953	
	S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	228,707,910	230,263,123	
合計		1,020,153,735	1,342,919,968	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 (平成29年12月20日現在)	第18期 (平成30年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	269,548	9,964,494
コール・ローン	7,911,608	-
投資信託受益証券	1,685,425,164	1,653,876,452
未収入金	2,660,000	-
流動資産合計	1,696,266,320	1,663,840,946
資産合計		
	1,696,266,320	1,663,840,946
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	320,000	3,860,000
未払解約金	3,191,849	357,420
未払受託者報酬	345,297	367,278
未払委託者報酬	3,884,504	4,131,826
未払利息	21	-
その他未払費用	25,846	27,651
流動負債合計	7,767,517	8,744,175
負債合計		
	7,767,517	8,744,175
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,022,593,212	1,043,801,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	665,905,591	611,295,637
元本等合計	1,688,498,803	1,655,096,771
純資産合計		
	1,688,498,803	1,655,096,771
負債純資産合計		
	1,696,266,320	1,663,840,946

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自 至	平成28年12月21日 平成29年12月20日	自 至	平成29年12月21日 平成30年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		110,604,529		58,671,730
営業収益合計		110,604,529		58,671,730
営業費用				
支払利息		5,093		2,426
受託者報酬		644,589		727,024
委託者報酬		7,251,525		8,178,936
その他費用		48,980		56,917
営業費用合計		7,950,187		8,965,303
営業利益又は営業損失（ ）		102,654,342		67,637,033
経常利益又は経常損失（ ）		102,654,342		67,637,033
当期純利益又は当期純損失（ ）		102,654,342		67,637,033
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（ ）		2,625,964		1,272,885
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		487,618,011		665,905,591
剰余金増加額又は欠損金減少額		122,003,774		69,700,159
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		122,003,774		69,700,159
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,744,572		57,945,965
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,744,572		57,945,965
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（ ）		665,905,591		611,295,637

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第18期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第17期	第18期
	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,022,593,212口	1,043,801,134口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6512円 (10,000口当たりの純資産額 16,512円)	1口当たり純資産額 1.5856円 (10,000口当たりの純資産額 15,856円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第17期	第18期
	自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（100,029,640円）、収益調整金（567,850,852円）、および分配準備積立金（169,198,889円）より、分配対象収益は837,079,381円（1万口当たり8,185.82円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（607,504,519円）、および分配準備積立金（246,934,463円）より、分配対象収益は854,438,982円（1万口当たり8,185.82円）ですが、分配を行っておりません。</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	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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>

項目	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
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	第18期 (平成30年12月20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17期（自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	106,059,684円
合計	106,059,684円

第18期（自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	59,616,877円
合計	59,616,877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18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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17期 （平成29年12月20日現在）	第18期 （平成30年12月20日現在）
期首元本額	892,182,725円	1,022,593,212円
期中追加設定元本額	210,104,041円	110,295,872円
期中一部解約元本額	79,693,554円	89,087,950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

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	213,055,545	337,884,788	
	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）	82,684,546	204,528,492	
	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＞	116,064,681	201,673,989	
	S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	677,463,191	876,230,891	
	S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	33,331,637	33,558,292	
合計		1,122,599,600	1,653,876,452	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 （平成29年12月20日現在）	第18期 （平成30年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	360,872	18,681,111
コール・ローン	10,592,107	-
投資信託受益証券	2,417,152,729	2,467,441,681
未収入金	16,630,000	-
流動資産合計	2,444,735,708	2,486,122,792
資産合計	2,444,735,708	2,486,122,792
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	70,000	10,000,000
未払解約金	16,585,482	1,164,392
未払受託者報酬	507,809	546,738
未払委託者報酬	5,712,765	6,150,716
未払利息	28	-
その他未払費用	38,037	41,324
流動負債合計	22,914,121	17,903,170
負債合計	22,914,121	17,903,170
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,357,113,281	1,475,126,579
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,064,708,306	993,093,043
元本等合計	2,421,821,587	2,468,219,622
純資産合計	2,421,821,587	2,468,219,622
負債純資産合計	2,444,735,708	2,486,122,792

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第17期		第18期	
	自	平成28年12月21日 至 平成29年12月20日	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		241,735,162		147,241,048
営業収益合計		241,735,162		147,241,048
営業費用				
支払利息		7,607		6,264
受託者報酬		963,215		1,071,376
委託者報酬		10,835,996		12,052,809
その他費用		73,100		84,540
営業費用合計		11,879,918		13,214,989
営業利益又は営業損失 ( )		229,855,244		160,456,037
経常利益又は経常損失 ( )		229,855,244		160,456,037
当期純利益又は当期純損失 ( )		229,855,244		160,456,037
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 ( )		13,865,873		3,113,129
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		791,412,280		1,064,708,306
剰余金増加額又は欠損金減少額		183,983,114		219,875,835
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		183,983,114		219,875,835
剰余金減少額又は欠損金増加額		126,676,459		134,148,190
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		126,676,459		134,148,190
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 ( )		1,064,708,306		993,093,043

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第18期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第17期	第18期
	( 平成29年12月20日現在 )	( 平成30年12月20日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,357,113,281口	1,475,126,579口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7845円 (10,000口当たりの純資産額 17,845円)	1口当たり純資産額 1.6732円 (10,000口当たりの純資産額 16,732円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第17期	第18期
	自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（215,990,766円）、収益調整金（933,308,847円）、および分配準備積立金（174,575,584円）より、分配対象収益は1,323,875,197円（1万口当たり9,755.06円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（1,093,336,856円）、および分配準備積立金（345,660,765円）より、分配対象収益は1,438,997,621円（1万口当たり9,755.06円）であります。分配を行っておりません。</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	第18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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>

項目	第18期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日
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	第18期
	(平成30年12月20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17期（自 平成28年12月21日 至 平成29年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	226,305,839円
合計	226,305,839円

第18期（自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	147,821,428円
合計	147,821,428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18期 自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20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17期 （平成29年12月20日現在）	第18期 （平成30年12月20日現在）
期首元本額	1,284,776,252円	1,357,113,281円
期中追加設定元本額	276,886,193円	289,306,770円
期中一部解約元本額	204,549,164円	171,293,472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

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	563,134,145	893,074,440	
	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）	161,711,139	400,008,673	
	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＞	148,215,338	257,538,971	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	669,383,442	865,780,543	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	50,694,333	51,039,054	
合計		1,593,138,397	2,467,441,681	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



該当事項はありません。

（参考）

「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

貸借対照表

（単位：円）		
	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	9,006	19,263
コール・ローン	11,136	-
親投資信託受益証券	22,353,350,475	14,160,815,080
未収入金	91,499,992	-
流動資産合計	22,444,870,609	14,160,834,343
資産合計	22,444,870,609	14,160,834,343
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	91,499,992	-
未払受託者報酬	504,777	332,470
未払委託者報酬	441,677	290,903
その他未払費用	33,858	33,873
流動負債合計	92,480,304	657,246
負債合計	92,480,304	657,246
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,354,563,473	8,929,006,061
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,997,826,832	5,231,171,036
元本等合計	22,352,390,305	14,160,177,097
純資産合計	22,352,390,305	14,160,177,097
負債純資産合計	22,444,870,609	14,160,834,343

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19日

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	12,354,563,473口	8,929,006,061口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8092円 (10,000口当たりの純資産額 18,092円)	1口当たり純資産額 1.5859円 (10,000口当たりの純資産額 15,859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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19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、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。</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</p>

	<p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19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	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
期首元本額	12,642,159,522円	9,088,389,450円
期中追加設定元本額	7,454,259円	28,370,757円
期中一部解約元本額	295,050,308円	187,754,146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
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）	5,850,126,035	14,160,815,080	

合計	5,850,126,035	14,160,815,080	
----	---------------	----------------	--

## 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)

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### 貸借対照表

	(単位:円)	
	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	855,295,981	3,062,350,265
コール・ローン	1,057,646,672	-
株式	192,479,364,690	159,635,332,250
派生商品評価勘定	19,028,600	-
未収配当金	20,524,236	22,968,850
前払金	-	69,820,000
流動資産合計	194,431,860,179	162,790,471,365
資産合計	194,431,860,179	162,790,471,365
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	70,027,360
前受金	19,115,000	-
未払金	4,000,000	11,893,640
未払解約金	465,836,391	22,692,957
未払利息	2,930	-
その他未払費用	298	73,005
流動負債合計	488,954,619	104,686,962
負債合計	488,954,619	104,686,962
純資産の部		
元本等		
元本	70,289,619,191	67,208,910,457
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	123,653,286,369	95,476,873,946
元本等合計	193,942,905,560	162,685,784,403
純資産合計	193,942,905,560	162,685,784,403
負債純資産合計	194,431,860,179	162,790,471,365

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年12月19日現在)		(平成30年12月19日現在)	
	1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。		代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	株式	3,597,000,000円	株式	2,704,800,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		70,289,619,191口		67,208,910,457口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.7592円	1口当たり純資産額	2.4206円
	(10,000口当たりの純資産額)	27,592円)	(10,000口当たりの純資産額)	24,206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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19日	

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19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)

(平成29年12月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600
	東証株価指数先物	1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600
合計		1,430,171,400	-	1,449,200,000	19,028,600

(平成30年12月19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	3,052,747,360	-	2,982,720,000	70,027,360
	東証株価指数先物	3,052,747,360	-	2,982,720,000	70,027,360
合計		3,052,747,360	-	2,982,720,000	70,027,360

(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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月19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 )

( 平成29年12月19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	70,854,907,568円
同期中における追加設定元本額	306,646,867円
同期中における一部解約元本額	871,935,244円
平成29年12月19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	9,676,304,803円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	600,486,139円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,937,217,581円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,156,540,102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）	146,762,753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）	7,072,256円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	21,737,956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）	56,441,195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）	61,994,231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）	34,583,133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）	94,966,318円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,262,957,310円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	3,690,380,701円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	548,727,701円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	864,332,146円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	862,831,156円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,694,364円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	94,840円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	692,220円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	3,487,601円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	11,817,760円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	16,414,139円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,033,149円

S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,101,388,256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 >	33,724,963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 >	3,520,857,711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 >	4,159,285,270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 >	2,681,966,323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 >	9,873,397,374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 >	59,777,193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 >	241,856,957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 >	1,596,008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 >	1,083,328,933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 >	64,742,845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 >	405,784,462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 >	1,167,685,548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 >	1,413,157,790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 >	3,463,405,708円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	85,304,164円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,511,993,306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 >	74,496,003円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	117,297,470円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,760,482,909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 >	113,589,050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 >	52,998,705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 >	23,441,238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 >	225,505,581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 >	409,221,892円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	171,998,769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 >	119,832,735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 >	60,244,872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 >	11,044,499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 >	79,037,378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 >	1,044,312,649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)	209,231,222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 >	20,656,364円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,882,837,250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 >	286,224,350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 >	1,772,189,307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 >	461,376,503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 >	337,854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 >	190,956,800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 5 < 適格機関投資家限定 >	91,494,029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 >	180,989,397円
合計	70,289,619,191円

(平成30年12月19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	66,912,228,971円
同期中における追加設定元本額	629,552,378円
同期中における一部解約元本額	332,870,892円
平成30年12月19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	10,359,510,354円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	781,086,737円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,743,445,968円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,731,004,806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）	182,163,570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）	7,667,743円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	24,875,008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）	62,529,551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）	88,213,630円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	51,952,276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）	131,028,840円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,956,213,611円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	7,772,015,824円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	433,674,552円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	612,741,257円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	605,546,431円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,833,201円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	11,388,290円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	12,520,009円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	46,001,315円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	32,903,302円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	65,787,254円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,208,469円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	5,850,126,035円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	26,091,838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＞	474,361,996円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,486,172,970円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,450,832,018円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	9,016,678,236円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	57,327,222円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	223,654,156円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	758,842円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	978,965,161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＞	55,007,822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＞	384,921,677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＞	1,118,064,318円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	928,739,841円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	3,098,232,570円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,510,156円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,189,215,566円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	64,109,227円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	82,679,096円

三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,640,032,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	106,297,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	48,499,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,363,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	207,736,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	382,844,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	166,870,455円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	118,667,240円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	60,898,000円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	10,003,725円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	77,622,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	973,015,109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)	202,092,585円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,535,802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>	1,717,514,092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>	228,194,652円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	133,573,058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>	11,293,581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>	109,517,842円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	52,455,272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>	129,205,572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>	10,576円
合計	67,208,910,457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	2,963.00	10,370,500	
日本水産	98,300	639.00	62,813,700	
マルハニチロ	14,200	3,745.00	53,179,000	
カネコ種苗	4,000	1,323.00	5,292,000	
サカタのタネ	11,700	3,585.00	41,944,500	
ホクト	8,000	1,968.00	15,744,000	
日鉄鉱業	2,400	4,785.00	11,484,000	
三井松島ホールディングス	4,900	1,431.00	7,011,900	
国際石油開発帝石	395,000	1,006.00	397,370,000	

石油資源開発	14,000	2,060.00	28,840,000
K & O エナジーグループ	5,100	1,558.00	7,945,800
ヒノキヤグループ	2,700	2,063.00	5,570,100
ショーボンドホールディングス	7,600	8,740.00	66,424,000
ミライト・ホールディングス	24,800	1,590.00	39,432,000
タマホーム	7,200	1,133.00	8,157,600
ベステラ	2,700	1,604.00	4,330,800
T A T E R U	12,500	369.00	4,612,500
スペースバリューホールディングス	12,800	1,002.00	12,825,600
安藤・間	63,000	730.00	45,990,000
東急建設	28,700	1,059.00	30,393,300
コムシスホールディングス	35,000	2,686.00	94,010,000
ミサワホーム	9,300	777.00	7,226,100
ピーアールホールディングス	10,500	350.00	3,675,000
高松コンストラクショングループ	6,200	2,750.00	17,050,000
東建コーポレーション	3,000	6,350.00	19,050,000
大成建設	80,800	4,900.00	395,920,000
大林組	242,900	1,041.00	252,858,900
清水建設	247,900	916.00	227,076,400
飛鳥建設	7,900	1,446.00	11,423,400
長谷工コーポレーション	101,500	1,221.00	123,931,500
松井建設	10,800	751.00	8,110,800
銭高組	1,300	5,250.00	6,825,000
鹿島建設	190,100	1,536.00	291,993,600
不動テトラ	7,000	1,753.00	12,271,000
大末建設	5,400	1,066.00	5,756,400
鉄建建設	5,300	2,667.00	14,135,100
西松建設	18,200	2,506.00	45,609,200
三井住友建設	60,700	682.00	41,397,400
大豊建設	5,600	3,580.00	20,048,000
前田建設工業	58,900	1,085.00	63,906,500
奥村組	13,900	3,410.00	47,399,000
東鉄工業	9,700	3,050.00	29,585,000
浅沼組	3,200	3,010.00	9,632,000
戸田建設	95,200	687.00	65,402,400
熊谷組	11,600	3,475.00	40,310,000
北野建設	2,200	3,915.00	8,613,000
矢作建設工業	13,100	715.00	9,366,500
ピーエス三菱	11,100	630.00	6,993,000
日本ハウスホールディングス	19,300	460.00	8,878,000
大東建託	29,000	15,590.00	452,110,000
新日本建設	10,200	1,088.00	11,097,600

NIPPON	21,100	2,087.00	44,035,700
東亜道路工業	2,300	3,340.00	7,682,000
前田道路	25,700	2,189.00	56,257,300
日本道路	2,400	6,040.00	14,496,000
東亜建設工業	7,900	1,402.00	11,075,800
若築建設	5,800	1,648.00	9,558,400
東洋建設	32,900	377.00	12,403,300
五洋建設	97,900	652.00	63,830,800
世紀東急工業	14,800	644.00	9,531,200
福田組	2,800	4,325.00	12,110,000
住友林業	57,700	1,523.00	87,877,100
巴コーポレーション	16,000	375.00	6,000,000
大和ハウス工業	224,900	3,637.00	817,961,300
ライト工業	15,900	1,485.00	23,611,500
積水ハウス	249,500	1,662.50	414,793,750
日特建設	9,500	658.00	6,251,000
ユアテック	13,300	888.00	11,810,400
中電工	9,900	2,321.00	22,977,900
関電工	36,100	1,064.00	38,410,400
きんでん	54,000	1,817.00	98,118,000
東京エネシス	9,400	962.00	9,042,800
トーエネック	2,800	3,100.00	8,680,000
住友電設	6,200	1,771.00	10,980,200
日本電設工業	13,500	2,206.00	29,781,000
協和エクシオ	32,000	2,566.00	82,112,000
新日本空調	7,500	1,951.00	14,632,500
九電工	16,000	4,070.00	65,120,000
三機工業	18,800	1,129.00	21,225,200
日揮	70,400	1,611.00	113,414,400
中外炉工業	3,100	2,157.00	6,686,700
ヤマト	10,000	532.00	5,320,000
太平電業	5,700	2,514.00	14,329,800
高砂熱学工業	20,100	1,861.00	37,406,100
朝日工業社	2,300	3,125.00	7,187,500
明星工業	15,600	734.00	11,450,400
大気社	11,200	2,967.00	33,230,400
ダイダン	5,800	2,540.00	14,732,000
日比谷総合設備	8,100	1,845.00	14,944,500
東芝プラントシステム	17,500	2,054.00	35,945,000
OSJBホールディングス	40,700	305.00	12,413,500
新興プランテック	15,300	1,058.00	16,187,400
日本製粉	22,800	1,904.00	43,411,200

日清製粉グループ本社	81,100	2,329.00	188,881,900
日東富士製粉	800	5,670.00	4,536,000
昭和産業	6,300	2,990.00	18,837,000
鳥越製粉	9,100	864.00	7,862,400
中部飼料	9,200	1,246.00	11,463,200
フィード・ワン	52,400	182.00	9,536,800
日本甜菜製糖	5,300	1,846.00	9,783,800
三井製糖	5,500	2,752.00	15,136,000
日新製糖	3,800	2,129.00	8,090,200
森永製菓	18,300	4,745.00	86,833,500
中村屋	2,500	4,295.00	10,737,500
江崎グリコ	21,900	5,610.00	122,859,000
名糖産業	5,400	1,363.00	7,360,200
井村屋グループ	3,500	2,583.00	9,040,500
不二家	4,500	2,383.00	10,723,500
山崎製パン	59,400	2,399.00	142,500,600
モロゾフ	1,600	5,150.00	8,240,000
亀田製菓	4,500	4,980.00	22,410,000
寿スピリッツ	7,600	4,560.00	34,656,000
カルビー	33,200	3,580.00	118,856,000
森永乳業	14,500	3,220.00	46,690,000
六甲バター	5,500	2,184.00	12,012,000
ヤクルト本社	53,800	8,260.00	444,388,000
明治ホールディングス	51,300	8,960.00	459,648,000
雪印メグミルク	17,500	2,818.00	49,315,000
プリマハム	10,000	1,964.00	19,640,000
日本ハム	31,300	4,260.00	133,338,000
丸大食品	8,000	1,824.00	14,592,000
S Foods	6,400	4,310.00	27,584,000
伊藤ハム米久ホールディングス	46,600	675.00	31,455,000
サッポロホールディングス	26,300	2,432.00	63,961,600
アサヒグループホールディングス	152,200	4,456.00	678,203,200
キリンホールディングス	328,800	2,376.50	781,393,200
宝ホールディングス	53,900	1,387.00	74,759,300
オエノンホールディングス	24,800	346.00	8,580,800
養命酒製造	3,200	2,182.00	6,982,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	55,600	3,015.00	167,634,000
サントリー食品インターナショナル	48,400	4,680.00	226,512,000
ダイドーグループホールディングス	4,000	5,480.00	21,920,000
伊藤園	24,100	4,840.00	116,644,000
キーコーヒー	6,900	2,055.00	14,179,500
日清オイリオグループ	9,200	3,180.00	29,256,000

不二製油グループ本社	17,800	3,745.00	66,661,000
かどや製油	1,000	5,650.00	5,650,000
J - オイルミルズ	3,600	3,925.00	14,130,000
キッコーマン	47,800	6,180.00	295,404,000
味の素	160,300	1,984.50	318,115,350
キューピー	40,500	2,567.00	103,963,500
ハウス食品グループ本社	27,700	3,935.00	108,999,500
カゴメ	29,100	2,989.00	86,979,900
焼津水産化学工業	7,700	1,010.00	7,777,000
アリアケジャパン	6,500	7,160.00	46,540,000
ニチレイ	37,700	3,100.00	116,870,000
東洋水産	37,300	3,990.00	148,827,000
イトアンド	3,600	1,605.00	5,778,000
日清食品ホールディングス	30,700	7,090.00	217,663,000
永谷園ホールディングス	4,600	2,498.00	11,490,800
一正蒲鉾	3,900	1,052.00	4,102,800
フジッコ	7,800	2,385.00	18,603,000
ロック・フィールド	7,600	1,650.00	12,540,000
日本たばこ産業	419,900	2,809.50	1,179,709,050
ケンコーマヨネーズ	4,500	2,160.00	9,720,000
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,858.00	9,475,800
なとり	5,500	1,737.00	9,553,500
ピクルスコーポレーション	2,300	2,331.00	5,361,300
北の達人コーポレーション	28,900	385.00	11,126,500
ユーグレナ	30,400	636.00	19,334,400
ミヨシ油脂	4,800	1,160.00	5,568,000
理研ビタミン	3,600	3,545.00	12,762,000
片倉工業	10,000	1,135.00	11,350,000
ゲンゼ	5,200	4,100.00	21,320,000
東洋紡	30,800	1,554.00	47,863,200
ユニチカ	22,300	500.00	11,150,000
富士紡ホールディングス	4,100	2,844.00	11,660,400
倉敷紡績	6,700	2,633.00	17,641,100
シキボウ	6,300	1,051.00	6,621,300
日本毛織	23,000	846.00	19,458,000
ガイドーリミテッド	23,000	342.00	7,866,000
帝国繊維	8,200	2,145.00	17,589,000
帝人	57,500	1,798.00	103,385,000
東レ	551,100	803.70	442,919,070
住江織物	2,400	2,599.00	6,237,600
アツギ	8,100	991.00	8,027,100
ダイニック	6,200	760.00	4,712,000



セーレン	17,400	1,770.00	30,798,000
小松マテーレ	12,500	799.00	9,987,500
ワコールホールディングス	20,900	2,881.00	60,212,900
ホギメディカル	9,000	3,240.00	29,160,000
T S Iホールディングス	26,400	715.00	18,876,000
マツオカコーポレーション	2,500	3,060.00	7,650,000
ワールド	8,000	1,553.00	12,424,000
三陽商会	4,900	1,934.00	9,476,600
オンワードホールディングス	45,400	606.00	27,512,400
ゴールドウイン	6,400	12,280.00	78,592,000
デサント	17,300	1,922.00	33,250,600
特種東海製紙	4,500	4,245.00	19,102,500
王子ホールディングス	317,500	600.00	190,500,000
日本製紙	33,600	2,035.00	68,376,000
三菱製紙	14,800	532.00	7,873,600
北越コーポレーション	45,800	516.00	23,632,800
中越パルプ工業	4,000	1,480.00	5,920,000
巴川製紙所	3,700	992.00	3,670,400
大王製紙	33,500	1,285.00	43,047,500
レンゴー	72,600	850.00	61,710,000
トモク	5,200	1,659.00	8,626,800
ザ・パック	5,400	3,135.00	16,929,000
クラレ	119,100	1,590.00	189,369,000
旭化成	504,900	1,144.00	577,605,600
昭和電工	47,100	3,715.00	174,976,500
住友化学	554,900	547.00	303,530,300
住友精化	3,500	4,370.00	15,295,000
日産化学	43,400	6,090.00	264,306,000
ラサ工業	3,400	1,324.00	4,501,600
クレハ	6,500	6,440.00	41,860,000
多木化学	1,100	9,110.00	10,021,000
テイカ	6,100	1,755.00	10,705,500
石原産業	14,100	1,054.00	14,861,400
日本曹達	11,200	2,740.00	30,688,000
東ソー	109,300	1,443.00	157,719,900
トクヤマ	20,600	2,624.00	54,054,400
セントラル硝子	15,900	2,288.00	36,379,200
東亜合成	45,000	1,225.00	55,125,000
大阪ソーダ	7,600	2,536.00	19,273,600
関東電化工業	16,900	826.00	13,959,400
デンカ	27,800	3,165.00	87,987,000
信越化学工業	125,000	8,962.00	1,120,250,000

日本カーバイド工業	3,200	1,712.00	5,478,400
堺化学工業	4,900	2,375.00	11,637,500
第一稀元素化学工業	6,700	854.00	5,721,800
エア・ウォーター	57,300	1,690.00	96,837,000
大陽日酸	58,400	1,841.00	107,514,400
日本化学工業	2,700	2,320.00	6,264,000
日本パーカラライジング	39,300	1,313.00	51,600,900
高压ガス工業	12,800	803.00	10,278,400
四国化成工業	12,000	1,111.00	13,332,000
戸田工業	2,200	2,256.00	4,963,200
ステラ ケミファ	4,400	2,830.00	12,452,000
保土谷化学工業	2,900	2,113.00	6,127,700
日本触媒	12,000	7,180.00	86,160,000
大日精化工業	5,800	2,746.00	15,926,800
カネカ	18,800	4,065.00	76,422,000
三菱瓦斯化学	72,900	1,710.00	124,659,000
三井化学	64,000	2,567.00	164,288,000
J S R	71,300	1,692.00	120,639,600
東京応化工業	12,300	3,110.00	38,253,000
大阪有機化学工業	7,200	1,150.00	8,280,000
三菱ケミカルホールディングス	473,600	817.00	386,931,200
K Hネオケム	10,800	2,320.00	25,056,000
ダイセル	110,100	1,178.00	129,697,800
住友ベークライト	12,400	3,945.00	48,918,000
積水化学工業	154,000	1,750.00	269,500,000
日本ゼオン	64,300	1,050.00	67,515,000
アイカ工業	21,400	3,560.00	76,184,000
宇部興産	35,800	2,309.00	82,662,200
積水樹脂	11,600	1,933.00	22,422,800
タキロンシーアイ	16,900	600.00	10,140,000
旭有機材	5,300	1,513.00	8,018,900
日立化成	32,700	1,630.00	53,301,000
ニチバン	4,100	2,034.00	8,339,400
リケンテクノス	21,800	462.00	10,071,600
大倉工業	4,400	1,925.00	8,470,000
積水化成品工業	11,300	944.00	10,667,200
群栄化学工業	2,400	2,648.00	6,355,200
ダイキョーニシカワ	14,600	1,105.00	16,133,000
森六ホールディングス	4,100	2,685.00	11,008,500
日本化薬	45,300	1,409.00	63,827,700
カーリットホールディングス	9,100	789.00	7,179,900
日本精化	7,300	1,041.00	7,599,300

扶桑化学工業	7,100	2,078.00	14,753,800
トリケミカル研究所	1,700	4,545.00	7,726,500
A D E K A	35,200	1,637.00	57,622,400
日油	27,400	3,815.00	104,531,000
ハリマ化成グループ	7,300	999.00	7,292,700
花王	175,900	8,019.00	1,410,542,100
第一工業製薬	3,000	2,952.00	8,856,000
石原ケミカル	2,800	1,838.00	5,146,400
三洋化成工業	4,600	5,130.00	23,598,000
大日本塗料	9,300	1,012.00	9,411,600
日本ペイントホールディングス	58,500	3,865.00	226,102,500
関西ペイント	79,700	2,109.00	168,087,300
中国塗料	23,500	975.00	22,912,500
日本特殊塗料	5,600	1,369.00	7,666,400
藤倉化成	12,600	616.00	7,761,600
太陽ホールディングス	5,800	3,240.00	18,792,000
D I C	32,000	3,485.00	111,520,000
サカタインクス	15,500	1,171.00	18,150,500
東洋インキS Cホールディングス	14,400	2,559.00	36,849,600
T & K T O K A	6,400	1,021.00	6,534,400
富士フィルムホールディングス	150,500	4,347.00	654,223,500
資生堂	144,000	7,043.00	1,014,192,000
ライオン	100,900	2,234.00	225,410,600
高砂香料工業	5,100	3,425.00	17,467,500
マンダム	16,100	3,165.00	50,956,500
ミルボン	8,900	4,525.00	40,272,500
ファンケル	32,300	2,917.00	94,219,100
コーセー	12,200	17,250.00	210,450,000
コタ	4,400	1,442.00	6,344,800
シーズ・ホールディングス	8,800	5,870.00	51,656,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,900	2,860.00	88,374,000
ノエビアホールディングス	4,500	4,920.00	22,140,000
エステー	5,600	1,933.00	10,824,800
アグロ カネショウ	3,300	1,980.00	6,534,000
コニシ	12,700	1,605.00	20,383,500
長谷川香料	8,900	1,537.00	13,679,300
星光P M C	6,000	761.00	4,566,000
小林製薬	20,300	7,570.00	153,671,000
荒川化学工業	7,100	1,427.00	10,131,700
メック	5,600	1,133.00	6,344,800
日本高純度化学	3,200	2,302.00	7,366,400
タカラバイオ	18,900	2,780.00	52,542,000

J C U	9,600	1,527.00	14,659,200
デクセリアルズ	19,100	801.00	15,299,100
アース製薬	5,400	5,170.00	27,918,000
北興化学工業	10,500	467.00	4,903,500
大成ラミック	3,600	2,946.00	10,605,600
クミアイ化学工業	30,100	730.00	21,973,000
日本農薬	19,200	485.00	9,312,000
アキレス	5,800	2,142.00	12,423,600
有沢製作所	12,800	785.00	10,048,000
日東電工	54,800	5,626.00	308,304,800
レック	7,800	1,952.00	15,225,600
藤森工業	6,200	2,971.00	18,420,200
前澤化成工業	7,700	1,074.00	8,269,800
J S P	4,500	2,169.00	9,760,500
エフピコ	5,900	6,610.00	38,999,000
天馬	5,400	1,801.00	9,725,400
信越ポリマー	13,700	713.00	9,768,100
東リ	23,500	266.00	6,251,000
ニフコ	29,000	2,766.00	80,214,000
バルカー	6,100	2,376.00	14,493,600
ユニ・チャーム	153,800	3,576.00	549,988,800
協和発酵キリン	90,300	2,233.00	201,639,900
武田薬品工業	285,900	3,588.00	1,025,809,200
アステラス製薬	668,000	1,506.00	1,006,008,000
大日本住友製薬	53,700	3,715.00	199,495,500
塩野義製薬	94,700	6,670.00	631,649,000
田辺三菱製薬	75,300	1,631.00	122,814,300
あすか製薬	9,600	1,130.00	10,848,000
日本新薬	19,000	7,560.00	143,640,000
中外製薬	75,600	7,100.00	536,760,000
科研製薬	13,200	5,080.00	67,056,000
エーザイ	86,700	9,257.00	802,581,900
ロート製薬	37,200	3,275.00	121,830,000
小野薬品工業	171,100	2,536.50	433,995,150
久光製薬	21,400	6,570.00	140,598,000
持田製薬	5,500	9,630.00	52,965,000
参天製薬	137,200	1,742.00	239,002,400
扶桑薬品工業	3,800	2,690.00	10,222,000
日本ケミファ	1,600	3,090.00	4,944,000
ツムラ	22,500	3,275.00	73,687,500
日医工	17,700	1,749.00	30,957,300
キッセイ薬品工業	12,900	3,035.00	39,151,500

生化学工業	14,200	1,331.00	18,900,200
栄研化学	12,800	2,525.00	32,320,000
鳥居薬品	4,100	2,629.00	10,778,900
JCRファーマ	5,100	5,280.00	26,928,000
東和薬品	3,500	8,250.00	28,875,000
富士製薬工業	5,300	1,784.00	9,455,200
沢井製薬	15,000	5,810.00	87,150,000
ゼリア新薬工業	14,400	2,004.00	28,857,600
第一三共	207,400	3,871.00	802,845,400
キョーリン製薬ホールディングス	18,700	2,469.00	46,170,300
大幸薬品	4,100	1,811.00	7,425,100
ダイト	4,400	3,030.00	13,332,000
大塚ホールディングス	138,000	5,116.00	706,008,000
大正製薬ホールディングス	16,100	11,840.00	190,624,000
ペプチドリーム	33,500	4,685.00	156,947,500
日本コークス工業	75,000	92.00	6,900,000
昭和シェル石油	67,400	1,527.00	102,919,800
ニチレキ	10,100	1,113.00	11,241,300
ユシロ化学工業	5,100	1,186.00	6,048,600
富士石油	19,700	292.00	5,752,400
MORESCO	3,800	1,575.00	5,985,000
出光興産	56,100	3,580.00	200,838,000
JXTGホールディングス	1,232,300	585.00	720,895,500
コスモエネルギーホールディングス	20,800	2,323.00	48,318,400
横浜ゴム	42,100	2,251.00	94,767,100
東洋ゴム工業	37,800	1,496.00	56,548,800
ブリヂストン	222,700	4,470.00	995,469,000
住友ゴム工業	65,400	1,389.00	90,840,600
オカモト	5,100	5,970.00	30,447,000
ニッタ	8,200	3,575.00	29,315,000
住友理工	14,100	961.00	13,550,100
三ツ星ベルト	9,800	2,143.00	21,001,400
バンドー化学	14,600	1,099.00	16,045,400
日東紡績	10,800	1,845.00	19,926,000
AGC	72,600	3,530.00	256,278,000
日本板硝子	33,500	867.00	29,044,500
日本山村硝子	4,200	1,579.00	6,631,800
日本電気硝子	31,500	2,807.00	88,420,500
オハラ	3,100	1,838.00	5,697,800
住友大阪セメント	14,600	4,660.00	68,036,000
太平洋セメント	45,700	3,535.00	161,549,500
日本ヒューム	8,900	887.00	7,894,300

日本コンクリート工業	20,500	264.00	5,412,000
三谷セキサン	3,700	2,804.00	10,374,800
アジアパイルホールディングス	11,700	649.00	7,593,300
東海カーボン	65,900	1,438.00	94,764,200
日本カーボン	3,500	4,575.00	16,012,500
東洋炭素	4,500	2,432.00	10,944,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,735.00	20,360,500
TOTO	55,600	4,055.00	225,458,000
日本碍子	87,800	1,572.00	138,021,600
日本特殊陶業	61,100	2,238.00	136,741,800
MARUWA	2,600	5,950.00	15,470,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,910.00	8,602,000
黒崎播磨	1,500	7,160.00	10,740,000
ヨータイ	7,800	624.00	4,867,200
東京窯業	12,600	388.00	4,888,800
ニッカトー	4,300	892.00	3,835,600
フジミインコーポレーテッド	6,400	2,191.00	14,022,400
ニチアス	19,500	1,968.00	38,376,000
ニチハ	10,000	2,729.00	27,290,000
新日鐵住金	320,500	1,977.50	633,788,750
神戸製鋼所	131,700	820.00	107,994,000
中山製鋼所	11,900	491.00	5,842,900
合同製鐵	4,100	1,675.00	6,867,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	193,700	1,864.50	361,153,650
日新製鋼	17,200	1,404.00	24,148,800
東京製鐵	38,300	918.00	35,159,400
共英製鋼	8,200	1,720.00	14,104,000
大和工業	15,500	2,656.00	41,168,000
東京鐵鋼	4,400	1,192.00	5,244,800
大阪製鐵	5,100	1,856.00	9,465,600
淀川製鋼所	9,400	2,274.00	21,375,600
丸一鋼管	25,500	3,495.00	89,122,500
モリ工業	2,700	2,461.00	6,644,700
大同特殊鋼	11,900	4,455.00	53,014,500
日本冶金工業	61,400	240.00	14,736,000
山陽特殊製鋼	9,100	2,404.00	21,876,400
愛知製鋼	4,000	3,620.00	14,480,000
日立金属	77,700	1,210.00	94,017,000
大平洋金属	5,100	2,901.00	14,795,100
新日本電工	46,400	230.00	10,672,000
栗本鐵工所	4,600	1,412.00	6,495,200
三菱製鋼	6,000	1,742.00	10,452,000

シンニッタン	14,700	357.00	5,247,900
大紀アルミニウム工業所	13,100	566.00	7,414,600
日本軽金属ホールディングス	198,000	226.00	44,748,000
三井金属鉱業	19,700	2,351.00	46,314,700
東邦亜鉛	4,000	3,470.00	13,880,000
三菱マテリアル	47,400	3,120.00	147,888,000
住友金属鉱山	98,400	3,159.00	310,845,600
D O W A ホールディングス	16,900	3,400.00	57,460,000
古河機械金属	12,100	1,243.00	15,040,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,600	1,860.00	15,996,000
東邦チタニウム	13,200	1,082.00	14,282,400
U A C J	10,700	2,349.00	25,134,300
C K サンエツ	1,700	2,501.00	4,251,700
古河電気工業	20,800	2,844.00	59,155,200
住友電気工業	268,100	1,503.50	403,088,350
フジクラ	88,500	457.00	40,444,500
タツタ電線	16,300	497.00	8,101,100
平河ビューテック	3,600	1,118.00	4,024,800
リョービ	8,900	2,710.00	24,119,000
アーレスティ	10,700	642.00	6,869,400
アサヒホールディングス	13,600	2,336.00	31,769,600
稲葉製作所	5,700	1,328.00	7,569,600
宮地エンジニアリンググループ	2,800	2,015.00	5,642,000
トーカロ	19,600	876.00	17,169,600
アルファC o	4,000	1,306.00	5,224,000
S U M C O	79,400	1,350.00	107,190,000
川田テクノロジーズ	1,700	7,700.00	13,090,000
R S Technologies	1,600	3,035.00	4,856,000
東洋製罐グループホールディングス	45,600	2,532.00	115,459,200
ホッカインホールディングス	4,800	1,769.00	8,491,200
コロナ	5,600	1,075.00	6,020,000
横河ブリッジホールディングス	13,600	1,684.00	22,902,400
三和ホールディングス	74,100	1,275.00	94,477,500
文化シャッター	22,000	716.00	15,752,000
三協立山	10,200	1,171.00	11,944,200
アルインコ	8,900	981.00	8,730,900
L I X I L グループ	105,900	1,360.00	144,024,000
ノーリツ	16,100	1,521.00	24,488,100
長府製作所	7,300	2,213.00	16,154,900
リンナイ	12,800	7,500.00	96,000,000
日東精工	12,500	582.00	7,275,000
岡部	15,200	913.00	13,877,600

ジーテクト	8,300	1,481.00	12,292,300
東プレ	13,100	2,229.00	29,199,900
高周波熱錬	14,400	869.00	12,513,600
東京製綱	5,900	1,005.00	5,929,500
パイオラックス	11,400	2,275.00	25,935,000
エイチワン	8,000	1,003.00	8,024,000
日本発條	72,000	985.00	70,920,000
三益半導体工業	6,300	1,284.00	8,089,200
日本製鋼所	22,200	1,881.00	41,758,200
三浦工業	31,100	2,688.00	83,596,800
タクマ	26,100	1,418.00	37,009,800
ツガミ	16,100	689.00	11,092,900
オークマ	9,200	5,100.00	46,920,000
東芝機械	8,100	1,921.00	15,560,100
アマダホールディングス	110,200	1,037.00	114,277,400
アイダエンジニアリング	19,500	744.00	14,508,000
F U J I	20,800	1,279.00	26,603,200
牧野フライス製作所	8,200	4,040.00	33,128,000
オーエスジー	35,500	2,138.00	75,899,000
旭ダイヤモンド工業	19,500	620.00	12,090,000
D M G 森精機	45,400	1,322.00	60,018,800
ソディック	15,600	717.00	11,185,200
ディスコ	9,700	13,380.00	129,786,000
日東工器	4,400	2,223.00	9,781,200
日進工具	2,400	2,331.00	5,594,400
豊和工業	5,000	748.00	3,740,000
津田駒工業	2,200	1,788.00	3,933,600
島精機製作所	9,900	3,240.00	32,076,000
オプトラン	7,200	1,814.00	13,060,800
フリュー	7,600	1,004.00	7,630,400
ヤマシンフィルタ	12,900	736.00	9,494,400
日阪製作所	10,100	876.00	8,847,600
やまびこ	13,700	1,064.00	14,576,800
平田機工	3,400	5,310.00	18,054,000
ペガサスミシン製造	8,600	736.00	6,329,600
ナプテスコ	39,500	2,639.00	104,240,500
三井海洋開発	7,700	2,337.00	17,994,900
レオン自動機	7,100	1,488.00	10,564,800
S M C	21,200	35,060.00	743,272,000
ホソカワミクロン	2,600	4,275.00	11,115,000
ユニオンツール	3,200	3,120.00	9,984,000
オイレス工業	10,000	1,870.00	18,700,000



日精エー・エス・ビー機械	2,300	3,270.00	7,521,000
サトーホールディングス	8,700	2,536.00	22,063,200
技研製作所	5,000	3,530.00	17,650,000
日精樹脂工業	7,300	944.00	6,891,200
オカダアイヨン	3,200	1,584.00	5,068,800
小松製作所	328,000	2,522.50	827,380,000
住友重機械工業	41,200	3,680.00	151,616,000
日立建機	28,900	2,637.00	76,209,300
日工	2,800	2,449.00	6,857,200
巴工業	3,700	2,274.00	8,413,800
井関農機	7,500	1,612.00	12,090,000
T O W A	7,300	632.00	4,613,600
北川鉄工所	3,700	2,257.00	8,350,900
ローツェ	3,600	1,493.00	5,374,800
クボタ	388,600	1,732.50	673,249,500
荏原実業	3,500	2,023.00	7,080,500
三菱化工機	3,900	1,507.00	5,877,300
月島機械	14,700	1,233.00	18,125,100
帝国電機製作所	5,800	1,341.00	7,777,800
新東工業	17,000	878.00	14,926,000
澁谷工業	6,300	3,705.00	23,341,500
アイチ コーポレーション	14,200	598.00	8,491,600
小森コーポレーション	19,700	1,101.00	21,689,700
鶴見製作所	6,000	1,905.00	11,430,000
住友精密工業	1,900	3,115.00	5,918,500
酒井重工業	1,800	2,439.00	4,390,200
荏原製作所	32,300	2,613.00	84,399,900
西島製作所	9,800	977.00	9,574,600
北越工業	8,100	1,124.00	9,104,400
ダイキン工業	98,900	12,250.00	1,211,525,000
オルガノ	3,100	2,767.00	8,577,700
トーヨーカネツ	3,200	2,256.00	7,219,200
栗田工業	39,200	2,783.00	109,093,600
椿本チエイン	9,200	3,860.00	35,512,000
大同工業	5,700	917.00	5,226,900
アネスト岩田	11,800	1,070.00	12,626,000
ダイフク	39,800	5,490.00	218,502,000
加藤製作所	4,000	2,715.00	10,860,000
タダノ	35,300	1,064.00	37,559,200
フジテック	26,000	1,292.00	33,592,000
C K D	20,200	1,005.00	20,301,000
キトー	6,100	1,554.00	9,479,400

平和	20,100	2,369.00	47,616,900
理想科学工業	6,500	1,733.00	11,264,500
SANKYO	18,300	4,285.00	78,415,500
日本金銭機械	9,200	987.00	9,080,400
マースグループホールディングス	5,100	2,234.00	11,393,400
福島工業	4,400	3,695.00	16,258,000
ダイコク電機	4,300	1,572.00	6,759,600
竹内製作所	11,900	1,859.00	22,122,100
アマノ	20,900	2,278.00	47,610,200
JUKI	10,200	1,205.00	12,291,000
サンデンホールディングス	9,300	783.00	7,281,900
蛇の目マシン工業	9,900	521.00	5,157,900
マックス	10,900	1,372.00	14,954,800
グローリー	20,300	2,548.00	51,724,400
新晃工業	7,400	1,567.00	11,595,800
大和冷機工業	10,500	1,136.00	11,928,000
セガサミーホールディングス	72,200	1,635.00	118,047,000
日本ピストンリング	3,500	1,933.00	6,765,500
リケン	3,300	5,100.00	16,830,000
T P R	9,500	2,310.00	21,945,000
ツバキ・ナカシマ	11,100	1,686.00	18,714,600
ホシザキ	21,200	7,170.00	152,004,000
大豊工業	6,900	991.00	6,837,900
日本精工	147,300	977.00	143,912,100
NTN	155,000	340.00	52,700,000
ジェイテクト	68,800	1,294.00	89,027,200
不二越	6,800	4,080.00	27,744,000
日本トムソン	22,300	507.00	11,306,100
THK	45,200	2,269.00	102,558,800
ユーシン精機	6,300	938.00	5,909,400
前澤給装工業	4,100	1,931.00	7,917,100
イーグル工業	9,300	1,301.00	12,099,300
日本ピラー工業	8,300	1,363.00	11,312,900
キッツ	28,900	878.00	25,374,200
マキタ	88,000	4,145.00	364,760,000
日立造船	56,300	346.00	19,479,800
三菱重工業	121,400	4,148.00	503,567,200
I H I	55,700	3,420.00	190,494,000
スター精密	12,500	1,473.00	18,412,500
日清紡ホールディングス	40,700	874.00	35,571,800
イビデン	44,700	1,616.00	72,235,200
コニカミノルタ	157,900	1,030.00	162,637,000

ブラザー工業	94,200	1,704.00	160,516,800
ミネベアミツミ	134,200	1,634.00	219,282,800
日立製作所	326,000	3,122.00	1,017,772,000
三菱電機	724,100	1,282.00	928,296,200
富士電機	47,000	3,410.00	160,270,000
東洋電機製造	4,000	1,328.00	5,312,000
安川電機	84,000	3,040.00	255,360,000
シンフォニアテクノロジー	10,300	1,402.00	14,440,600
明電舎	14,400	1,413.00	20,347,200
オリジン電気	3,200	1,706.00	5,459,200
山洋電気	3,600	3,650.00	13,140,000
デンヨー	7,500	1,445.00	10,837,500
東芝テック	8,900	2,545.00	22,650,500
芝浦メカトロニクス	1,700	3,555.00	6,043,500
マブチモーター	20,000	3,600.00	72,000,000
日本電産	87,100	13,225.00	1,151,897,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	1,943.00	8,160,600
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,340.00	4,288,000
東光高岳	4,400	1,421.00	6,252,400
ダブル・スコープ	10,900	1,058.00	11,532,200
ダイヘン	8,000	2,414.00	19,312,000
ヤーマン	10,600	1,552.00	16,451,200
JVCケンウッド	54,500	255.00	13,897,500
ミマキエンジニアリング	7,300	880.00	6,424,000
第一精工	3,900	1,213.00	4,730,700
日新電機	17,000	875.00	14,875,000
大崎電気工業	15,900	694.00	11,034,600
オムロン	76,800	4,290.00	329,472,000
日東工業	11,800	1,792.00	21,145,600
I D E C	9,900	2,057.00	20,364,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,400	2,430.00	64,152,000
サクサホールディングス	2,700	1,788.00	4,827,600
メルコホールディングス	3,000	3,545.00	10,635,000
日本電気	93,500	3,500.00	327,250,000
富士通	69,900	7,135.00	498,736,500
沖電気工業	31,400	1,340.00	42,076,000
電気興業	4,300	2,452.00	10,543,600
サンケン電気	8,600	2,114.00	18,180,400
アイホン	5,400	1,665.00	8,991,000
ルネサスエレクトロニクス	74,200	503.00	37,322,600
セイコーエプソン	89,600	1,567.00	140,403,200
ワコム	53,600	482.00	25,835,200

アルバック	16,800	3,375.00	56,700,000
E I Z O	6,700	3,905.00	26,163,500
日本信号	18,500	905.00	16,742,500
京三製作所	18,500	422.00	7,807,000
能美防災	9,600	1,936.00	18,585,600
ホーチキ	5,300	1,156.00	6,126,800
エレコム	6,500	2,902.00	18,863,000
パナソニック	827,300	1,056.50	874,042,450
シャープ	72,100	1,200.00	86,520,000
アンリツ	47,100	1,661.00	78,233,100
富士通ゼネラル	22,700	1,426.00	32,370,200
ソニー	485,600	5,550.00	2,695,080,000
T D K	37,800	7,890.00	298,242,000
帝国通信工業	5,400	1,166.00	6,296,400
タムラ製作所	28,100	551.00	15,483,100
アルプス電気	66,300	2,346.00	155,539,800
日本トリム	1,600	5,950.00	9,520,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,195.00	9,438,500
フォスター電機	8,800	1,425.00	12,540,000
クラリオン	6,200	2,487.00	15,419,400
S M K	2,600	2,315.00	6,019,000
ヨコオ	5,700	1,375.00	7,837,500
ホシデン	21,600	750.00	16,200,000
ヒロセ電機	10,400	10,910.00	113,464,000
日本航空電子工業	16,600	1,321.00	21,928,600
T O A	8,600	1,051.00	9,038,600
マクセルホールディングス	15,700	1,460.00	22,922,000
古野電気	9,900	1,148.00	11,365,200
ユニデンホールディングス	2,800	2,140.00	5,992,000
アルパイン	13,100	1,594.00	20,881,400
スミダコーポレーション	7,000	1,273.00	8,911,000
アイコム	4,400	2,050.00	9,020,000
リオン	3,900	1,860.00	7,254,000
本多通信工業	7,600	497.00	3,777,200
船井電機	10,700	580.00	6,206,000
横河電機	72,600	1,990.00	144,474,000
新電元工業	2,700	3,905.00	10,543,500
アズビル	46,900	2,097.00	98,349,300
東亜ディーケーケー	4,600	791.00	3,638,600
日本光電工業	32,100	3,540.00	113,634,000
チノー	4,500	1,245.00	5,602,500
共和電業	11,700	400.00	4,680,000

堀場製作所	14,500	4,840.00	70,180,000
アドバンテスト	49,600	2,198.00	109,020,800
エスベック	6,900	1,906.00	13,151,400
キーエンス	35,600	56,610.00	2,015,316,000
日置電機	3,900	3,870.00	15,093,000
シスメックス	56,600	5,646.00	319,563,600
日本マイクロニクス	12,900	737.00	9,507,300
メガチップス	6,000	2,436.00	14,616,000
O B A R A G R O U P	4,200	4,115.00	17,283,000
コーセル	10,900	933.00	10,169,700
イリソ電子工業	6,600	4,100.00	27,060,000
オブテックスグループ	12,900	1,901.00	24,522,900
千代田インテグレ	3,600	2,216.00	7,977,600
アイ・オー・データ機器	4,100	1,130.00	4,633,000
レーザーテック	14,800	3,045.00	45,066,000
スタンレー電気	51,200	3,150.00	161,280,000
岩崎電気	4,700	1,376.00	6,467,200
ウシオ電機	44,700	1,147.00	51,270,900
ハリオス テクノ ホールディング	7,600	656.00	4,985,600
日本セラミック	7,500	2,452.00	18,390,000
古河電池	6,800	722.00	4,909,600
山一電機	5,800	1,232.00	7,145,600
図研	5,400	1,552.00	8,380,800
日本電子	14,400	1,764.00	25,401,600
カシオ計算機	64,300	1,456.00	93,620,800
ファナック	68,800	16,950.00	1,166,160,000
日本シイエムケイ	19,400	550.00	10,670,000
エンプラス	3,600	2,986.00	10,749,600
ローム	35,000	7,100.00	248,500,000
浜松ホトニクス	51,900	3,750.00	194,625,000
三井ハイテック	8,500	860.00	7,310,000
新光電気工業	24,000	734.00	17,616,000
京セラ	110,500	5,696.00	629,408,000
太陽誘電	32,500	1,829.00	59,442,500
村田製作所	76,000	16,045.00	1,219,420,000
ユーシン	13,900	985.00	13,691,500
双葉電子工業	11,600	1,617.00	18,757,200
ニチコン	23,200	808.00	18,745,600
日本ケミコン	5,400	1,925.00	10,395,000
K O A	11,200	1,338.00	14,985,600
市光工業	11,300	581.00	6,565,300
小糸製作所	43,200	5,750.00	248,400,000

ミツバ	14,000	636.00	8,904,000	
S C R E E Nホールディングス	12,700	4,855.00	61,658,500	
キヤノン電子	6,500	1,967.00	12,785,500	
キヤノン	389,600	3,121.00	1,215,941,600	
リコー	217,900	1,100.00	239,690,000	
象印マホービン	13,800	1,081.00	14,917,800	
東京エレクトロン	48,300	12,915.00	623,794,500	
トヨタ紡織	25,400	1,681.00	42,697,400	
ユニプレス	14,500	1,892.00	27,434,000	
豊田自動織機	58,300	5,350.00	311,905,000	
モリタホールディングス	12,600	1,890.00	23,814,000	
三櫻工業	11,200	594.00	6,652,800	
デンソー	160,500	5,075.00	814,537,500	
東海理化電機製作所	19,400	1,869.00	36,258,600	
三井E & Sホールディングス	27,200	1,144.00	31,116,800	
川崎重工業	56,400	2,505.00	141,282,000	
名村造船所	23,500	473.00	11,115,500	
日本車輛製造	3,100	2,368.00	7,340,800	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,064.00	9,788,800	
日産自動車	854,400	921.50	787,329,600	
いすゞ自動車	229,400	1,622.00	372,086,800	
トヨタ自動車	807,300	6,762.00	5,458,962,600	代用有価証券 400,000株
日野自動車	90,200	1,109.00	100,031,800	
三菱自動車工業	268,200	652.00	174,866,400	
エフテック	6,700	942.00	6,311,400	
武蔵精密工業	16,800	1,640.00	27,552,000	
日産車体	14,800	918.00	13,586,400	
新明和工業	33,400	1,447.00	48,329,800	
極東開発工業	14,600	1,462.00	21,345,200	
日信工業	13,000	1,433.00	18,629,000	
トピー工業	6,100	2,379.00	14,511,900	
ティラド	3,300	2,315.00	7,639,500	
タチエス	12,600	1,468.00	18,496,800	
N O K	39,100	1,579.00	61,738,900	
フタバ産業	21,300	541.00	11,523,300	
K Y B	7,700	2,632.00	20,266,400	
大同メタル工業	13,600	835.00	11,356,000	
プレス工業	35,900	556.00	19,960,400	
ミクニ	11,200	531.00	5,947,200	
太平洋工業	14,900	1,481.00	22,066,900	
ケーヒン	16,400	1,864.00	30,569,600	
河西工業	9,900	866.00	8,573,400	

アイシン精機	59,400	3,980.00	236,412,000
マツダ	227,900	1,233.50	281,114,650
今仙電機製作所	8,800	1,005.00	8,844,000
本田技研工業	611,000	3,047.00	1,861,717,000
スズキ	132,500	5,699.00	755,117,500
S U B A R U	225,000	2,458.00	553,050,000
安永	3,900	1,496.00	5,834,400
ヤマハ発動機	102,000	2,286.00	233,172,000
ショーワ	17,200	1,362.00	23,426,400
T B K	16,500	408.00	6,732,000
エクセディ	9,600	2,690.00	25,824,000
豊田合成	23,700	2,215.00	52,495,500
愛三工業	12,900	764.00	9,855,600
日本プラスト	7,400	758.00	5,609,200
ヨロズ	7,400	1,405.00	10,397,000
エフ・シー・シー	12,900	2,579.00	33,269,100
シマノ	29,200	16,230.00	473,916,000
テイ・エス テック	17,000	3,035.00	51,595,000
ジャムコ	3,900	2,592.00	10,108,800
テルモ	102,400	6,343.00	649,523,200
日機装	23,200	961.00	22,295,200
島津製作所	92,800	2,343.00	217,430,400
J M S	12,000	545.00	6,540,000
長野計器	7,400	824.00	6,097,600
ブイ・テクノロジー	1,700	13,940.00	23,698,000
東京計器	6,000	972.00	5,832,000
インターアクション	4,300	1,929.00	8,294,700
東京精密	12,900	2,822.00	36,403,800
マニー	8,800	4,600.00	40,480,000
ニコン	125,900	1,651.00	207,860,900
トプコン	39,000	1,544.00	60,216,000
オリンパス	107,700	3,255.00	350,563,500
理研計器	6,400	2,085.00	13,344,000
タムロン	6,600	1,660.00	10,956,000
H O Y A	145,800	6,521.00	950,761,800
シード	3,500	1,270.00	4,445,000
ノーリツ鋼機	5,900	1,666.00	9,829,400
エー・アンド・デイ	7,900	768.00	6,067,200
朝日インテック	26,200	4,895.00	128,249,000
シチズン時計	78,400	552.00	43,276,800
リズム時計工業	3,500	1,975.00	6,912,500
大研医器	8,500	665.00	5,652,500

メニコン	9,900	2,734.00	27,066,600
松風	4,500	1,062.00	4,779,000
セイコーホールディングス	11,100	2,254.00	25,019,400
ニプロ	49,900	1,388.00	69,261,200
スノーピーク	3,400	1,206.00	4,100,400
パラマウントベッドホールディングス	8,300	4,800.00	39,840,000
トランザクション	5,100	663.00	3,381,300
ニホンフラッシュ	3,600	1,717.00	6,181,200
前田工織	8,100	2,670.00	21,627,000
永大産業	16,800	435.00	7,308,000
アートネイチャー	10,700	654.00	6,997,800
バンダイナムコホールディングス	74,800	4,840.00	362,032,000
S H O E I	3,600	4,080.00	14,688,000
フランスベッドホールディングス	12,800	918.00	11,750,400
パイロットコーポレーション	12,700	5,650.00	71,755,000
萩原工業	4,700	1,672.00	7,858,400
トッパン・フォームズ	15,300	892.00	13,647,600
フジシールインターナショナル	16,100	3,630.00	58,443,000
タカラトミー	30,400	1,213.00	36,875,200
廣濟堂	12,500	368.00	4,600,000
プロネクサス	7,900	995.00	7,860,500
大建工業	5,800	1,991.00	11,547,800
凸版印刷	101,500	1,695.00	172,042,500
大日本印刷	101,700	2,410.00	245,097,000
図書印刷	8,100	730.00	5,913,000
共同印刷	3,300	2,454.00	8,098,200
N I S S H A	14,900	1,433.00	21,351,700
宝印刷	5,100	1,734.00	8,843,400
アシックス	72,200	1,491.00	107,650,200
ヤマハ	43,000	5,060.00	217,580,000
河合楽器製作所	2,500	3,205.00	8,012,500
クリナップ	9,500	658.00	6,251,000
ピジョン	43,900	4,915.00	215,768,500
キングジム	8,800	846.00	7,444,800
リンテック	17,500	2,424.00	42,420,000
イトーキ	15,800	609.00	9,622,200
任天堂	44,600	30,000.00	1,338,000,000
三菱鉛筆	11,800	2,102.00	24,803,600
タカラスタンダード	14,300	1,732.00	24,767,600
コクヨ	35,000	1,611.00	56,385,000
ナカバヤシ	10,000	536.00	5,360,000
グローブライド	3,900	2,538.00	9,898,200



オカムラ	24,900	1,439.00	35,831,100
美津濃	7,300	2,270.00	16,571,000
東京電力ホールディングス	577,000	716.00	413,132,000
中部電力	221,800	1,604.00	355,767,200
関西電力	295,800	1,657.00	490,140,600
中国電力	99,600	1,425.00	141,930,000
北陸電力	71,100	961.00	68,327,100
東北電力	168,200	1,458.00	245,235,600
四国電力	65,500	1,359.00	89,014,500
九州電力	148,300	1,326.00	196,645,800
北海道電力	68,500	803.00	55,005,500
沖縄電力	13,400	2,104.00	28,193,600
電源開発	57,500	2,688.00	154,560,000
エフオン	5,500	898.00	4,939,000
イーレックス	13,400	653.00	8,750,200
レノバ	8,200	899.00	7,371,800
東京瓦斯	142,000	2,776.00	394,192,000
大阪瓦斯	139,800	2,062.00	288,267,600
東邦瓦斯	35,800	4,585.00	164,143,000
北海道瓦斯	5,000	1,521.00	7,605,000
広島ガス	20,500	345.00	7,072,500
西部瓦斯	8,200	2,490.00	20,418,000
静岡ガス	22,200	907.00	20,135,400
メタウォーター	3,800	3,020.00	11,476,000
SBSホールディングス	7,800	1,446.00	11,278,800
東武鉄道	76,000	3,085.00	234,460,000
相鉄ホールディングス	24,900	3,335.00	83,041,500
東京急行電鉄	195,600	1,828.00	357,556,800
京浜急行電鉄	99,300	1,844.00	183,109,200
小田急電鉄	115,400	2,454.00	283,191,600
京王電鉄	40,300	6,560.00	264,368,000
京成電鉄	54,100	3,545.00	191,784,500
富士急行	9,900	3,240.00	32,076,000
新京成電鉄	3,400	2,134.00	7,255,600
東日本旅客鉄道	128,800	9,958.00	1,282,590,400
西日本旅客鉄道	65,100	7,875.00	512,662,500
東海旅客鉄道	64,900	22,900.00	1,486,210,000
西武ホールディングス	92,400	2,045.00	188,958,000
鴻池運輸	11,200	1,644.00	18,412,800
西日本鉄道	20,400	2,818.00	57,487,200
ハマキョウレックス	5,500	3,710.00	20,405,000
サカイ引越センター	3,800	5,820.00	22,116,000

近鉄グループホールディングス	68,100	4,790.00	326,199,000
阪急阪神ホールディングス	91,000	3,760.00	342,160,000
南海電気鉄道	30,900	2,937.00	90,753,300
京阪ホールディングス	30,400	4,640.00	141,056,000
神戸電鉄	2,700	3,940.00	10,638,000
名古屋鉄道	54,600	2,858.00	156,046,800
山陽電気鉄道	6,000	2,203.00	13,218,000
日本通運	26,900	6,430.00	172,967,000
ヤマトホールディングス	120,600	3,092.00	372,895,200
山九	19,000	5,290.00	100,510,000
丸全昭和運輸	5,600	2,816.00	15,769,600
センコーグループホールディングス	37,700	836.00	31,517,200
トナミホールディングス	1,800	5,640.00	10,152,000
ニッコンホールディングス	26,200	2,673.00	70,032,600
福山通運	8,700	4,435.00	38,584,500
セイノーホールディングス	51,500	1,525.00	78,537,500
神奈川中央交通	2,500	3,755.00	9,387,500
日立物流	14,500	2,985.00	43,282,500
丸和運輸機関	3,800	2,973.00	11,297,400
C & F ロジホールディングス	8,600	1,188.00	10,216,800
九州旅客鉄道	57,700	3,750.00	216,375,000
S Gホールディングス	64,900	2,885.00	187,236,500
日本郵船	56,900	1,839.00	104,639,100
商船三井	40,500	2,586.00	104,733,000
川崎汽船	21,700	1,475.00	32,007,500
N S ユナイテッド海運	4,100	3,200.00	13,120,000
飯野海運	34,300	410.00	14,063,000
乾汽船	8,000	886.00	7,088,000
日本航空	125,800	3,960.00	498,168,000
A N Aホールディングス	125,700	3,984.00	500,788,800
トランコム	2,000	6,020.00	12,040,000
日新	6,200	1,868.00	11,581,600
三菱倉庫	23,800	2,629.00	62,570,200
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,880.00	16,168,000
住友倉庫	26,100	1,365.00	35,626,500
澁澤倉庫	5,500	1,597.00	8,783,500
東陽倉庫	25,300	289.00	7,311,700
日本トランスシティ	19,500	441.00	8,599,500
川西倉庫	2,600	1,387.00	3,606,200
安田倉庫	8,700	792.00	6,890,400
東洋埠頭	3,600	1,434.00	5,162,400
上組	42,200	2,323.00	98,030,600

キューソー流通システム	2,300	2,206.00	5,073,800
近鉄エクスプレス	12,600	1,692.00	21,319,200
エーアイテーター	5,400	943.00	5,092,200
NEC ネットズエスアイ	7,700	2,493.00	19,196,100
システナ	25,300	1,387.00	35,091,100
デジタルアーツ	3,900	6,440.00	25,116,000
新日鉄住金ソリューションズ	10,400	2,778.00	28,891,200
キューブシステム	6,400	669.00	4,281,600
コア	4,400	1,238.00	5,447,200
ソリトンシステムズ	5,300	792.00	4,197,600
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,520.00	6,688,000
T I S	23,700	4,750.00	112,575,000
ネオス	3,200	1,294.00	4,140,800
電算システム	3,900	2,296.00	8,954,400
グリー	38,700	439.00	16,989,300
コーエーテクモホールディングス	14,600	1,892.00	27,623,200
三菱総合研究所	3,000	3,260.00	9,780,000
ファインデックス	8,100	613.00	4,965,300
ブレインパッド	1,600	6,450.00	10,320,000
K L a b	13,000	876.00	11,388,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,000	1,928.00	9,640,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,647.00	2,799,900
ネクソン	181,200	1,374.00	248,968,800
アイスタイル	18,400	916.00	16,854,400
エムアップ	2,700	1,958.00	5,286,600
エイチーム	4,900	1,517.00	7,433,300
テクノスジャパン	6,900	814.00	5,616,600
コロプラ	20,800	805.00	16,744,000
ブロードリーフ	36,300	582.00	21,126,600
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,649.00	7,090,700
メディアドゥホールディングス	2,600	2,423.00	6,299,800
じげん	9,300	537.00	4,994,100
フィックスターズ	7,300	1,112.00	8,117,600
VOYAGE GROUP	4,800	1,056.00	5,068,800
オブティム	1,800	4,735.00	8,523,000
セレス	2,800	1,814.00	5,079,200
ティーガイア	6,900	2,123.00	14,648,700
セック	1,400	3,775.00	5,285,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,053.00	7,476,300
テクマトリックス	5,400	1,805.00	9,747,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	174,500	214.00	37,343,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,800	5,090.00	60,062,000

システムリサーチ	1,200	2,814.00	3,376,800
インターネットイニシアティブ	11,700	2,421.00	28,325,700
さくらインターネット	10,500	483.00	5,071,500
ヴィンクス	2,700	1,373.00	3,707,100
GMOクラウド	2,000	3,295.00	6,590,000
S R Aホールディングス	4,100	2,682.00	10,996,200
e B A S E	2,900	1,599.00	4,637,100
アドソル日進	3,000	1,832.00	5,496,000
フリービット	5,800	822.00	4,767,600
コムチュア	4,200	2,725.00	11,445,000
アステリア	4,400	769.00	3,383,600
マークライنز	3,300	1,228.00	4,052,400
メディカル・データ・ビジョン	7,000	983.00	6,881,000
g u m i	9,100	553.00	5,032,300
モバイルファクトリー	2,500	1,159.00	2,897,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,493.00	5,374,800
P C Iホールディングス	1,700	2,182.00	3,709,400
オープンドア	3,800	2,412.00	9,165,600
マイネット	2,700	2,004.00	5,410,800
アカツキ	2,600	5,580.00	14,508,000
L I N E	21,800	3,775.00	82,295,000
チェンジ	500	7,220.00	3,610,000
オークネット	5,200	1,029.00	5,350,800
A O I T Y O H o l d i n g s	8,300	854.00	7,088,200
マクロミル	9,400	1,527.00	14,353,800
オロ	900	4,345.00	3,910,500
フェイス	4,500	935.00	4,207,500
野村総合研究所	45,100	4,490.00	202,499,000
サイバネットシステム	7,600	584.00	4,438,400
インテージホールディングス	10,700	910.00	9,737,000
ソースネクスト	28,200	613.00	17,286,600
フォーカスシステムズ	6,000	1,019.00	6,114,000
クレスコ	2,400	3,095.00	7,428,000
フジ・メディア・ホールディングス	74,200	1,556.00	115,455,200
オービック	24,600	9,120.00	224,352,000
ジャストシステム	10,200	2,296.00	23,419,200
T D C ソフト	7,100	862.00	6,120,200
ヤフー	464,500	278.00	129,131,000
トレンドマイクロ	37,900	6,300.00	238,770,000
日本オラクル	11,500	6,950.00	79,925,000
アルファシステムズ	2,900	2,661.00	7,716,900
フューチャー	10,100	1,553.00	15,685,300

CAC Holdings	7,700	1,001.00	7,707,700
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	1,843.00	6,081,900
オービックビジネスコンサルタント	3,600	9,220.00	33,192,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,400	2,123.00	68,785,200
アイティフォー	9,900	702.00	6,949,800
大塚商会	38,500	3,275.00	126,087,500
サイボウズ	10,200	649.00	6,619,800
電通国際情報サービス	4,500	2,992.00	13,464,000
デジタルガレージ	14,000	2,715.00	38,010,000
EMシステムズ	7,200	1,044.00	7,516,800
ウェザーニューズ	3,000	3,010.00	9,030,000
C I J	9,000	706.00	6,354,000
WOWOW	3,600	3,070.00	11,052,000
スカラ	7,400	760.00	5,624,000
IMAGICA GROUP	7,400	532.00	3,936,800
ネットワンシステムズ	25,400	2,128.00	54,051,200
アルゴグラフィックス	3,100	3,930.00	12,183,000
マーベラス	12,200	834.00	10,174,800
エイベックス	12,300	1,507.00	18,536,100
日本ユニシス	22,000	2,744.00	60,368,000
兼松エレクトロニクス	3,900	3,260.00	12,714,000
東京放送ホールディングス	47,400	1,779.00	84,324,600
日本テレビホールディングス	65,500	1,688.00	110,564,000
朝日放送グループホールディングス	10,500	729.00	7,654,500
テレビ朝日ホールディングス	20,000	2,067.00	41,340,000
スカパーJ S A Tホールディングス	54,400	491.00	26,710,400
テレビ東京ホールディングス	5,900	2,427.00	14,319,300
ビジョン	2,300	4,000.00	9,200,000
USEN - NEXT HOLDINGS	3,400	967.00	3,287,800
コネクシオ	5,500	1,322.00	7,271,000
日本電信電話	486,300	4,558.00	2,216,555,400
KDDI	626,500	2,651.00	1,660,851,500
光通信	8,400	17,590.00	147,756,000
NTTドコモ	510,200	2,504.50	1,277,795,900
エムティーアイ	10,200	524.00	5,344,800
GMOインターネット	26,100	1,393.00	36,357,300
カドカワ	20,900	1,204.00	25,163,600
学研ホールディングス	2,600	4,235.00	11,011,000
ゼンリン	14,100	2,549.00	35,940,900
アイネット	5,200	1,421.00	7,389,200
松竹	4,900	10,860.00	53,214,000
東宝	46,800	3,785.00	177,138,000

東映	3,000	12,760.00	38,280,000
エヌ・ティ・ティ・データ	188,500	1,273.00	239,960,500
D T S	7,800	3,625.00	28,275,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,300	3,085.00	102,730,500
シーイーシー	7,700	1,961.00	15,099,700
カプコン	31,000	2,104.00	65,224,000
アイ・エス・ビー	1,800	2,008.00	3,614,400
ジャステック	5,800	972.00	5,637,600
S C S K	18,800	3,975.00	74,730,000
日本システムウエア	2,800	1,915.00	5,362,000
アイネス	10,100	1,149.00	11,604,900
T K C	5,900	3,735.00	22,036,500
富士ソフト	10,500	4,310.00	45,255,000
N S D	11,300	2,158.00	24,385,400
コナミホールディングス	29,100	4,835.00	140,698,500
福井コンピュータホールディングス	3,000	1,481.00	4,443,000
J B C Cホールディングス	6,600	1,706.00	11,259,600
ミロク情報サービス	7,300	2,418.00	17,651,400
ソフトバンクグループ	297,200	8,184.00	2,432,284,800
伊藤忠食品	1,900	4,780.00	9,082,000
エレマテック	3,800	2,018.00	7,668,400
J A L U X	2,400	2,591.00	6,218,400
あらた	4,000	4,450.00	17,800,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,732.00	6,581,600
フィールズ	7,800	836.00	6,520,800
双日	393,000	403.00	158,379,000
アルフレッサ ホールディングス	79,000	2,952.00	233,208,000
横浜冷凍	19,800	988.00	19,562,400
アルコニックス	8,700	1,144.00	9,952,800
神戸物産	10,700	3,270.00	34,989,000
あい ホールディングス	11,700	1,985.00	23,224,500
ダイワボウホールディングス	6,500	5,130.00	33,345,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,400	1,467.00	28,459,800
ラクト・ジャパン	1,600	7,110.00	11,376,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,600	1,129.00	15,354,400
八洲電機	9,000	791.00	7,119,000
U K Cホールディングス	5,200	2,049.00	10,654,800
ジュテックホールディングス	2,900	947.00	2,746,300
T O K A Iホールディングス	37,000	914.00	33,818,000
三洋貿易	4,400	1,772.00	7,796,800
ウイン・パートナーズ	5,300	968.00	5,130,400
シップヘルスケアホールディングス	14,800	4,320.00	63,936,000

コメダホールディングス	16,900	2,248.00	37,991,200
小野建	7,100	1,603.00	11,381,300
佐島電機	6,800	917.00	6,235,600
伯東	5,700	1,171.00	6,674,700
コンドーテック	8,000	1,002.00	8,016,000
ナガイレーベン	10,600	2,614.00	27,708,400
三菱食品	7,500	2,920.00	21,900,000
松田産業	6,200	1,511.00	9,368,200
第一興商	10,800	5,080.00	54,864,000
メディバルホールディングス	76,900	2,437.00	187,405,300
S P K	2,000	2,330.00	4,660,000
萩原電気ホールディングス	3,200	2,837.00	9,078,400
アズワン	5,100	7,680.00	39,168,000
尾家産業	4,100	1,297.00	5,317,700
シモジマ	5,200	1,117.00	5,808,400
ドウシシャ	6,600	1,810.00	11,946,000
高速	6,500	1,021.00	6,636,500
丸文	9,000	747.00	6,723,000
ハピネット	6,500	1,509.00	9,808,500
日本ライフライン	22,300	1,510.00	33,673,000
エクセル	3,300	2,009.00	6,629,700
マルカキカイ	3,100	2,021.00	6,265,100
I D O M	25,400	399.00	10,134,600
日本エム・ディ・エム	4,800	1,141.00	5,476,800
進和	4,800	2,063.00	9,902,400
ダイトロン	3,900	1,296.00	5,054,400
シークス	9,200	1,497.00	13,772,400
オーハシテクニカ	5,700	1,312.00	7,478,400
白銅	3,500	1,596.00	5,586,000
伊藤忠商事	499,000	1,967.00	981,533,000
丸紅	704,400	798.40	562,392,960
長瀬産業	40,400	1,518.00	61,327,200
蝶理	5,400	1,700.00	9,180,000
豊田通商	79,100	3,395.00	268,544,500
三共生興	17,400	422.00	7,342,800
兼松	27,800	1,348.00	37,474,400
三井物産	588,000	1,688.50	992,838,000
日本紙パルプ商事	4,100	4,425.00	18,142,500
日立ハイテクノロジーズ	21,800	3,500.00	76,300,000
カメイ	9,900	1,226.00	12,137,400
スターゼン	2,800	3,790.00	10,612,000
山善	26,800	1,039.00	27,845,200

椿本興業	2,200	3,135.00	6,897,000
住友商事	422,000	1,613.50	680,897,000
内田洋行	3,900	2,617.00	10,206,300
三菱商事	500,600	3,068.00	1,535,840,800
第一実業	3,500	3,620.00	12,670,000
キャノンマーケティングジャパン	20,800	1,953.00	40,622,400
西華産業	4,800	1,534.00	7,363,200
佐藤商事	8,000	879.00	7,032,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,559.00	12,160,200
東京産業	9,400	514.00	4,831,600
ユアサ商事	7,000	3,235.00	22,645,000
神鋼商事	2,000	2,505.00	5,010,000
阪和興業	12,600	2,862.00	36,061,200
正栄食品工業	3,800	3,120.00	11,856,000
カナデン	8,200	1,299.00	10,651,800
菱電商事	6,900	1,457.00	10,053,300
フルサト工業	5,200	1,639.00	8,522,800
岩谷産業	16,200	3,715.00	60,183,000
極東貿易	3,000	1,470.00	4,410,000
イワキ	10,800	464.00	5,011,200
三愛石油	19,000	1,068.00	20,292,000
稲畑産業	16,500	1,477.00	24,370,500
ワキタ	15,900	1,198.00	19,048,200
東邦ホールディングス	21,300	2,827.00	60,215,100
サンゲツ	22,300	2,052.00	45,759,600
ミツウロコグループホールディングス	11,900	665.00	7,913,500
シナネンホールディングス	3,600	2,440.00	8,784,000
伊藤忠エネクス	15,200	992.00	15,078,400
サンリオ	22,500	2,331.00	52,447,500
サンワテクノス	5,700	1,061.00	6,047,700
リョーサン	8,200	2,926.00	23,993,200
新光商事	7,400	1,757.00	13,001,800
トーヨー	4,100	2,235.00	9,163,500
三信電気	6,200	1,790.00	11,098,000
東陽テクニカ	11,000	817.00	8,987,000
モスフードサービス	9,200	2,896.00	26,643,200
加賀電子	7,200	2,039.00	14,680,800
ソーダニッカ	10,300	529.00	5,448,700
立花エレテック	6,100	1,592.00	9,711,200
PALTAC	12,700	5,600.00	71,120,000
太平洋興発	5,400	824.00	4,449,600
西本Wismettacホールディングス	1,800	4,690.00	8,442,000



ヤマタネ	4,800	1,669.00	8,011,200
日鉄住金物産	4,800	4,620.00	22,176,000
泉州電業	3,000	2,862.00	8,586,000
トラスコ中山	14,600	2,986.00	43,595,600
オートバックスセブン	29,300	1,755.00	51,421,500
モリト	7,400	815.00	6,031,000
加藤産業	10,800	3,230.00	34,884,000
イノテック	5,800	969.00	5,620,200
イエローハット	6,700	2,703.00	18,110,100
J Kホールディングス	10,000	556.00	5,560,000
日伝	6,600	1,566.00	10,335,600
杉本商事	4,800	1,679.00	8,059,200
因幡電機産業	9,800	4,285.00	41,993,000
バイテックホールディングス	3,000	2,040.00	6,120,000
東テク	2,800	2,416.00	6,764,800
ミスミグループ本社	89,300	2,439.00	217,802,700
タキヒヨー	3,400	1,849.00	6,286,600
スズケン	32,500	5,910.00	192,075,000
ジェコス	6,500	1,060.00	6,890,000
ローソン	18,100	7,070.00	127,967,000
サンエー	5,300	4,465.00	23,664,500
カワチ薬品	6,000	1,889.00	11,334,000
エービーシー・マート	11,200	6,060.00	67,872,000
アスクル	6,300	2,553.00	16,083,900
ゲオホールディングス	11,000	1,652.00	18,172,000
アダストリア	10,200	1,990.00	20,298,000
くらコーポレーション	4,200	5,570.00	23,394,000
キャンドウ	5,100	1,650.00	8,415,000
パルグループホールディングス	4,000	2,783.00	11,132,000
エディオン	29,800	1,098.00	32,720,400
サーラコーポレーション	16,600	644.00	10,690,400
ハローズ	3,100	2,304.00	7,142,400
あみやき亭	1,900	3,725.00	7,077,500
ひらまつ	19,600	331.00	6,487,600
大黒天物産	2,000	4,255.00	8,510,000
ハニーズホールディングス	8,800	801.00	7,048,800
アルペン	6,000	1,758.00	10,548,000
クオールホールディングス	10,600	1,809.00	19,175,400
ジンズ	4,900	6,210.00	30,429,000
ビックカメラ	37,600	1,514.00	56,926,400
D C Mホールディングス	37,800	1,104.00	41,731,200
ペッパーフードサービス	5,700	3,330.00	18,981,000

MonotaRO	45,200	2,923.00	132,119,600
DDホールディングス	2,000	2,208.00	4,416,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	2,323.00	12,776,500
J.フロント リテイリング	91,500	1,456.00	133,224,000
ドトール・日レスホールディングス	12,300	2,138.00	26,297,400
マツモトキヨシホールディングス	29,500	3,675.00	108,412,500
ブロンコピリー	3,900	2,814.00	10,974,600
ZOZO	77,400	2,383.00	184,444,200
物語コーポレーション	2,100	9,440.00	19,824,000
ココカラファイン	7,900	5,600.00	44,240,000
三越伊勢丹ホールディングス	133,500	1,311.00	175,018,500
Hamee	2,200	1,140.00	2,508,000
ウエルシアホールディングス	18,800	5,560.00	104,528,000
クリエイトSDホールディングス	10,200	2,731.00	27,856,200
チムニー	2,800	2,611.00	7,310,800
シュッピン	5,500	818.00	4,499,000
ネクステージ	11,000	1,066.00	11,726,000
ジョイフル本田	20,500	1,492.00	30,586,000
鳥貴族	2,900	1,920.00	5,568,000
キリン堂ホールディングス	3,400	1,427.00	4,851,800
ホットランド	5,100	1,376.00	7,017,600
すかいらーくホールディングス	66,800	1,869.00	124,849,200
綿半ホールディングス	3,100	2,284.00	7,080,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19,500	1,217.00	23,731,500
あさひ	6,700	1,313.00	8,797,100
日本調剤	2,700	3,535.00	9,544,500
コスモス薬品	3,600	19,430.00	69,948,000
セブン&アイ・ホールディングス	299,000	4,853.00	1,451,047,000
薬王堂	3,300	2,867.00	9,461,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,800	1,244.00	23,387,200
ツルハホールディングス	15,500	10,160.00	157,480,000
サンマルクホールディングス	5,500	2,635.00	14,492,500
トリドールホールディングス	8,900	2,046.00	18,209,400
TOKYO BASE	7,300	586.00	4,277,800
ジャパンミート	3,100	2,113.00	6,550,300
ダイユー・リックホールディングス	5,000	984.00	4,920,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	965.00	6,658,500
クスリのアオキホールディングス	5,600	7,290.00	40,824,000
スシローグローバルホールディングス	7,900	6,230.00	49,217,000
LIXILピバ	6,600	1,764.00	11,642,400
メディカルシステムネットワーク	10,100	383.00	3,868,300

ノジマ	12,500	2,262.00	28,275,000
カップ・クリエイト	11,200	1,386.00	15,523,200
ライトオン	7,600	884.00	6,718,400
良品計画	10,100	28,390.00	286,739,000
三城ホールディングス	14,500	420.00	6,090,000
アドヴァン	12,300	955.00	11,746,500
アルビス	3,100	2,443.00	7,573,300
コナカ	13,800	453.00	6,251,400
G - 7ホールディングス	2,600	2,343.00	6,091,800
イオン北海道	10,100	794.00	8,019,400
コジマ	12,800	508.00	6,502,400
コーナン商事	9,400	2,707.00	25,445,800
エコス	3,100	2,068.00	6,410,800
ワタミ	10,300	1,316.00	13,554,800
ドンキホーテホールディングス	46,300	7,110.00	329,193,000
西松屋チェーン	15,900	878.00	13,960,200
ゼンショーホールディングス	33,900	2,743.00	92,987,700
幸楽苑ホールディングス	6,200	2,197.00	13,621,400
サイゼリヤ	11,700	1,957.00	22,896,900
V Tホールディングス	26,000	427.00	11,102,000
ユナイテッドアローズ	8,200	3,915.00	32,103,000
ハイデイ日高	9,200	2,222.00	20,442,400
コロワイド	24,100	2,506.00	60,394,600
ピーシーデポコーポレーション	11,400	426.00	4,856,400
壱番屋	5,000	4,535.00	22,675,000
スギホールディングス	15,800	4,640.00	73,312,000
ヴィア・ホールディングス	11,800	692.00	8,165,600
スクロール	13,700	405.00	5,548,500
ヨンドシーホールディングス	8,100	2,281.00	18,476,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	19,900	16,720.00	332,728,000
木曽路	8,800	2,530.00	22,264,000
S R Sホールディングス	10,700	995.00	10,646,500
ケーヨー	17,000	507.00	8,619,000
上新電機	8,400	2,450.00	20,580,000
日本瓦斯	13,100	4,050.00	53,055,000
ロイヤルホールディングス	12,300	2,669.00	32,828,700
いなげや	8,500	1,402.00	11,917,000
島忠	16,400	2,983.00	48,921,200
チヨダ	7,500	1,853.00	13,897,500
ライフコーポレーション	5,300	2,417.00	12,810,100
リンガーハット	9,000	2,327.00	20,943,000
MrMaxHD	11,800	481.00	5,675,800

A O K Iホールディングス	14,200	1,295.00	18,389,000
オークワ	11,000	1,162.00	12,782,000
コメリ	11,300	2,427.00	27,425,100
青山商事	14,100	2,642.00	37,252,200
しまむら	8,400	8,800.00	73,920,000
高島屋	56,500	1,509.00	85,258,500
松屋	14,900	1,161.00	17,298,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,800	1,694.00	62,339,200
近鉄百貨店	3,000	3,480.00	10,440,000
パルコ	7,700	1,154.00	8,885,800
丸井グループ	60,500	2,246.00	135,883,000
アクシアル リテイリング	5,700	3,770.00	21,489,000
イオン	274,500	2,465.00	676,642,500
イズミ	14,600	5,570.00	81,322,000
平和堂	14,100	2,834.00	39,959,400
フジ	8,800	1,892.00	16,649,600
ヤオコー	7,800	6,190.00	48,282,000
ゼビオホールディングス	9,100	1,248.00	11,356,800
ケーズホールディングス	74,600	1,080.00	80,568,000
O l y m p i cグループ	5,800	792.00	4,593,600
日産東京販売ホールディングス	17,800	320.00	5,696,000
Genky DrugStores	3,000	3,390.00	10,170,000
総合メディカルホールディングス	6,200	2,222.00	13,776,400
アインホールディングス	9,600	8,510.00	81,696,000
元気寿司	2,200	4,435.00	9,757,000
ヤマダ電機	219,500	534.00	117,213,000
アークランドサカモト	12,100	1,413.00	17,097,300
ニトリホールディングス	30,900	14,585.00	450,676,500
グルメ杵屋	8,200	1,165.00	9,553,000
吉野家ホールディングス	26,100	1,833.00	47,841,300
松屋フーズホールディングス	3,400	3,670.00	12,478,000
サガミホールディングス	10,400	1,332.00	13,852,800
関西スーパーマーケット	6,900	994.00	6,858,600
王将フードサービス	5,200	7,680.00	39,936,000
プレナス	7,900	1,900.00	15,010,000
ミニストップ	5,600	2,140.00	11,984,000
アークス	13,100	2,539.00	33,260,900
パローホールディングス	15,600	2,662.00	41,527,200
ベルク	3,400	5,430.00	18,462,000
大庄	5,500	1,612.00	8,866,000
ファーストリテイリング	9,500	59,000.00	560,500,000
サンドラッグ	26,900	3,560.00	95,764,000

サクスパー ホールディングス	7,300	1,146.00	8,365,800
ペルーナ	17,300	1,058.00	18,303,400
じもとホールディングス	60,300	128.00	7,718,400
めぶきフィナンシャルグループ	365,500	302.00	110,381,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,720.00	17,200,000
九州フィナンシャルグループ	115,200	449.00	51,724,800
ゆうちょ銀行	201,400	1,231.00	247,923,400
富山第一銀行	21,600	396.00	8,553,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	453,300	437.00	198,092,100
西日本フィナンシャルホールディングス	45,900	1,013.00	46,496,700
関西みらいフィナンシャルグループ	33,300	760.00	25,308,000
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,693.00	11,851,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,400	3,130.00	38,812,000
新生銀行	51,600	1,389.00	71,672,400
あおぞら銀行	39,900	3,460.00	138,054,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,976,000	568.30	2,827,860,800
りそなホールディングス	780,300	542.30	423,156,690
三井住友トラスト・ホールディングス	140,500	4,183.00	587,711,500
三井住友フィナンシャルグループ	503,500	3,851.00	1,938,978,500
千葉銀行	250,800	633.00	158,756,400
群馬銀行	140,800	476.00	67,020,800
武蔵野銀行	10,600	2,538.00	26,902,800
千葉興業銀行	23,600	376.00	8,873,600
筑波銀行	36,800	201.00	7,396,800
七十七銀行	22,400	1,963.00	43,971,200
青森銀行	6,100	2,827.00	17,244,700
秋田銀行	5,300	2,223.00	11,781,900
山形銀行	8,200	2,076.00	17,023,200
岩手銀行	5,100	3,740.00	19,074,000
東邦銀行	63,400	312.00	19,780,800
東北銀行	5,500	1,219.00	6,704,500
みちのく銀行	5,500	1,757.00	9,663,500
ふくおかフィナンシャルグループ	57,800	2,426.00	140,222,800
静岡銀行	177,700	902.00	160,285,400
十六銀行	9,600	2,407.00	23,107,200
スルガ銀行	69,800	432.00	30,153,600
八十二銀行	125,200	464.00	58,092,800
山梨中央銀行	9,300	1,433.00	13,326,900
大垣共立銀行	11,300	2,281.00	25,775,300
福井銀行	6,900	1,700.00	11,730,000
北國銀行	7,800	3,805.00	29,679,000
清水銀行	3,900	1,650.00	6,435,000

富山銀行	1,700	3,420.00	5,814,000
滋賀銀行	14,100	2,628.00	37,054,800
南都銀行	8,600	2,174.00	18,696,400
百五銀行	62,900	384.00	24,153,600
京都銀行	25,400	4,780.00	121,412,000
紀陽銀行	24,800	1,568.00	38,886,400
ほくほくフィナンシャルグループ	47,300	1,292.00	61,111,600
広島銀行	103,400	607.00	62,763,800
山陰合同銀行	42,000	791.00	33,222,000
中国銀行	45,500	947.00	43,088,500
伊予銀行	92,800	598.00	55,494,400
百十四銀行	7,800	2,593.00	20,225,400
四国銀行	11,100	1,287.00	14,285,700
阿波銀行	11,200	2,812.00	31,494,400
大分銀行	4,600	3,325.00	15,295,000
宮崎銀行	5,200	2,883.00	14,991,600
佐賀銀行	4,700	1,856.00	8,723,200
十八銀行	4,600	2,662.00	12,245,200
沖縄銀行	6,600	3,305.00	21,813,000
琉球銀行	17,000	1,145.00	19,465,000
セブン銀行	240,600	336.00	80,841,600
みずほフィナンシャルグループ	9,709,000	176.50	1,713,638,500
山口フィナンシャルグループ	88,200	1,110.00	97,902,000
名古屋銀行	6,000	3,425.00	20,550,000
北洋銀行	107,200	295.00	31,624,000
愛知銀行	2,800	4,015.00	11,242,000
中京銀行	3,700	2,256.00	8,347,200
大光銀行	3,500	1,826.00	6,391,000
愛媛銀行	11,000	1,061.00	11,671,000
京葉銀行	31,500	710.00	22,365,000
栃木銀行	39,200	248.00	9,721,600
北日本銀行	3,000	2,258.00	6,774,000
東和銀行	13,800	755.00	10,419,000
福島銀行	10,000	439.00	4,390,000
トモニホールディングス	57,000	431.00	24,567,000
フィデアホールディングス	83,000	137.00	11,371,000
池田泉州ホールディングス	77,800	302.00	23,495,600
F P G	23,500	1,104.00	25,944,000
S B I ホールディングス	85,100	2,316.00	197,091,600
ジャフコ	11,700	3,590.00	42,003,000
大和証券グループ本社	572,700	608.60	348,545,220
野村ホールディングス	1,311,800	444.20	582,701,560

岡三証券グループ	61,400	516.00	31,682,400
丸三証券	23,000	814.00	18,722,000
東洋証券	32,000	177.00	5,664,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	86,000	493.00	42,398,000
水戸証券	24,000	276.00	6,624,000
いちよし証券	16,000	819.00	13,104,000
松井証券	34,900	1,205.00	42,054,500
マネックスグループ	68,400	385.00	26,334,000
カブドットコム証券	55,200	385.00	21,252,000
極東証券	10,000	1,179.00	11,790,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,211.00	9,688,000
藍澤証券	15,400	732.00	11,272,800
かんぽ生命保険	27,000	2,547.00	68,769,000
S O M P Oホールディングス	140,000	3,873.00	542,220,000
アニコム ホールディングス	6,200	3,545.00	21,979,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	186,300	3,216.00	599,140,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	58,500	2,214.00	129,519,000
第一生命ホールディングス	403,400	1,852.50	747,298,500
東京海上ホールディングス	259,000	5,331.00	1,380,729,000
T & Dホールディングス	220,000	1,423.00	313,060,000
アドバンスクリエイト	4,000	1,970.00	7,880,000
全国保証	20,500	3,580.00	73,390,000
アルヒ	7,000	2,298.00	16,086,000
クレディセゾン	50,400	1,304.00	65,721,600
芙蓉総合リース	8,200	5,640.00	46,248,000
興銀リース	13,900	2,483.00	34,513,700
東京センチュリー	14,300	4,860.00	69,498,000
日本証券金融	34,200	559.00	19,117,800
アイフル	113,300	289.00	32,743,700
リコーリース	5,900	3,285.00	19,381,500
イオンフィナンシャルサービス	45,500	2,084.00	94,822,000
アコム	143,700	389.00	55,899,300
ジャックス	8,900	1,845.00	16,420,500
オリエントコーポレーション	197,100	143.00	28,185,300
日立キャピタル	16,900	2,378.00	40,188,200
オリックス	477,000	1,659.00	791,343,000
三菱U F Jリース	162,300	535.00	86,830,500
日本取引所グループ	193,100	1,898.00	366,503,800
イー・ギャランティ	8,600	994.00	8,548,400
N E Cキャピタルソリューション	3,300	1,544.00	5,095,200
いちご	91,400	332.00	30,344,800
日本駐車場開発	90,400	149.00	13,469,600

ヒューリック	149,400	1,025.00	153,135,000
三栄建築設計	3,600	1,510.00	5,436,000
スター・マイカ	4,000	1,657.00	6,628,000
野村不動産ホールディングス	47,700	2,139.00	102,030,300
三重交通グループホールディングス	16,400	594.00	9,741,600
サムティ	10,200	1,298.00	13,239,600
ディア・ライフ	10,100	437.00	4,413,700
日本商業開発	5,100	1,651.00	8,420,100
プレサンスコーポレーション	11,400	1,470.00	16,758,000
ユニゾホールディングス	11,000	2,164.00	23,804,000
日本管理センター	5,800	953.00	5,527,400
フージャースホールディングス	17,400	651.00	11,327,400
オープンハウス	11,800	3,945.00	46,551,000
東急不動産ホールディングス	192,000	563.00	108,096,000
飯田グループホールディングス	59,300	2,043.00	121,149,900
ムゲンエステート	7,200	621.00	4,471,200
ハウスドゥ	2,900	1,107.00	3,210,300
パーク24	42,000	2,753.00	115,626,000
パラカ	2,800	1,720.00	4,816,000
三井不動産	379,100	2,658.00	1,007,647,800
三菱地所	500,900	1,867.00	935,180,300
平和不動産	13,900	1,782.00	24,769,800
東京建物	78,800	1,240.00	97,712,000
ダイビル	21,000	1,204.00	25,284,000
京阪神ビルディング	15,000	851.00	12,765,000
住友不動産	160,800	4,176.00	671,500,800
大京	10,800	2,952.00	31,881,600
テーオーシー	17,100	803.00	13,731,300
東京楽天地	1,800	4,760.00	8,568,000
レオパレス21	91,400	466.00	42,592,400
スターツコーポレーション	9,400	2,472.00	23,236,800
フジ住宅	11,800	854.00	10,077,200
空港施設	13,300	554.00	7,368,200
ゴールドクレスト	6,200	1,585.00	9,827,000
日本エスリード	4,200	1,520.00	6,384,000
日神不動産	13,500	456.00	6,156,000
日本エスコン	14,100	685.00	9,658,500
タカラレーベン	35,800	311.00	11,133,800
サンヨーハウジング名古屋	7,000	945.00	6,615,000
イオンモール	36,100	1,857.00	67,037,700
カチタス	8,100	2,808.00	22,744,800
トーセイ	10,800	918.00	9,914,400



エヌ・ティ・ティ都市開発	44,900	1,680.00	75,432,000
サンフロンティア不動産	10,500	1,123.00	11,791,500
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	894.00	7,330,800
日本空港ビルデング	22,900	3,910.00	89,539,000
日本工営	5,000	2,508.00	12,540,000
L I F U L L	24,400	754.00	18,397,600
ジェイエイシーリクルートメント	5,900	2,067.00	12,195,300
日本M & Aセンター	51,900	2,254.00	116,982,600
タケエイ	9,900	704.00	6,969,600
トラスト・テック	3,500	3,140.00	10,990,000
コシダカホールディングス	18,700	1,423.00	26,610,100
パソナグループ	7,000	1,176.00	8,232,000
リンクアンドモチベーション	12,900	867.00	11,184,300
G C A	8,500	701.00	5,958,500
エス・エム・エス	25,600	1,727.00	44,211,200
パーソルホールディングス	69,300	1,779.00	123,284,700
リニカル	4,400	1,500.00	6,600,000
クックパッド	23,900	334.00	7,982,600
学情	3,600	1,203.00	4,330,800
スタジオアリス	3,900	2,317.00	9,036,300
シミックホールディングス	4,400	1,797.00	7,906,800
総合警備保障	27,500	5,250.00	144,375,000
カカクコム	52,500	2,202.00	115,605,000
アイロムグループ	3,100	1,747.00	5,415,700
ルネサンス	4,300	2,224.00	9,563,200
ディップ	11,000	1,873.00	20,603,000
オプトホールディング	4,600	1,704.00	7,838,400
新日本科学	11,600	679.00	7,876,400
ツクイ	16,600	839.00	13,927,400
エムスリー	146,000	1,541.00	224,986,000
アウトソーシング	36,400	1,123.00	40,877,200
ウェルネット	8,400	1,009.00	8,475,600
ワールドホールディングス	2,200	2,295.00	5,049,000
ディー・エヌ・エー	37,600	1,937.00	72,831,200
博報堂D Yホールディングス	95,900	1,632.00	156,508,800
ぐるなび	11,200	708.00	7,929,600
エスアールジータカミヤ	9,400	690.00	6,486,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,362.00	8,580,600
ファンコミュニケーションズ	20,200	576.00	11,635,200
ライク	3,300	1,380.00	4,554,000
WDBホールディングス	3,400	2,499.00	8,496,600
バリューコマース	5,000	1,369.00	6,845,000

インフォマート	38,300	1,112.00	42,589,600
J Pホールディングス	25,400	266.00	6,756,400
E P Sホールディングス	10,500	1,834.00	19,257,000
プレステージ・インターナショナル	13,400	1,296.00	17,366,400
アミューズ	4,400	2,358.00	10,375,200
ドリームインキュベータ	2,900	1,517.00	4,399,300
クイック	4,700	1,322.00	6,213,400
ケネディクス	66,200	465.00	30,783,000
電通	84,300	5,070.00	427,401,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,000	1,979.00	5,937,000
ぴあ	2,100	4,195.00	8,809,500
イオンファンタジー	2,400	3,025.00	7,260,000
シーティーエス	9,200	644.00	5,924,800
ネクシィーズグループ	2,400	1,896.00	4,550,400
みらかホールディングス	19,800	2,601.00	51,499,800
アルプス技研	6,100	1,800.00	10,980,000
日本空調サービス	9,600	714.00	6,854,400
オリエンタルランド	81,800	11,395.00	932,111,000
ダスキン	19,000	2,490.00	47,310,000
明光ネットワークジャパン	10,400	938.00	9,755,200
ファルコホールディングス	5,200	1,523.00	7,919,600
ラウンドワン	21,800	1,142.00	24,895,600
リゾートトラスト	29,900	1,640.00	49,036,000
ビー・エム・エル	8,900	2,845.00	25,320,500
りらいあコミュニケーションズ	12,500	945.00	11,812,500
リソー教育	36,300	380.00	13,794,000
ユー・エス・エス	84,700	1,902.00	161,099,400
サイバーエージェント	42,800	4,705.00	201,374,000
楽天	323,000	827.00	267,121,000
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,004.00	4,919,600
テー・オー・ダブリュー	8,300	765.00	6,349,500
セントラルスポーツ	2,900	3,605.00	10,454,500
フルキャストホールディングス	6,800	1,848.00	12,566,400
エン・ジャパン	7,600	3,910.00	29,716,000
テクノプロ・ホールディングス	13,200	4,760.00	62,832,000
G u n o s y	4,400	3,065.00	13,486,000
イー・ガーディアン	3,600	2,294.00	8,258,400
ジャパンマテリアル	18,900	1,049.00	19,826,100
ベクトル	8,600	1,601.00	13,768,600
I B J	5,300	714.00	3,784,200
アサンテ	3,500	2,047.00	7,164,500
N・フィールド	5,300	1,007.00	5,337,100

バリューHR	2,200	1,932.00	4,250,400
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	3,810.00	7,239,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,513.00	5,598,100
アビスト	1,400	3,175.00	4,445,000
シグマクシス	4,400	835.00	3,674,000
ウィルグループ	5,400	945.00	5,103,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	368.00	4,232,000
リクルートホールディングス	496,000	2,757.00	1,367,472,000
エラン	2,600	2,727.00	7,090,200
日本郵政	565,900	1,272.00	719,824,800
ベルシステム24ホールディングス	11,800	1,353.00	15,965,400
鎌倉新書	5,400	1,540.00	8,316,000
LITALICO	2,000	1,815.00	3,630,000
エボラブルアジア	2,400	1,978.00	4,747,200
アトラエ	1,600	2,428.00	3,884,800
ストライク	1,900	2,382.00	4,525,800
ソラスト	17,000	1,237.00	21,029,000
インソース	2,500	2,047.00	5,117,500
キャリアインデックス	2,800	1,904.00	5,331,200
MS - Japan	3,200	1,350.00	4,320,000
グレイステクノロジー	2,200	1,928.00	4,241,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	1,787.00	8,041,500
日総工産	2,000	1,954.00	3,908,000
キュービーネットホールディングス	4,000	1,936.00	7,744,000
スプリックス	2,200	1,748.00	3,845,600
リログループ	37,800	2,762.00	104,403,600
東祥	4,300	3,800.00	16,340,000
エイチ・アイ・エス	12,200	3,790.00	46,238,000
共立メンテナンス	10,500	5,110.00	53,655,000
イチネンホールディングス	8,500	1,210.00	10,285,000
建設技術研究所	5,700	1,547.00	8,817,900
スペース	5,300	1,175.00	6,227,500
燦ホールディングス	2,300	2,363.00	5,434,900
東京テアトル	4,900	1,301.00	6,374,900
ナガワ	2,000	5,370.00	10,740,000
よみうりランド	2,300	3,900.00	8,970,000
東京都競馬	4,700	2,886.00	13,564,200
常磐興産	5,300	1,647.00	8,729,100
カナモト	10,400	3,090.00	32,136,000
東京ドーム	26,400	934.00	24,657,600
西尾レントオール	7,000	3,420.00	23,940,000
トランス・コスモス	7,700	2,458.00	18,926,600

乃村工藝社	16,100	2,713.00	43,679,300
藤田観光	3,300	2,996.00	9,886,800
KNT - CTホールディングス	4,300	1,121.00	4,820,300
日本管財	7,100	1,945.00	13,809,500
トーカイ	6,600	2,712.00	17,899,200
セコム	73,400	9,420.00	691,428,000
セントラル警備保障	3,400	5,400.00	18,360,000
丹青社	13,200	1,137.00	15,008,400
メイテック	9,000	4,610.00	41,490,000
応用地質	8,300	1,200.00	9,960,000
船井総研ホールディングス	14,200	1,775.00	25,205,000
オオバ	7,800	688.00	5,366,400
学究社	4,200	1,507.00	6,329,400
ベネッセホールディングス	25,500	2,928.00	74,664,000
イオンディライト	8,400	3,815.00	32,046,000
ナック	6,000	1,008.00	6,048,000
ニチイ学館	10,500	1,078.00	11,319,000
ダイセキ	11,600	2,380.00	27,608,000
合 計	82,245,700		159,635,332,250

## (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。

## S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,620	12,115
コール・ローン	6,949	-
親投資信託受益証券	32,281,902,133	28,583,031,599
未収入金	2,099,999	12,279,998
流動資産合計	32,284,014,701	28,595,323,712
資産合計	32,284,014,701	28,595,323,712
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,099,999	12,279,998
未払受託者報酬	4,309,702	3,929,903
未払委託者報酬	4,309,643	3,929,838

	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
その他未払費用	486,000	486,018
流動負債合計	11,205,344	20,625,757
負債合計	11,205,344	20,625,757
純資産の部		
元本等		
元本	25,080,240,082	22,091,971,252
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	7,192,569,275	6,482,726,703
元本等合計	32,272,809,357	28,574,697,955
純資産合計	32,272,809,357	28,574,697,955
負債純資産合計	32,284,014,701	28,595,323,712

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年6月21日 至平成30年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	25,080,240,082口	22,091,971,252口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2868円 (10,000口当たりの純資産額 12,868円)	1口当たり純資産額 1.2934円 (10,000口当たりの純資産額 12,934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 平成30年 6月21日 至 平成30年12月19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、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せん。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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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 平成30年 6月21日 至 平成30年12月19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	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
期首元本額	25,180,303,864円	24,238,325,216円
期中追加設定元本額	1,050,937,196円	803,281,399円
期中一部解約元本額	1,151,000,978円	2,949,635,363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
親投資信託受益証券	国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド	20,461,759,324	28,583,031,599	
合計		20,461,759,324	28,583,031,599	

## 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)

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	229,024,233	932,416,950
コール・ローン	283,208,063	-
国債証券	84,674,149,610	79,792,307,440
地方債証券	8,744,347,600	8,442,696,120
特殊債券	10,400,372,316	10,391,503,954
社債券	4,944,492,000	4,919,717,000
未収入金	94,661,200	-
未収利息	380,702,190	348,738,695
前払費用	4,867,871	4,674,191
流動資産合計	109,755,825,083	104,832,054,350



	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
資産合計	109,755,825,083	104,832,054,350
負債の部		
流動負債		
未払解約金	146,106,272	171,167,585
未払利息	784	-
その他未払費用	141	17,333
流動負債合計	146,107,197	171,184,918
負債合計	146,107,197	171,184,918
純資産の部		
元本等		
元本	78,917,892,696	74,925,630,281
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,691,825,190	29,735,239,151
元本等合計	109,609,717,886	104,660,869,432
純資産合計	109,609,717,886	104,660,869,432
負債純資産合計	109,755,825,083	104,832,054,350

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年6月21日 至平成30年12月19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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	78,917,892,696口	74,925,630,281口
2. 1単位当たり純資産の額	1.3889円 (10,000口当たりの純資産額 13,889円)	1.3969円 (10,000口当たりの純資産額 13,969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 平成30年 6月21日 至 平成30年12月19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せん。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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 6月21日 至 平成30年12月19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)

(平成29年12月19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	80,438,898,647円

同期中における追加設定元本額	4,039,747,833円
同期中における一部解約元本額	5,560,753,784円
平成29年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	42,279,276,152円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	13,281,876,866円
国内債券インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	113,956,084円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	23,242,783,594円
合計	78,917,892,696円

(平成30年12月19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	77,206,605,986円
同期中における追加設定元本額	5,382,542,868円
同期中における一部解約元本額	7,663,518,573円
平成30年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	46,395,482,516円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	7,964,732,498円
国内債券インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	103,655,943円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	20,461,759,324円
合計	74,925,630,281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

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第125回利付国債(5年)	20,000,000	20,091,200	
	第126回利付国債(5年)	340,000,000	341,771,400	
	第127回利付国債(5年)	1,225,000,000	1,232,178,500	
	第128回利付国債(5年)	655,000,000	659,270,600	
	第129回利付国債(5年)	405,000,000	407,851,200	
	第130回利付国債(5年)	440,000,000	443,379,200	
	第131回利付国債(5年)	955,000,000	962,945,600	
	第132回利付国債(5年)	275,000,000	277,417,250	
	第133回利付国債(5年)	450,000,000	454,239,000	

第134回利付国債(5年)	850,000,000	858,551,000	
第135回利付国債(5年)	750,000,000	758,175,000	
第136回利付国債(5年)	850,000,000	859,817,500	
第2回利付国債(40年)	132,000,000	182,792,280	
第3回利付国債(40年)	140,000,000	194,839,400	
第4回利付国債(40年)	190,000,000	265,677,000	
第5回利付国債(40年)	197,000,000	264,996,520	
第6回利付国債(40年)	200,000,000	264,108,000	
第7回利付国債(40年)	220,000,000	277,875,400	
第8回利付国債(40年)	250,000,000	292,970,000	
第9回利付国債(40年)	371,000,000	316,603,980	
第10回利付国債(40年)	363,000,000	366,121,800	
第11回利付国債(40年)	165,000,000	160,446,000	
第310回利付国債(10年)	1,205,000,000	1,229,425,350	
第312回利付国債(10年)	985,000,000	1,011,772,300	
第313回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,053,456,000	
第315回利付国債(10年)	1,165,000,000	1,204,586,700	
第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,138,126,000	
第319回利付国債(10年)	590,000,000	612,219,400	
第320回利付国債(10年)	575,000,000	594,923,750	
第321回利付国債(10年)	395,000,000	409,816,450	
第322回利付国債(10年)	460,000,000	475,755,000	
第323回利付国債(10年)	295,000,000	305,838,300	
第324回利付国債(10年)	545,000,000	563,110,350	
第325回利付国債(10年)	345,000,000	357,292,350	
第326回利付国債(10年)	620,000,000	641,073,800	
第327回利付国債(10年)	570,000,000	591,671,400	
第328回利付国債(10年)	900,000,000	928,845,000	
第329回利付国債(10年)	850,000,000	886,567,000	
第330回利付国債(10年)	560,000,000	585,312,000	
第332回利付国債(10年)	695,000,000	721,076,400	
第333回利付国債(10年)	330,000,000	342,995,400	
第334回利付国債(10年)	595,000,000	619,567,550	
第335回利付国債(10年)	95,000,000	98,553,000	
第336回利付国債(10年)	115,000,000	119,452,800	
第337回利付国債(10年)	355,000,000	364,450,100	
第338回利付国債(10年)	607,000,000	627,650,140	
第339回利付国債(10年)	635,000,000	657,485,350	
第340回利付国債(10年)	883,000,000	915,176,520	
第341回利付国債(10年)	615,000,000	633,905,100	
第342回利付国債(10年)	860,000,000	875,110,200	
第343回利付国債(10年)	877,000,000	891,935,310	

第344回利付国債(10年)	970,000,000	985,917,700
第345回利付国債(10年)	945,000,000	959,845,950
第346回利付国債(10年)	760,000,000	771,354,400
第347回利付国債(10年)	435,000,000	441,133,500
第348回利付国債(10年)	595,000,000	602,842,100
第349回利付国債(10年)	675,000,000	682,917,750
第350回利付国債(10年)	465,000,000	469,733,700
第351回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,119,479,400
第352回利付国債(10年)	685,000,000	689,658,000
第2回利付国債(30年)	150,000,000	188,109,000
第4回利付国債(30年)	160,000,000	211,888,000
第5回利付国債(30年)	100,000,000	124,754,000
第7回利付国債(30年)	180,000,000	229,078,800
第10回利付国債(30年)	230,000,000	256,364,900
第11回利付国債(30年)	150,000,000	179,926,500
第12回利付国債(30年)	230,000,000	289,501,000
第14回利付国債(30年)	220,000,000	287,566,400
第15回利付国債(30年)	250,000,000	331,207,500
第16回利付国債(30年)	175,000,000	232,379,000
第18回利付国債(30年)	190,000,000	247,144,400
第19回利付国債(30年)	160,000,000	208,502,400
第21回利付国債(30年)	102,000,000	133,378,260
第22回利付国債(30年)	149,000,000	199,965,450
第23回利付国債(30年)	151,000,000	203,024,030
第24回利付国債(30年)	135,000,000	181,835,550
第25回利付国債(30年)	185,000,000	243,202,850
第26回利付国債(30年)	219,000,000	292,240,170
第27回利付国債(30年)	206,000,000	279,504,920
第28回利付国債(30年)	271,000,000	368,746,990
第29回利付国債(30年)	170,000,000	228,882,900
第30回利付国債(30年)	270,000,000	359,683,200
第31回利付国債(30年)	277,000,000	364,842,240
第32回利付国債(30年)	337,000,000	451,768,720
第33回利付国債(30年)	360,000,000	462,304,800
第34回利付国債(30年)	359,000,000	476,881,240
第35回利付国債(30年)	355,000,000	458,155,900
第36回利付国債(30年)	200,000,000	258,706,000
第37回利付国債(30年)	385,000,000	490,574,700
第38回利付国債(30年)	255,000,000	320,109,150
第39回利付国債(30年)	155,000,000	198,249,650
第40回利付国債(30年)	200,000,000	251,448,000
第41回利付国債(30年)	220,000,000	271,722,000
第42回利付国債(30年)	230,000,000	284,222,500

第43回利付国債(30年)	190,000,000	235,180,100	
第44回利付国債(30年)	247,000,000	305,894,680	
第45回利付国債(30年)	302,000,000	359,893,400	
第46回利付国債(30年)	285,000,000	339,694,350	
第47回利付国債(30年)	265,000,000	322,271,800	
第48回利付国債(30年)	305,000,000	356,313,200	
第49回利付国債(30年)	305,000,000	356,313,200	
第50回利付国債(30年)	280,000,000	285,426,400	
第51回利付国債(30年)	307,000,000	274,255,380	
第52回利付国債(30年)	307,000,000	289,037,430	
第53回利付国債(30年)	262,000,000	252,903,360	
第54回利付国債(30年)	120,000,000	121,824,000	
第55回利付国債(30年)	195,000,000	197,753,400	
第56回利付国債(30年)	325,000,000	329,231,500	
第57回利付国債(30年)	325,000,000	328,867,500	
第58回利付国債(30年)	560,000,000	566,036,800	
第59回利付国債(30年)	130,000,000	127,965,500	
第60回利付国債(30年)	245,000,000	253,628,900	
第46回利付国債(20年)	189,000,000	195,724,620	
第48回利付国債(20年)	368,000,000	387,625,440	
第50回利付国債(20年)	223,000,000	233,356,120	
第52回利付国債(20年)	210,000,000	223,093,500	
第54回利付国債(20年)	275,000,000	294,472,750	
第56回利付国債(20年)	320,000,000	344,134,400	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	323,136,000	
第59回利付国債(20年)	280,000,000	300,784,400	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	146,848,800	
第63回利付国債(20年)	156,000,000	169,738,920	
第64回利付国債(20年)	210,000,000	230,487,600	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	408,002,700	
第69回利付国債(20年)	200,000,000	223,678,000	
第70回利付国債(20年)	380,000,000	433,481,200	
第72回利付国債(20年)	300,000,000	338,958,000	
第74回利付国債(20年)	388,000,000	440,453,720	
第75回利付国債(20年)	230,000,000	262,381,700	
第78回利付国債(20年)	340,000,000	385,359,400	
第82回利付国債(20年)	288,000,000	331,738,560	
第84回利付国債(20年)	424,000,000	487,795,040	
第85回利付国債(20年)	332,000,000	386,019,720	
第88回利付国債(20年)	329,000,000	389,095,140	
第90回利付国債(20年)	418,000,000	493,285,980	
第92回利付国債(20年)	295,000,000	347,058,650	

第93回利付国債(20年)	242,000,000	283,667,560
第95回利付国債(20年)	186,000,000	223,495,740
第97回利付国債(20年)	400,000,000	478,888,000
第99回利付国債(20年)	337,000,000	401,774,770
第100回利付国債(20年)	310,000,000	373,404,300
第102回利付国債(20年)	285,000,000	349,638,000
第105回利付国債(20年)	337,000,000	404,821,250
第107回利付国債(20年)	418,000,000	503,510,260
第109回利付国債(20年)	315,000,000	374,213,700
第111回利付国債(20年)	393,000,000	480,238,140
第113回利付国債(20年)	405,000,000	492,200,550
第114回利付国債(20年)	323,000,000	393,497,980
第116回利付国債(20年)	400,000,000	493,144,000
第118回利付国債(20年)	245,000,000	297,241,350
第119回利付国債(20年)	210,000,000	250,013,400
第121回利付国債(20年)	180,000,000	216,748,800
第122回利付国債(20年)	225,000,000	268,332,750
第123回利付国債(20年)	125,000,000	153,822,500
第124回利付国債(20年)	240,000,000	292,509,600
第125回利付国債(20年)	155,000,000	193,094,350
第126回利付国債(20年)	185,000,000	226,021,900
第127回利付国債(20年)	195,000,000	235,895,400
第128回利付国債(20年)	210,000,000	254,461,200
第129回利付国債(20年)	150,000,000	179,922,000
第130回利付国債(20年)	270,000,000	324,315,900
第131回利付国債(20年)	225,000,000	267,462,000
第132回利付国債(20年)	270,000,000	321,518,700
第133回利付国債(20年)	205,000,000	246,715,450
第134回利付国債(20年)	163,000,000	196,401,960
第135回利付国債(20年)	145,000,000	172,844,350
第136回利付国債(20年)	205,000,000	241,723,700
第137回利付国債(20年)	130,000,000	155,221,300
第138回利付国債(20年)	100,000,000	116,779,000
第139回利付国債(20年)	115,000,000	135,803,500
第140回利付国債(20年)	540,000,000	645,802,200
第141回利付国債(20年)	160,000,000	191,510,400
第142回利付国債(20年)	190,000,000	229,991,200
第143回利付国債(20年)	150,000,000	177,612,000
第144回利付国債(20年)	205,000,000	239,919,700
第145回利付国債(20年)	392,000,000	470,207,920
第146回利付国債(20年)	330,000,000	396,379,500
第147回利付国債(20年)	560,000,000	664,972,000
第148回利付国債(20年)	352,000,000	412,980,480



	第149回利付国債(20年)	297,000,000	348,749,280
	第150回利付国債(20年)	415,000,000	481,121,950
	第151回利付国債(20年)	595,000,000	671,624,100
	第152回利付国債(20年)	400,000,000	451,224,000
	第153回利付国債(20年)	362,000,000	414,026,640
	第154回利付国債(20年)	525,000,000	591,864,000
	第155回利付国債(20年)	340,000,000	372,174,200
	第156回利付国債(20年)	400,000,000	397,432,000
	第157回利付国債(20年)	423,000,000	405,187,470
	第158回利付国債(20年)	385,000,000	387,525,600
	第159回利付国債(20年)	383,000,000	391,261,310
	第160回利付国債(20年)	325,000,000	337,278,500
	第161回利付国債(20年)	475,000,000	483,858,750
	第162回利付国債(20年)	315,000,000	320,399,100
	第163回利付国債(20年)	475,000,000	481,987,250
	第164回利付国債(20年)	465,000,000	462,563,400
	第165回利付国債(20年)	310,000,000	307,811,400
	第166回利付国債(20年)	360,000,000	370,278,000
国債証券合計		72,659,000,000	79,792,307,440
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	213,624,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,426,000
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,767,000
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	246,920,000
	第681回東京都公募公債	200,000,000	203,426,000
	平成26年度第13回北海道公募公債	100,000,000	102,620,000
	平成29年度第5回北海道公募公債	100,000,000	100,633,000
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	200,000,000	199,890,000
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	235,552,000
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	100,749,000
	第192回神奈川県公募公債	100,000,000	102,921,000
	第147回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	99,899,000
	第333回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,469,000
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,152,000
	第395回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,230,000
	第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,637,000
	第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	121,059,000
	平成21年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	100,673,000
	平成21年度第25回兵庫県公募公債	200,000,000	202,788,000
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	125,470,000
	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	114,561,000
	平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,710,000
	平成26年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,903,000

平成21年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,672,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,074,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,065,000	
平成26年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,026,000	
平成26年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,600,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,267,000	
平成26年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,501,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	246,000,000	247,653,120	
平成26年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,466,000	
平成27年度第2回埼玉県公募公債(5年)	100,000,000	100,148,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,898,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,467,000	
平成26年度第5回福岡県公募公債	200,000,000	205,848,000	
平成26年度第3回千葉県公募公債	300,000,000	309,825,000	
第76回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,642,000	
第78回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,094,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,234,000	
第82回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,066,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,711,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,809,000	
第115回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,934,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,067,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,844,000	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,203,000	
第154回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,092,000	
第175回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,928,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	202,132,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	101,044,000	
平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,129,000	
第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,867,000	
平成27年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,122,000	
平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,189,000	
地方債証券合計	8,096,000,000	8,442,696,120	
特殊債券			
第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	101,000,000	102,807,900	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,125,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,070,000	
第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	500,000,000	500,640,000	
第42回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,939,000	
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	132,251,000	

第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,454,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	285,518,000	
第27回道路債券	100,000,000	112,410,000	
第32回道路債券	100,000,000	113,713,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,816,000	
第42回道路債券	100,000,000	113,491,000	
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,005,000	
第79回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,698,000	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,331,000	
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	121,620,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,714,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,908,000	
第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,828,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,733,000	
第122回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,844,000	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,328,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,271,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,062,000	
第333回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,717,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,142,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	200,000,000	203,374,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	707,063,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,980,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	219,298,000	
第4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,682,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,025,000	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,655,000	
第9回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,490,000	
第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,963,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,700,000	
第16回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	100,124,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,856,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	237,010,000	

第3 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,830,000	
第6 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,525,000	
第6 2 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,732,000	
第5 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,994,000	
第6 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	112,864,000	
第2 0 3 回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,292,000	
第2 0 8 回政府保証預金保険機構債	400,000,000	400,932,000	
第1 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,445,000	13,814,334	
第1 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,870,000	16,707,142	
第2 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,740,000	14,149,177	
第5 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,056,000	14,524,627	
第7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,789,000	9,834,910	
第9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,611,000	10,708,515	
第9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,257,000	16,046,092	
第1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,370,000	11,522,130	
第1 0 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,756,000	16,603,515	
第1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,147,000	12,412,533	
第1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,640,000	18,064,065	
第1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,255,000	12,562,600	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,585,000	35,036,695	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,043,000	14,411,067	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,836,000	17,447,483	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,889,000	34,076,266	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,413,000	18,139,818	
第3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,493,000	17,216,547	
第3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,949,000	37,060,618	
第4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,079,000	19,054,904	
第4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,535,000	16,354,937	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,328,000	16,142,529	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,233,000	37,494,253	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,634,000	41,044,761	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,161,000	53,056,292	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,964,000	50,769,414	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,124,000	52,021,824	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,175,000	57,590,009	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,350,000	59,383,320	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,322,000	52,862,254	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,931,000	58,989,866	
第8 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,808,000	63,022,627	
第1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,115,000	91,511,350	
第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,752,000	95,657,829	
第1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,919,000	95,532,176	

	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,358,000	95,968,291
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,917,000
	第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,499,000	97,895,820
	第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,817,000	100,965,893
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,774,000	17,682,144
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,611,000	17,577,427
	い第776号商工債	100,000,000	100,116,000
	第298回信金中金債(5年)	200,000,000	200,270,000
	第304回信金中金債(5年)	200,000,000	200,480,000
	第195号商工債(3年)	200,000,000	199,980,000
特殊債券合計		9,882,633,000	10,391,503,954
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	100,000,000	99,619,000
	第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,304,000
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,853,000
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,225,000
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,500,000
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,452,000
	第56回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,532,000
	第47回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,525,000
	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	100,382,000
	第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	201,352,000
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,329,000
	第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,204,000
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,407,000
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,513,000
	第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,207,000
	第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,221,000
	第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,069,000
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,273,000
	第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	108,076,000
	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	102,840,000
	第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	101,347,000
	第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,640,000
	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	103,090,000
	第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,288,000
	第49回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	198,496,000

第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,108,000	
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	100,003,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	119,275,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,550,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,235,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,536,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,942,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,360,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,329,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,724,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,518,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,872,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,935,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,905,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,106,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,830,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,792,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,936,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,281,000	
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	100,577,000	
社債券合計	4,800,000,000	4,919,717,000	
合計		103,546,224,514	

### 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。

### 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）

#### 貸借対照表

（単位：円）

	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	174,217	7,633,446
コール・ローン	5,113,507	-
親投資信託受益証券	11,341,567,642	6,626,914,656
未収入金	36,749,988	4,709,996
流動資産合計	11,383,605,354	6,639,258,098
資産合計	11,383,605,354	6,639,258,098
<b>負債の部</b>		
流動負債		

	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
未払解約金	36,749,988	7,000,000
未払受託者報酬	372,374	229,894
未払委託者報酬	135,402	83,591
未払利息	13	-
その他未払費用	37,466	37,589
流動負債合計	37,295,243	7,351,074
負債合計	37,295,243	7,351,074
純資産の部		
元本等		
元本	4,221,145,371	2,681,112,051
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,125,164,740	3,950,794,973
元本等合計	11,346,310,111	6,631,907,024
純資産合計	11,346,310,111	6,631,907,024
負債純資産合計	11,383,605,354	6,639,258,098

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年12月 1日 至 平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,221,145,371口	2,681,112,051口
2. 1単位当たり純資産の額	2.6880円 (10,000口当たりの純資産額 26,880円)	2.4736円 (10,000口当たりの純資産額 24,736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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月20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、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。</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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月20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	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
期首元本額	4,392,336,284円	2,743,356,764円
期中追加設定元本額	471,745円	1,181,763円
期中一部解約元本額	171,662,658円	63,426,476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
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	2,075,385,881	6,626,914,656	
合計		2,075,385,881	6,626,914,656	

## 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)

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）は、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 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）

	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	3,573,223,298	4,869,179,041
金銭信託	7,812,744	362,014,577
コール・ローン	229,315,029	-
株式	186,044,625,761	150,004,951,721
投資証券	4,504,991,956	3,808,307,309
派生商品評価勘定	47,349,447	13,500
未収入金	1,896,480	294,572
未収配当金	222,888,605	226,067,457
前払金	-	190,471,766

	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
差入委託証拠金	2,194,526,974	1,305,643,097
流動資産合計	196,826,630,294	160,766,943,040
資産合計	196,826,630,294	160,766,943,040
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	503,600	190,543,766
前受金	47,258,447	-
未払解約金	257,581,634	256,367,437
未払利息	624	-
その他未払費用	643	4,849
流動負債合計	305,344,948	446,916,052
負債合計	305,344,948	446,916,052
純資産の部		
元本等		
元本	56,682,258,401	50,208,278,643
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	139,839,026,945	110,111,748,345
元本等合計	196,521,285,346	160,320,026,988
純資産合計	196,521,285,346	160,320,026,988
負債純資産合計	196,826,630,294	160,766,943,040

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年12月1日 至平成30年12月20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	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	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	56,682,258,401口	50,208,278,643口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 3.4671円 34,671円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 3.1931円 31,931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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月20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、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せん。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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月20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)

(平成29年12月20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	4,807,693,196	-	4,854,951,643	47,258,447
	SPMINI 1803	3,285,219,849	-	3,320,289,408	35,069,559
	DJ EUR 1803	901,905,148	-	908,005,972	6,100,824
	FTSE 1803	336,153,597	-	339,698,268	3,544,671
	SPI200 1803	284,414,602	-	286,957,995	2,543,393
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,368,859,500	-	1,369,272,100	412,600
	米ドル	939,564,800	-	939,752,200	187,400
	カナダドル	49,139,200	-	49,151,200	12,000
	ユーロ	179,150,800	-	179,278,600	127,800
	英ポンド	92,259,500	-	92,299,100	39,600
	スイスフラン	41,264,700	-	41,281,200	16,500
	スウェーデンクローナ	13,698,900	-	13,719,000	20,100
	ノルウェークローネ	3,243,800	-	3,244,800	1,000
	デンマーククローネ	9,156,300	-	9,169,800	13,500
	オーストラリアドル	14,702,900	-	14,703,500	600
	ニュージーランドドル	788,100	-	788,200	100
	香港ドル	18,346,300	-	18,338,800	7,500
	シンガポールドル	7,544,200	-	7,545,700	1,500
合計		6,176,552,696	-	6,224,223,743	46,845,847

(平成30年12月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,844,002,855	-	6,653,531,089	190,471,766

市場取引以外 の取引	SPMINI 1903	4,922,450,313	-	4,737,523,392	184,926,921
	DJ EUR 1903	1,179,853,319	-	1,177,569,151	2,284,168
	FTSE 1903	439,160,038	-	439,092,530	67,508
	SPI200 1903	302,539,185	-	299,346,016	3,193,169
	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	182,990,700	-	182,927,300	63,400
	ユーロ	151,958,700	-	151,888,500	70,200
	英ポンド	28,190,800	-	28,197,400	6,600
	売建				
	カナダドル	2,841,200	-	2,841,400	200
	スイスフラン	33,656,400	-	33,651,500	4,900
	スウェーデンク ローナ	9,181,700	-	9,179,500	2,200
	ノルウェークロー ネ	10,179,900	-	10,181,700	1,800
	デンマーククロー ネ	2,599,800	-	2,599,800	-
	オーストラリアドル	774,600	-	774,000	600
	香港ドル	1,887,600	-	1,887,600	-
	シンガポールドル	4,007,000	-	4,006,000	1,000
	イスラエルシケ ル	3,307,400	-	3,305,100	2,300
		820,200	-	820,200	-
	898,200	-	897,600	600	
合計	7,060,649,955	-	6,870,109,889	190,530,266	

## (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 平成30年12月 1日 至 平成30年12月20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)

(平成29年12月20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	58,029,292,656円
同期中における追加設定元本額	73,035,566円
同期中における一部解約元本額	1,420,069,821円
平成29年12月20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	11,488,943,325円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	240,066,930円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,007,745,686円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	687,646,481円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	65,764,018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)	2,795,730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)	8,257,320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)	24,251,129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)	33,378,458円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	20,175,724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)	57,014,905円
外国株式指数ファンド	436,142,119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	1,584,251,991円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	460,424,190円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	505,026,299円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	451,757,957円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,501,205円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	75,581円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	575,062円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,783,876円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,441,396円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,105,280円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,677,115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)	3,271,197,151円



バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	13,270,935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＞	1,370,190,084円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,199,767,241円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,865,442,606円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	7,874,889,399円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	23,772,348円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	129,240,251円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	954,047円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	986,017,627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＞	77,947,358円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	211,371,159円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	921,052,665円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,122,090,149円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,058,670,737円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	68,486,181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）	945,385,809円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,207,165,480円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	179,874,370円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	91,754,518円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,405,010,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	30,229,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	16,976,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	8,024,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	59,519,416円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	139,324,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	135,500,059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＞	1,479,212,088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＞	226,775,783円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	7,643,309,867円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	1,183,995,641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＞	2,368,095,606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＞	190,295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＞	108,687,095円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05＜適格機関投資家限定＞	52,067,293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＞	102,998,523円
合計	56,682,258,401円

（平成30年12月20日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,246,578,230円
同期中における追加設定元本額	207,065,030円
同期中における一部解約元本額	245,364,617円
平成30年12月20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	13,937,079,880円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	289,759,941円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,193,648,869円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	809,584,010円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	77,576,634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)	2,767,111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)	8,306,540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)	23,067,469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)	42,418,438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)	28,523,192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)	74,091,002円
外国株式指数ファンド	511,259,697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	2,687,849,308円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	301,822,803円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	359,379,819円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	320,909,215円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,511,355円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	8,355,492円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	9,182,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	34,591,109円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	24,201,237円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,982,356円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	9,261,479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)	2,075,385,881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>	9,398,599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>	173,255,840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>	1,755,823,811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>	1,622,654,012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>	6,844,119,908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>	20,758,586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>	109,197,074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>	415,799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>	834,467,752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>	62,459,560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>	192,420,422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>	832,243,444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>	703,813,991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>	1,758,084,467円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	1,127,823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)	617,636,042円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	896,415,077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>	144,875,919円
S M A M・バランスファンドV A 2 0 <適格機関投資家専用>	61,444,159円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,238,982,181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>	26,076,116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>	14,479,541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>	7,145,659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>	50,091,943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 >	118,739,049円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	124,968,964円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,268,985,714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 >	179,499,577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 >	6,575,845,522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 >	327,154,135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 >	533,551,387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 >	8,696,380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 >	78,958,245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 5 < 適格機関投資家限定 >	37,817,100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 >	93,143,547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 >	16,040円
合計	50,208,278,643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	ANADARKO PETROLEUM CORP	21,404	46.79	1,001,493.16	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	10.05	92,791.65	
	APACHE CORPORATION	16,399	28.75	471,471.25	
	BAKER HUGHES A GE CO	19,016	21.04	400,096.64	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	22.56	442,897.92	
	CHENIERE ENERGY INC	8,184	59.43	486,375.12	
	CHEVRON CORPORATION	79,485	107.83	8,570,867.55	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	63.76	260,140.80	
	CONCHO RESOURCES INC	8,315	104.78	871,245.70	
	CONOCOPHILLIPS	48,621	61.28	2,979,494.88	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	40.89	185,436.15	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	23.85	526,035.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,079	90.60	550,757.40	
	EOG RESOURCES INC	24,054	92.98	2,236,540.92	
	EXXON MOBIL CORPORATION	175,561	70.78	12,426,207.58	
	HALLIBURTON CO	36,400	27.64	1,006,096.00	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	50.77	207,141.60	
	HESS CORPORATION	11,053	46.00	508,438.00	
HOLLYFRONTIER CORP	7,365	51.52	379,444.80		
KINDER MORGAN INC	80,817	15.57	1,258,320.69		

MARATHON OIL CORP	36,817	13.86	510,283.62
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	28,706	58.63	1,683,032.78
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	26.21	441,586.08
NOBLE ENERGY INC	20,924	20.07	419,944.68
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	31,821	62.24	1,980,539.04
ONEOK INC	17,066	55.89	953,818.74
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	15.55	143,184.40
PHILLIPS 66	18,409	85.16	1,567,710.44
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,082	132.57	938,860.74
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	21.42	167,204.52
SCHLUMBERGER LTD	57,558	37.79	2,175,116.82
TARGA RESOURCES CORP	8,672	39.05	338,641.60
TECHNIPFMC PLC	18,187	19.10	347,371.70
VALERO ENERGY CORP	17,907	70.98	1,271,038.86
WILLIAMS COS INC	50,269	22.32	1,122,004.08
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,919	154.10	1,374,417.90
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	79.80	367,319.40
AVERY DENNISON CORP	3,941	88.19	347,556.79
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	22.80	245,715.60
BALL CORPORATION	13,670	45.87	627,042.90
CELANESE CORPORATION	5,647	84.77	478,696.19
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	41.92	425,026.88
CHEMOURS CO	8,067	26.89	216,921.63
CROWN HOLDINGS INC	5,272	45.22	238,399.84
DOWDUPONT INC	96,257	52.16	5,020,765.12
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	70.59	420,434.04
ECOLAB INC	10,586	147.42	1,560,588.12
FMC CORPORATION	5,698	74.86	426,552.28
FREEMPORT-MCMORAN INC	60,238	10.18	613,222.84
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	40.60	695,518.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,230	131.36	424,292.80
LINDE PLC	22,522	155.83	3,509,603.26
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,534	80.66	1,091,652.44
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	171.66	442,367.82
MOSAIC CO/THE	15,550	29.58	459,969.00
NEWMONT MINING CORP	21,226	32.09	681,142.34
NUCOR CORP	13,218	53.62	708,749.16
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	85.71	346,782.66
PPG INDUSTRIES INC	10,052	96.43	969,314.36
SEALED AIR CORP	5,839	34.67	202,438.13
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,425	380.24	1,302,322.00
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	30.97	315,615.27

VULCAN MATERIALS CO	5,483	95.93	525,984.19
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	62.37	91,995.75
WESTROCK CO	11,330	39.36	445,948.80
3M COMPANY	24,175	189.96	4,592,283.00
ACUITY BRANDS INC	1,884	110.89	208,916.76
AERCAP HOLDINGS NV	4,831	44.70	215,945.70
ALLEGION PLC	3,946	81.98	323,493.08
AMETEK INC	9,623	67.90	653,401.70
ARCONIC INC	19,024	17.92	340,910.08
BOEING CO	22,595	319.55	7,220,232.25
CATERPILLAR INC	24,845	122.33	3,039,288.85
CUMMINS INC	6,298	130.89	824,345.22
DEERE & CO	12,602	146.08	1,840,900.16
DOVER CORP	5,618	71.70	402,810.60
EATON CORP PLC	18,172	68.01	1,235,877.72
EMERSON ELECTRIC CO	26,183	57.68	1,510,235.44
FASTENAL COMPANY	11,953	51.48	615,340.44
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	39.06	189,401.94
FLUOR CORP	5,677	31.94	181,323.38
FORTIVE CORP	12,444	66.58	828,521.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	39.25	253,162.50
GENERAL DYNAMICS CORP	10,491	158.99	1,667,964.09
GENERAL ELECTRIC CO	360,911	7.66	2,764,578.26
HARRIS CORP	4,981	138.46	689,669.26
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	36.99	288,041.13
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,038	133.26	4,136,123.88
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	188.75	345,790.00
IDEX CORP	3,078	125.70	386,904.60
ILLINOIS TOOL WORKS	12,669	125.61	1,591,353.09
INGERSOLL-RAND PLC	10,304	92.59	954,047.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	57.45	282,768.90
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	65.70	617,580.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	36.07	328,237.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	30.83	1,219,418.99
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	177.86	597,787.46
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	211.60	326,287.20
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	10,678	273.96	2,925,344.88
MASCO CORP	11,955	29.23	349,444.65
MIDDLEBY CORP	2,315	107.28	248,353.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,884	253.35	1,744,061.40
OWENS CORNING	4,859	44.08	214,184.72
PACCAR INC	14,129	54.88	775,399.52

PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,339	147.64	788,249.96
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	38.16	267,348.96
RAYTHEON COMPANY	11,936	162.33	1,937,570.88
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,042	151.23	762,501.66
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,287	269.47	1,155,217.89
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	42.44	301,578.64
SMITH(A.O.) CORP	5,944	42.71	253,868.24
SNAP-ON INC	2,448	142.25	348,228.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	3,889	71.11	276,546.79
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,017	117.44	706,636.48
TEXTRON INC	10,639	47.20	502,160.80
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	333.35	673,367.00
UNITED RENTALS INC	3,677	100.90	371,009.30
UNITED TECHNOLOGIES CORP	34,142	113.80	3,885,359.60
WABCO HOLDINGS INC	2,109	103.84	218,998.56
WABTEC CORP	3,452	71.05	245,264.60
WW GRAINGER INC	1,980	278.43	551,291.40
XYLEM INC	7,965	65.13	518,760.45
CINTAS CORP	3,607	165.07	595,407.49
COPART INC	8,553	47.04	402,333.12
COSTAR GROUP INC	1,507	336.57	507,210.99
EQUIFAX INC	4,755	94.23	448,063.65
IHS MARKIT LTD	16,261	48.43	787,520.23
MANPOWERGROUP	3,240	66.57	215,686.80
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	24.30	367,804.80
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	72.71	706,813.91
ROBERT HALF INTL INC	4,666	56.36	262,975.76
ROLLINS INC	6,451	35.30	227,720.30
TRANSUNION	7,559	55.73	421,263.07
VERISK ANALYTICS INC	6,265	110.23	690,590.95
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	75.29	824,651.37
WASTE MANAGEMENT INC	17,631	87.92	1,550,117.52
AMERCO	390	340.03	132,611.70
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	32.42	184,015.92
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	83.88	508,564.44
CSX CORPORATION	34,556	62.05	2,144,199.80
DELTA AIR LINES INC	7,251	51.93	376,544.43
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,819	66.70	454,827.30
FEDEX CORP	10,549	162.51	1,714,317.99
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	91.89	323,728.47
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	94.77	440,585.73
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	5,115	26.06	133,296.90

NORFOLK SOUTHERN CORP	11,741	146.93	1,725,105.13
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	121.89	321,667.71
SOUTHWEST AIRLINES	5,512	48.78	268,875.36
UNION PACIFIC CORP	30,748	136.89	4,209,093.72
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,880	86.37	248,745.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,654	94.32	2,702,645.28
XPO LOGISTICS INC	4,945	52.02	257,238.90
APTIV PLC	10,593	62.00	656,766.00
AUTOLIV INC	4,001	71.25	285,071.25
BORGWARNER INC	8,566	33.90	290,387.40
FORD MOTOR COMPANY	154,514	8.32	1,285,556.48
GENERAL MOTORS CO	52,711	34.93	1,841,195.23
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	20.42	210,999.86
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	33.25	244,287.75
LEAR CORP	2,531	121.08	306,453.48
TESLA INC	5,426	332.97	1,806,695.22
D.R.HORTON INC	15,658	35.64	558,051.12
GARMIN LTD	4,936	62.18	306,920.48
HANESBRANDS INC	13,181	12.12	159,753.72
HASBRO INC	5,156	80.50	415,058.00
LEGGETT & PLATT INC	5,036	35.84	180,490.24
LENNAR CORP-CL A	11,265	41.03	462,202.95
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	115.71	495,123.09
MATTEL INC	14,058	10.27	144,375.66
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	6,229	37.92	236,203.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	116.97	334,885.11
NEWELL BRANDS INC	18,477	20.40	376,930.80
NIKE INC -CL B	53,301	68.97	3,676,169.97
NVR INC	143	2,441.44	349,125.92
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	75.80	186,998.60
PULTE GROUP INC	9,567	25.80	246,828.60
PVH CORP	3,303	91.47	302,125.41
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	101.05	209,880.85
TAPESTRY INC	11,987	33.95	406,958.65
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	18.10	156,275.40
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	16.64	137,962.24
VF CORP	13,594	71.84	976,592.96
WHIRLPOOL CORP	2,604	110.12	286,752.48
ARAMARK	10,783	29.76	320,902.08
CARNIVAL CORP	17,764	55.01	977,197.64
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,101	427.05	470,182.05
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	100.63	540,584.36

DOMINO'S PIZZA INC	1,661	239.38	397,610.18
H&R BLOCK INC	7,820	25.10	196,282.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	11,453	69.66	797,815.98
LAS VEGAS SANDS CORP	15,869	51.22	812,810.18
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,481	106.39	1,327,853.59
MCDONALD'S CORPORATION	32,022	179.16	5,737,061.52
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	17.30	192,895.00
MGM MIRAGE	22,498	24.51	551,425.98
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	45.17	412,627.95
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	6,788	101.95	692,036.60
STARBUCKS CORP	55,872	64.06	3,579,160.32
VAIL RESORTS INC	1,680	222.97	374,589.60
WYNN RESORTS LTD	4,252	98.39	418,354.28
YUM! BRANDS INC	13,431	90.12	1,210,401.72
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,663	46.33	1,374,286.79
ALPHABET INC-CL A	12,384	1,035.46	12,823,136.64
ALPHABET INC-CL C	13,103	1,023.01	13,404,500.03
CBS CORP-CL B	13,648	45.37	619,209.76
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	6,907	297.60	2,055,523.20
COMCAST CORP-CLASS A	189,992	35.19	6,685,818.48
DISCOVERY INC-A	7,075	26.88	190,176.00
DISCOVERY INC-C	12,731	25.15	320,184.65
DISH NETWORK CORP.	9,780	27.96	273,448.80
ELECTRONIC ARTS INC	12,750	78.36	999,090.00
FACEBOOK INC-A	100,277	133.24	13,360,907.48
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	177.48	573,437.88
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	21.32	331,398.08
LIBERTY BROADBAND-C	4,072	74.64	303,934.08
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	22.09	186,262.88
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	21.32	502,938.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	29.99	256,954.32
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	37.48	286,647.04
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	37.65	155,908.65
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	51.14	310,164.10
NETFLIX INC	17,980	266.77	4,796,524.60
NEWS CORP-CLASS A	16,662	11.84	197,278.08
OMNICOM GROUP	9,445	73.87	697,702.15
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.02	410,877.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	103.05	495,464.40
THE WALT DISNEY CO.	61,522	109.22	6,719,432.84
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	56.67	229,570.17
TWENTY-FIRST CE CL-A	43,799	48.52	2,125,127.48



TWENTY-FIRST CE CL-B	17,584	48.19	847,372.96
TWITTER INC	29,540	32.93	972,752.20
VIACOM INC-CLASS B	14,668	26.74	392,222.32
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	30.29	161,142.80
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	156.12	515,820.48
AMAZON.COM INC	17,212	1,495.08	25,733,316.96
AUTOZONE INC	1,066	835.87	891,037.42
BEST BUY COMPANY INC	10,543	50.96	537,271.28
BOOKING HOLDINGS INC	1,950	1,736.63	3,386,428.50
BURLINGTON STORES INC	2,545	160.14	407,556.30
CARMAX INC	7,453	57.78	430,634.34
DOLLAR GENERAL CORP	10,842	103.02	1,116,942.84
DOLLAR TREE INC	10,263	86.23	884,978.49
EBAY INC	39,239	28.30	1,110,463.70
EXPEDIA GROUP INC	5,168	115.15	595,095.20
GAP INC/THE	9,218	25.17	232,017.06
GENUINE PARTS CO	6,098	94.79	578,029.42
GRUBHUB INC	3,210	72.71	233,399.10
HOME DEPOT INC	47,771	167.56	8,004,508.76
KOHL'S CORP	6,991	61.66	431,065.06
L BRANDS INC	10,675	27.23	290,680.25
LKQ CORPORATION	13,945	24.33	339,281.85
LOWE'S COMPANIES INC	33,250	90.33	3,003,472.50
MACY'S INC	13,521	30.41	411,173.61
MERCADOLIBRE INC	1,842	312.39	575,422.38
NORDSTROM INC	4,756	46.80	222,580.80
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,313	340.39	1,127,712.07
QURATE RETAIL INC	18,982	19.50	370,149.00
ROSS STORES INC	15,734	78.47	1,234,646.98
TARGET CORP	21,046	62.83	1,322,320.18
TIFFANY & CO	4,643	77.77	361,086.11
TJX COMPANIES INC	52,102	43.64	2,273,731.28
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	86.02	454,013.56
ULTA BEAUTY INC	2,389	239.23	571,520.47
WAYFAIR INC-CLASS A	1,936	90.41	175,033.76
COSTCO WHOLESALE CORP	18,235	201.41	3,672,711.35
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	8.88	119,880.00
KROGER CO	32,667	28.23	922,189.41
SYSCO CORP	20,137	63.49	1,278,498.13
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,027	73.29	2,567,128.83
WALMART INC	61,344	90.55	5,554,699.20
ALTRIA GROUP INC	78,647	51.40	4,042,455.80

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,619	42.40	959,045.60
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	45.60	516,465.60
BUNGE LIMITED	5,968	56.57	337,609.76
CAMPBELL SOUP CO	7,879	38.65	304,523.35
COCA-COLA CO/THE	167,322	47.90	8,014,723.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	46.14	431,501.28
CONAGRA BRANDS INC	20,188	29.09	587,268.92
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,850	172.09	1,178,816.50
GENERAL MILLS INC	25,006	38.55	963,981.30
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	43.01	535,173.43
INGREDION INC	3,320	90.94	301,920.80
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	96.90	476,166.60
KELLOGG CO	11,216	58.69	658,267.04
KRAFT HEINZ COMPANY	24,794	45.09	1,117,961.46
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	74.99	456,689.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,040	141.95	715,428.00
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	57.77	454,303.28
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	61,295	41.41	2,538,225.95
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,230	49.44	851,851.20
PEPSICO INC	58,638	110.04	6,452,525.52
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	64,595	72.04	4,653,423.80
THE HERSHEY COMPANY	5,608	107.33	601,906.64
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	52.67	664,695.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,995	64.76	647,276.20
CLOROX COMPANY	5,583	154.85	864,527.55
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	34,436	61.88	2,130,899.68
COTY INC-CL A	22,574	6.96	157,115.04
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,073	128.54	1,166,243.42
KIMBERLY-CLARK CORP	14,516	113.88	1,653,082.08
PROCTER & GAMBLE CO	103,498	91.76	9,496,976.48
ABBOTT LABORATORIES	72,852	69.00	5,026,788.00
ABIOMED INC	1,839	296.14	544,601.46
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,164	201.56	637,735.84
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	76.31	538,595.98
ANTHEM INC	10,741	257.61	2,766,989.01
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,139	64.05	1,353,952.95
BECTON DICKINSON & CO	11,103	222.24	2,467,530.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,337	33.98	1,948,311.26
CARDINAL HEALTH INC	12,873	46.13	593,831.49
CENTENE CORP	8,318	118.92	989,176.56
CERNER CORP	12,409	52.07	646,136.63
CIGNA CORP	10,109	193.30	1,954,069.70

COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	243.59	500,577.45
CVS HEALTH CORPORATION	53,507	68.59	3,670,045.13
DANAHER CORP	26,126	100.65	2,629,581.90
DAVITA INC	5,801	53.38	309,657.38
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	35.96	357,586.24
DEXCOM INC	3,320	113.48	376,753.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,568	153.65	1,316,473.20
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	23,342	95.80	2,236,163.60
HCA HEALTHCARE INC	11,612	122.25	1,419,567.00
HENRY SCHEIN INC	6,050	78.42	474,441.00
HOLOGIC INC	12,110	39.68	480,524.80
HUMANA INC.	5,721	283.29	1,620,702.09
IDEXX LABORATORIES INC	3,602	183.90	662,407.80
INTUITIVE SURGICAL INC	4,708	471.92	2,221,799.36
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	128.40	565,602.00
MCKESSON CORP	8,396	110.63	928,849.48
MEDTRONIC PLC	56,273	91.26	5,135,473.98
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	84.08	496,912.80
RESMED INC	5,931	109.53	649,622.43
STRYKER CORP	13,976	158.00	2,208,208.00
TELEFLEX INC	1,951	245.14	478,268.14
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,960	250.31	10,002,387.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	116.06	436,385.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	113.92	469,350.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	87.06	438,347.10
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,928	228.80	441,126.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,211	104.56	858,542.16
ABBVIE INC	63,020	83.52	5,263,430.40
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,845	66.83	858,431.35
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,011	102.78	926,150.58
ALKERMES PLC	6,413	29.89	191,684.57
ALLERGAN PLC	14,089	136.56	1,923,993.84
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	68.38	267,229.04
AMGEN INC	26,913	185.49	4,992,092.37
BEIGENE LTD-ADR	1,420	133.89	190,123.80
BIOGEN INC	8,376	292.69	2,451,571.44
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	85.88	645,474.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	67,922	50.39	3,422,589.58
CELGENE CORP	28,623	65.58	1,877,096.34
ELI LILLY & CO	40,594	109.11	4,429,211.34
GILEAD SCIENCES INC	54,031	64.20	3,468,790.20
ILLUMINA INC	6,108	303.40	1,853,167.20

INCYTE CORP	7,576	62.75	475,394.00
IQVIA HOLDINGS INC	6,827	113.79	776,844.33
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	131.78	343,155.12
JOHNSON & JOHNSON	111,237	127.61	14,194,953.57
MERCK & CO. INC.	110,010	73.77	8,115,437.70
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	558.05	620,551.60
MYLAN NV	22,501	27.72	623,727.72
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	34.26	240,984.84
PERRIGO CO PLC	5,561	53.74	298,848.14
PFIZER INC	243,275	41.97	10,210,251.75
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	360.70	1,223,494.40
SEATTLE GENETICS INC	4,290	55.06	236,207.40
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	38,767	16.29	631,514.43
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,718	228.36	3,817,722.48
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,809	104.17	188,443.53
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,589	158.66	1,680,050.74
WATERS CORP	3,459	182.31	630,610.29
ZOETIS INC	20,107	83.44	1,677,728.08
BANK OF AMERICA CORP	392,989	24.18	9,502,474.02
BB & T CORPORATION	31,767	43.30	1,375,511.10
CIT GROUP INC	4,770	38.62	184,217.40
CITIGROUP INC	103,966	52.82	5,491,484.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	29.00	584,118.00
COMERICA INC	7,145	67.18	480,001.10
EAST WEST BANCORP INC	6,233	42.46	264,653.18
FIFTH THIRD BANCORP	28,485	22.80	649,458.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,722	83.19	559,203.18
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	11.50	527,010.50
JPMORGAN CHASE & CO	139,359	97.29	13,558,237.11
KEYCORP	45,615	14.40	656,856.00
M & T BANK CORP	5,546	141.55	785,036.30
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	14.34	201,261.90
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,510	114.03	2,224,725.30
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,311	12.84	607,473.24
SIGNATURE BANK	2,508	102.81	257,847.48
SUNTRUST BANKS INC	19,315	49.40	954,161.00
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	186.39	434,847.87
US BANCORP	64,838	46.22	2,996,812.36
WELLS FARGO & COMPANY	189,428	45.67	8,651,176.76
ZIONS BANCORPORATION	8,874	40.13	356,113.62
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	92.20	207,634.40
ALLY FINANCIAL INC	17,783	22.59	401,717.97

AMERICAN EXPRESS COMPANY	30,389	98.77	3,001,521.53
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,565	105.47	586,940.55
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	7,749	16.23	125,766.27
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	41,998	45.50	1,910,909.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,748	195.17	10,489,997.16
BLACKROCK INC	4,918	372.19	1,830,430.42
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,213	74.67	1,509,304.71
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	98.08	482,847.84
CME GROUP INC.	14,627	185.53	2,713,747.31
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,482	58.40	845,748.80
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	43.10	472,677.70
EATON VANCE CORP	5,530	34.14	188,794.20
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	29.09	391,813.21
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,911	169.25	2,523,686.75
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,069	75.08	1,807,100.52
INVESCO LIMITED	18,328	16.42	300,945.76
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	17.41	224,327.85
MOODY'S CORP	7,177	139.50	1,001,191.50
MORGAN STANLEY	55,171	39.30	2,168,220.30
MSCI INC-A	3,805	143.13	544,609.65
NASDAQ INC	4,297	83.01	356,693.97
NORTHERN TRUST CORP	8,560	82.00	701,920.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	71.35	391,711.50
S&P GLOBAL INC	10,377	167.01	1,733,062.77
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,458	39.72	2,004,191.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	46.24	271,058.88
STATE STREET CORP	15,348	59.88	919,038.24
SYNCHRONY FINANCIAL	30,645	23.20	710,964.00
T ROWE PRICE GROUP INC	10,062	88.41	889,581.42
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	47.40	558,846.00
VOYA FINANCIAL INC	7,528	39.26	295,549.28
AFLAC INC	32,170	43.98	1,414,836.60
ALLEGHANY CORPORATION	635	607.74	385,914.90
ALLSTATE CORP	14,290	80.98	1,157,204.20
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	89.63	317,200.57
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	37,302	39.34	1,467,460.68
AON PLC	10,160	148.31	1,506,829.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	26.41	470,705.43
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	73.32	556,278.84
ASSURANT INC	2,198	88.40	194,303.20
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	40.51	246,422.33
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	31.95	136,043.10

CHUBB LTD	19,118	126.65	2,421,294.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	76.39	482,097.29
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	220.16	363,264.00
FNF GROUP	10,851	30.53	331,281.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	42.67	649,224.05
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	51.60	474,358.80
LOEWS CORPORATION	10,639	44.88	477,478.32
MARKEL CORP	577	1,009.98	582,758.46
MARSH & MCLENNAN COS	21,084	80.19	1,690,725.96
METLIFE INC	35,905	39.24	1,408,912.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	43.26	514,794.00
PROGRESSIVE CORP	23,771	60.87	1,446,940.77
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,149	80.60	1,382,209.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,353	138.33	325,490.49
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	133.27	200,438.08
TORCHMARK CORPORATION	4,615	74.44	343,540.60
TRAVELERS COS INC(THE)	11,230	119.16	1,338,166.80
UNUM GROUP	9,769	28.81	281,444.89
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	73.09	283,077.57
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	151.33	826,261.80
CBRE GROUP INC-A	13,193	40.47	533,920.71
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,238	110.26	1,900,661.88
EQUINIX INC	3,228	368.44	1,189,324.32
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	6.47	338,381.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	128.47	257,839.29
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	165.10	790,168.60
ACCENTURE PLC-CL A	26,777	150.96	4,042,255.92
ADOBE INC	20,464	224.65	4,597,237.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	63.02	465,969.88
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	158.75	352,742.50
ANSYS INC	3,662	146.22	535,457.64
AUTODESK INC	9,105	128.13	1,166,623.65
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,305	130.33	2,385,690.65
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	96.20	471,380.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	42.09	493,042.26
CDK GLOBAL INC	5,003	46.47	232,489.41
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,230	104.36	545,802.80
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	105.96	598,779.96
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	23,937	64.23	1,537,473.51
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8,284	104.85	868,577.40
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	54.07	639,864.38
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	13,755	101.04	1,389,805.20

FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	16.30	342,039.20
FISERV INC	16,631	72.84	1,211,402.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	179.96	688,167.04
FORTINET INC	5,937	70.02	415,708.74
GARTNER INC	4,011	130.71	524,277.81
GLOBAL PAYMENTS INC	6,630	101.34	671,884.20
GODADDY INC - CLASS A	6,638	62.15	412,551.70
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,145	116.43	4,441,222.35
INTUIT INC	10,129	195.57	1,980,928.53
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	127.21	408,598.52
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	54.49	330,972.26
MASTERCARD INC-CL A	38,382	187.12	7,182,039.84
MICROSOFT CORP	303,031	103.69	31,421,284.39
ORACLE CORPORATION	124,151	46.45	5,766,813.95
PAYCHEX INC	13,436	64.76	870,115.36
PAYPAL HOLDINGS INC	46,874	84.03	3,938,822.22
PTC INC	4,158	83.90	348,856.20
RED HAT INC	7,372	175.43	1,293,269.96
SABRE CORP	9,850	22.86	225,171.00
SALESFORCE.COM, INC.	29,576	131.16	3,879,188.16
SERVICENOW INC	7,342	174.04	1,277,801.68
SPLUNK INC	6,247	100.32	626,699.04
SQUARE INC-A	12,389	59.03	731,322.67
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	44.58	403,092.36
SYMANTEC CORPORATION	27,227	20.43	556,247.61
SYNOPSYS INC	6,139	84.12	516,412.68
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	81.24	583,221.96
VERISIGN INC	4,396	149.71	658,125.16
VISA INC	74,010	131.26	9,714,552.60
VMWARE INC	3,055	156.76	478,901.80
WESTERN UNION COMPANY	19,054	17.49	333,254.46
WIX.COM LTD	1,629	85.60	139,442.40
WORKDAY INC-CLASS A	6,016	155.69	936,631.04
WORLDPAY INC-CL A	12,358	76.07	940,073.06
AMPHENOL CORPORATION -CL A	12,526	79.64	997,570.64
APPLE INC	200,583	160.89	32,271,798.87
ARISTA NETWORKS INC	2,260	202.05	456,633.00
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	68.74	283,896.20
CDW CORP/DE	6,306	84.25	531,280.50
CISCO SYSTEMS INC	194,765	43.14	8,402,162.10
COGNEX CORP	7,187	37.57	270,015.59
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	16.54	145,601.62

CORNING INC	33,570	30.06	1,009,114.20
F5 NETWORKS INC	2,620	162.20	424,964.00
FLEX LTD	23,204	7.47	173,333.88
FLIR SYSTEMS INC	5,286	42.59	225,130.74
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	61,502	13.17	809,981.34
HP INC	63,911	20.55	1,313,371.05
IPG PHOTONICS CORP	1,776	112.79	200,315.04
JUNIPER NETWORKS INC	15,026	26.96	405,100.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,598	60.07	456,411.86
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,737	119.05	802,039.85
NETAPP INC	11,136	59.37	661,144.32
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	178.99	701,103.83
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	36.18	409,991.76
TE CONNECTIVITY LTD	14,550	72.28	1,051,674.00
TRIMBLE INC	10,356	32.48	336,362.88
WESTERN DIGITAL CORP	11,197	36.58	409,586.26
XEROX CORP	9,697	20.67	200,436.99
AT&T INC	301,751	29.82	8,998,214.82
CENTURYLINK INC	40,608	16.08	652,976.64
SPRINT CORP	36,740	5.98	219,705.20
T-MOBILE US INC	14,076	64.87	913,110.12
VERIZON COMMUNICATIONS INC	171,136	55.86	9,559,656.96
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	22.35	206,536.35
AES CORPORATION	27,194	14.74	400,839.56
ALLIANT ENERGY CORP	9,162	43.72	400,562.64
AMEREN CORPORATION	10,336	67.21	694,682.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,466	76.86	1,573,016.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,062	92.59	653,870.58
ATMOS ENERGY CORP	4,697	94.93	445,886.21
CENTERPOINT ENERGY INC	19,347	28.39	549,261.33
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	51.12	586,039.68
CONSOLIDATED EDISON INC	12,912	80.10	1,034,251.20
DOMINION ENERGY INC	27,116	74.11	2,009,566.76
DTE ENERGY COMPANY	7,353	113.81	836,844.93
DUKE ENERGY CORP	29,130	87.23	2,541,009.90
EDISON INTERNATIONAL	13,539	58.42	790,948.38
ENTERGY CORP	7,148	86.84	620,732.32
EVERGY INC	11,852	58.08	688,364.16
EVERSOURCE ENERGY	13,730	67.29	923,891.70
EXELON CORP	40,116	45.72	1,834,103.52
FIRSTENERGY CORP	20,229	37.36	755,755.44
NEXTERA ENERGY INC	19,590	174.52	3,418,846.80



NISOURCE INC	15,794	26.37	416,487.78
NRG ENERGY INC	13,738	40.08	550,619.04
OGE ENERGY CORP	9,056	39.83	360,700.48
P G & E CORPORATION	20,841	23.75	494,973.75
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	88.45	452,864.00
PPL CORPORATION	29,049	28.23	820,053.27
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,994	52.76	1,107,643.44
SCANA CORP	6,498	49.11	319,116.78
SEMPRA ENERGY	11,603	113.94	1,322,045.82
SOUTHERN CO	42,037	45.28	1,903,435.36
UGI CORPORATION	7,497	55.34	414,883.98
VISTRA ENERGY CORP	13,852	23.16	320,812.32
WEC ENERGY GROUP INC	13,142	71.31	937,156.02
XCEL ENERGY INC	20,517	50.92	1,044,725.64
ADVANCED MICRO DEVICES	39,452	18.16	716,448.32
ANALOG DEVICES INC	15,412	83.69	1,289,830.28
APPLIED MATERIALS INC	41,888	31.53	1,320,728.64
BROADCOM INC	17,761	243.89	4,331,730.29
INTEL CORP	191,187	45.57	8,712,391.59
KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	86.94	563,805.90
LAM RESEARCH CORP	6,265	131.12	821,466.80
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	14.76	396,704.52
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	49.37	573,778.14
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	68.61	694,127.37
MICRON TECHNOLOGY INC	47,478	31.41	1,491,283.98
NVIDIA CORP	23,962	138.51	3,318,976.62
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,756	71.31	1,052,250.36
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	16.43	286,457.05
QORVO INC	4,855	59.64	289,552.20
QUALCOMM INC	57,984	56.69	3,287,112.96
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	66.36	526,765.68
TEXAS INSTRUMENTS INC	40,678	90.53	3,682,579.34
XILINX INC	10,032	85.22	854,927.04
米ドル 小計	12,722,641		899,474,645.86 (101,280,845,123)
カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	17,074	8.10	138,299.40
CAMECO CORP	16,384	14.88	243,793.92
CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,994	32.59	1,629,304.46
CENOVUS ENERGY INC	41,433	9.39	389,055.87
ENBRIDGE INC	75,697	42.44	3,212,580.68
ENCANA CORP	41,829	7.69	321,665.01
HUSKY ENERGY INC	14,553	14.52	211,309.56

IMPERIAL OIL LTD	12,999	35.04	455,484.96
INTER PIPELINE LTD	18,081	19.80	358,003.80
KEYERA CORP	8,467	27.43	232,249.81
PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	42.36	919,254.36
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	17.45	157,713.10
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	8,534	9.99	85,254.66
SUNCOR ENERGY INC	67,894	38.41	2,607,808.54
TOURMALINE OIL CORP	12,887	16.20	208,769.40
TRANSCANADA CORP	36,356	52.17	1,896,692.52
VERMILION ENERGY INC	5,586	28.84	161,100.24
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	51.60	500,365.20
BARRICK GOLD CORP	50,240	17.34	871,161.60
CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	50.34	269,721.72
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	10.20	323,054.40
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	93.08	751,341.76
GOLDCORP INC	33,338	12.43	414,391.34
KINROSS GOLD CORP	57,099	3.86	220,402.14
LUNDIN MINING CORP	28,209	5.46	154,021.14
METHANEX CORPORATION	2,452	66.82	163,842.64
NUTRIEN LTD	24,774	61.30	1,518,646.20
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	19,895	28.03	557,656.85
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.06	92,920.42
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	66.46	190,939.58
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	25.31	495,519.18
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.87	141,843.24
CAE INC	13,932	25.44	354,430.08
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	23.21	141,929.15
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	45.97	379,252.50
WSP GLOBAL INC	4,524	59.57	269,494.68
THOMSON REUTERS CORP	7,895	66.56	525,491.20
CANADIAN NATL RAILWAY CO	30,217	100.94	3,050,103.98
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	5,945	242.26	1,440,235.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	60.76	889,587.16
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	41.48	376,057.68
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,162	71.41	654,258.42
STARS GROUP INC/THE	6,424	20.94	134,518.56
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	24.81	480,792.99
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	142.42	344,229.14
DOLLARAMA INC	11,954	31.59	377,626.86
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,360	65.90	1,209,924.00
EMPIRE CO LTD A	7,235	28.71	207,716.85
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	61.13	521,989.07

METRO INC	9,121	47.12	429,781.52	
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	91.21	283,845.52	
SAPUTO INC	9,854	40.16	395,736.64	
AURORA CANNABIS INC	28,563	7.14	203,939.82	
BAUSCH HEALTH COS INC	11,847	26.55	314,537.85	
CANOPY GROWTH CORP	8,388	37.80	317,066.40	
BANK OF MONTREAL	26,243	89.03	2,336,414.29	
BANK OF NOVA SCOTIA	50,452	69.94	3,528,612.88	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18,450	104.26	1,923,597.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	57.36	844,052.40	
ROYAL BANK OF CANADA	59,548	92.68	5,518,908.64	
TORONTO-DOMINION BANK	76,169	67.58	5,147,501.02	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	34,325	53.23	1,827,119.75	
CI FINANCIAL CORP	11,041	17.10	188,801.10	
IGM FINANCIAL INC	3,023	30.69	92,775.87	
ONEX CORPORATION	4,217	72.18	304,383.06	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	570.36	657,625.08	
GREAT-WEST LIFE CO INC	14,200	28.13	399,446.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	42.84	207,816.84	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	98.74	618,507.36	
MANULIFE FINANCIAL CORP	80,497	19.52	1,571,301.44	
POWER CORP OF CANADA	14,595	24.21	353,344.95	
POWER FINANCIAL CORP	11,076	25.83	286,093.08	
SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	43.94	1,134,706.56	
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	19.32	126,468.72	
BLACKBERRY LIMITED	18,096	9.93	179,693.28	
CGI GROUP INC - CL A	10,134	82.53	836,359.02	
CONSTELLATION SOFTWARE	848	887.19	752,337.12	
OPEN TEXT CORPORATION	11,689	44.51	520,277.39	
SHOPIFY INC-CLASS A	3,824	179.44	686,178.56	
BCE INC	6,928	55.48	384,365.44	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	14,590	70.48	1,028,303.20	
TELUS CORPORATION	7,611	45.71	347,898.81	
ALTAGAS LTD	9,753	13.82	134,786.46	
ATCO LTD-CLASS I	3,030	38.49	116,624.70	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	3,992	31.13	124,270.96	
EMERA INC	2,409	43.76	105,417.84	
FORTIS INC	17,933	45.99	824,738.67	
HYDRO ONE LTD	15,052	20.51	308,716.52	
カナダドル 小計	1,716,741		66,614,157.48 (5,562,282,149)	
ユーロ	ENAGAS	10,471	24.65	258,110.15

ENI SPA	105,711	13.95	1,474,668.45
GALP ENERGIA SGPS S.A	20,924	13.97	292,412.90
NESTE OYJ	5,632	70.72	398,295.04
OMV AG	6,314	40.14	253,443.96
REPSOL SA	56,593	14.66	829,936.34
SNAM SPA	90,811	4.03	366,240.76
TENARIS S.A.	18,477	9.64	178,229.14
TOTAL SA	100,242	46.83	4,694,332.86
VOPAK	3,130	40.81	127,735.30
AIR LIQUIDE SA	17,569	107.65	1,891,302.85
AKZO NOBEL	10,857	69.96	759,555.72
ARCELORMITTAL	26,543	19.44	515,995.92
ARKEMA	3,250	75.94	246,805.00
BASF SE	38,038	60.34	2,295,212.92
COVESTRO AG	8,053	43.15	347,486.95
CRH PLC	34,970	22.50	786,825.00
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	22.00	141,878.00
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	35.46	119,500.20
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	54.20	356,310.80
IMERYS SA	1,384	41.34	57,214.56
KONINKLIJKE DSM NV	7,301	72.66	530,490.66
LANXESS	3,160	40.82	128,991.20
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,196	22.20	226,351.20
SOLVAY SA	2,831	89.44	253,204.64
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	10.62	262,409.58
SYMRISE AG	4,995	66.50	332,167.50
THYSSENKRUPP AG	19,367	16.08	311,421.36
UMICORE	8,730	35.41	309,129.30
UPM-KYMMENE OYJ	21,315	23.24	495,360.60
VOESTALPINE AG	5,079	26.66	135,406.14
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,553	33.43	386,216.79
AIRBUS SE	23,933	87.20	2,086,957.60
ALSTOM RGPT	6,452	37.42	241,433.84
ANDRITZ AG	2,514	39.36	98,951.04
BOUYGUES SA	8,390	31.90	267,641.00
BRENTAG AG	6,629	37.46	248,322.34
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	8.24	355,724.72
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	28.88	614,268.41
DASSAULT AVIATION SA	89	1,200.00	106,800.00
EIFFAGE SA	3,580	73.56	263,344.80
FERROVIAL SA	19,155	17.96	344,119.57
GEA GROUP AG	8,178	22.00	179,916.00

HOCHTIEF AG	825	115.00	94,875.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,347	35.40	260,083.80
KION GROUP AG	3,179	43.05	136,855.95
KONE OYJ-B	13,513	42.56	575,113.28
LEGRAND SA	10,641	48.94	520,770.54
LEONARDO SPA	18,310	8.25	151,167.36
METSO OYJ	3,963	23.26	92,179.38
MTU AERO ENGINES AG	2,011	165.90	333,624.90
OSRAM LICHT AG	4,588	38.94	178,656.72
PRYSMIAN SPA	9,379	17.01	159,583.68
REXEL SA	12,854	9.67	124,323.88
SAFRAN SA	13,625	106.35	1,449,018.75
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,361	60.22	1,406,799.42
SIEMENS AG-REG	31,532	99.51	3,137,749.32
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	11.99	137,726.59
THALES SA	4,530	102.80	465,684.00
VINCI S.A.	20,954	71.60	1,500,306.40
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	14.25	269,462.26
BIC	1,337	90.50	120,998.50
BUREAU VERITAS SA	12,626	17.67	223,101.42
EDENRED	9,497	32.36	307,322.92
RANDSTAD NV	4,694	39.72	186,445.68
TELEPERFORMANCE	2,489	144.20	358,913.80
WOLTERS KLUWER-CVA	12,856	52.00	668,512.00
AENA SME SA	2,881	136.40	392,968.40
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	163.70	220,340.20
ATLANTIA SPA	19,886	18.15	360,930.90
BOLLORE	39,433	3.54	139,592.82
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	19.36	179,319.90
DEUTSCHE POST AG-REG	41,384	24.22	1,002,320.48
FRAPORT AG	1,856	62.14	115,331.84
GETLINK	16,953	11.96	202,842.64
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	6.72	156,540.92
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	10.68	17,237.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,056	73.45	1,032,413.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	64.50	161,766.00
CONTINENTAL AG	4,655	123.25	573,728.75
DAIMLER AG	37,290	47.22	1,761,020.25
FAURECIA	3,127	31.79	99,407.33
FERRARI NV	4,838	92.32	446,644.16
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,785	13.97	639,799.59
MICHELIN (CGDE)-B	6,820	86.54	590,202.80

NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	26.93	148,303.51
PIRELLI & C SPA	17,484	5.74	100,498.03
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	6,624	55.14	365,247.36
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	18.64	487,026.04
RENAULT SA	7,608	54.52	414,788.16
VALEO SA	9,959	24.59	244,891.81
VOLKSWAGEN AG	1,256	145.70	182,999.20
VOLKSWAGEN AG PFD	7,533	146.88	1,106,447.04
ADIDAS AG	7,694	187.05	1,439,162.70
HERMES INTERNATIONAL	1,312	477.30	626,217.60
HUGO BOSS AG	2,203	53.86	118,653.58
KERING	3,169	407.70	1,292,001.30
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,459	252.40	2,892,251.60
MONCLER SPA	7,711	28.18	217,295.98
PUMA SE	383	416.00	159,328.00
SEB SA	1,032	109.80	113,313.60
ACCOR SA	7,551	36.61	276,442.11
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,443	70.55	242,903.65
SODEXO	3,900	91.16	355,524.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	50.75	86,173.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	18.13	158,246.01
JC DECAUX SA	2,828	24.88	70,360.64
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	15.77	171,174.52
PUBLICIS GROUPE	9,116	50.58	461,087.28
RTL GROUP	1,615	47.56	76,809.40
SES	13,865	17.15	237,854.07
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	42.40	92,474.40
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	71.46	251,753.58
VIVENDI SA	43,372	21.34	925,558.48
DELIVERY HERO SE	3,417	29.00	99,093.00
INDITEX	45,043	23.87	1,075,176.41
ZALANDO SE	5,372	24.39	131,023.08
CARREFOUR SA	26,320	14.91	392,431.20
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	36.38	66,684.54
COLRUYT NV	3,100	61.72	191,332.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	10.21	125,276.70
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	50,462	22.40	1,130,601.11
METRO AG	8,344	12.67	105,760.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	31,302	61.35	1,920,377.70
DANONE	25,166	62.82	1,580,928.12
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	7.68	176,432.23
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	76.90	406,954.80

HEINEKEN NV	10,479	80.10	839,367.90
KERRY GROUP PLC-A	6,469	88.50	572,506.50
PERNOD-RICARD SA	8,648	145.60	1,259,148.80
REMY COINTREAU	1,273	102.40	130,355.20
BEIERSDORF AG	4,089	93.06	380,522.34
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	85.50	400,225.50
HENKEL AG & CO KGAA	7,132	96.40	687,524.80
L'OREAL	10,365	203.10	2,105,131.50
UNILEVER NV-CVA	63,563	47.90	3,044,667.70
BIOMERIEUX	1,779	57.80	102,826.20
ESSILORLUXOTTICA	11,967	109.90	1,315,173.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	59.00	541,679.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,875	42.71	720,731.25
KONINKLIJKE PHILIPS NV	39,099	31.87	1,246,085.13
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	117.00	153,036.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	36.90	242,949.60
BAYER AG	38,412	61.63	2,367,331.56
EUROFINS SCIENTIFIC	484	315.20	152,556.80
GRIFOLS S.A.	11,922	23.02	274,444.44
IPSEN	1,498	111.15	166,502.70
MERCK KGAA	5,705	93.48	533,303.40
ORION OYJ	4,259	30.92	131,688.28
QIAGEN N.V.	10,011	29.80	298,327.80
RECORDATI SPA	4,578	29.20	133,677.60
SANOFI	46,468	76.81	3,569,207.08
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	89.05	138,472.75
UCB SA	5,244	72.14	378,302.16
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	21.49	406,504.84
AIB GROUP PLC	36,918	3.70	136,596.60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	277,077	4.72	1,309,881.51
BANCO DE SABADELL SA	235,029	1.03	243,725.07
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	672,849	4.04	2,719,319.23
BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	5.16	194,377.20
BANKIA SA	48,396	2.74	132,653.43
BANKINTER,S.A.	26,969	7.15	192,936.22
BNP PARIBAS	46,176	40.88	1,887,674.88
CAIXABANK	149,132	3.35	500,337.86
COMMERZBANK AG	46,644	6.18	288,539.78
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	9.87	489,434.01
ERSTE GROUP BANK AG	12,044	30.34	365,414.96
ING GROEP NV-CVA	159,267	9.86	1,570,691.15

INTESA SANPAOLO	617,935	2.01	1,247,610.76
KBC GROUPE SA	10,878	59.66	648,981.48
MEDIOBANCA SPA	26,782	7.70	206,435.65
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	22.72	151,701.44
SOCIETE GENERALE	31,146	28.90	900,119.40
UNICREDIT SPA	81,227	10.74	873,027.79
AMUNDI SA	2,379	46.33	110,219.07
DEUTSCHE BANK AG -REG	78,904	7.53	594,147.12
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	104.85	862,600.95
EURAZEO	2,123	61.10	129,715.30
EXOR NV	4,683	49.47	231,668.01
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	74.94	252,922.50
NATIXIS	45,362	4.17	189,204.90
WENDEL	1,082	101.10	109,390.20
AEGON NV	74,580	4.19	312,490.20
AGEAS	7,277	39.43	286,932.11
ALLIANZ SE-REG	17,965	175.94	3,160,762.10
ASSICURAZIONI GENERALI	46,934	14.64	687,348.43
AXA SA	79,482	18.95	1,506,342.86
CNP ASSURANCES	8,978	18.65	167,439.70
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,386	117.80	281,070.80
MAPFRE SA	46,367	2.36	109,565.22
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,073	190.05	1,154,173.65
NN GROUP NV	12,995	34.64	450,146.80
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.10	188,802.69
SAMPO OYJ-A SHS	17,779	38.91	691,780.89
SCOR SE	7,100	38.47	273,137.00
AROUNDTOWN SA	34,226	7.48	256,181.61
DEUTSCHE WOHNEN SE	14,223	41.67	592,672.41
VONOVIA SE	20,051	41.85	839,134.35
AMADEUS IT GROUP SA	18,235	61.28	1,117,440.80
ATOS SE	3,678	71.62	263,418.36
CAPGEMINI SA	6,598	91.18	601,605.64
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	104.30	576,674.70
SAP SE	40,961	89.22	3,654,540.42
WIRECARD AG	4,828	135.95	656,366.60
INGENICO S.A.	2,691	50.36	135,518.76
NOKIA OYJ	234,012	5.12	1,199,545.51
1&1 DRILLISCH AG	2,188	44.36	97,059.68
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	136,676	15.37	2,101,393.50
ELISA OYJ	5,909	37.79	223,301.11
ILIAD SA	1,016	128.55	130,606.80



	KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.60	368,740.35
	ORANGE S.A.	82,902	14.35	1,190,058.21
	PROXIMUS SA	6,313	24.14	152,395.82
	TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.54	269,364.23
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.46	116,212.04
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	3.58	144,893.27
	TELEFONICA S.A.	191,224	7.60	1,453,302.40
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,179	38.07	159,094.53
	E.ON SE	88,372	8.96	792,254.98
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	97,998	2.98	292,916.02
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	13.77	328,905.67
	ENDESA S.A.	12,944	21.13	273,506.72
	ENEL SPA	332,024	5.12	1,701,290.97
	ENGIE	73,662	12.79	942,505.29
	FORTUM OYJ	19,573	20.31	397,527.63
	IBERDROLA SA	254,466	7.05	1,794,494.23
	INNOGY SE	5,851	40.58	237,433.58
	NATURGY ENERGY GROUP SA	16,170	22.91	370,454.70
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	16,549	20.18	333,958.82
	RWE AG	22,852	19.32	441,500.64
	SUEZ	17,725	11.80	209,155.00
	TERNA SPA	66,384	5.14	341,346.52
	UNIPER SE	8,953	21.78	194,996.34
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	18.39	396,984.93
	VERBUND AG	3,012	39.08	117,708.96
	ASML HOLDING NV	16,869	140.98	2,378,191.62
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	17.49	846,953.25
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	12.03	337,345.26
	ユーロ 小計	8,371,628		143,371,062.94 (18,377,302,847)
英債券	BP PLC	827,229	5.02	4,156,825.72
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	190,106	22.96	4,365,784.29
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	154,736	23.18	3,586,780.48
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.15	168,199.00
	ANGLO AMERICAN PLC	44,719	17.53	783,924.07
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.86	152,790.54
	BHP GROUP PLC	89,998	16.67	1,500,266.66
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,134	47.23	242,478.82
	FRESNILLO PLC	8,512	8.30	70,649.60
	GLENCORE PLC	472,208	2.94	1,390,180.35
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,294	27.69	201,970.86
	MONDI PLC	14,017	16.30	228,477.10

RANDGOLD RESOURCES LTD	3,897	67.08	261,410.76
RIO TINTO PLC	48,743	38.23	1,863,688.60
ASHTED GROUP PLC	19,216	16.56	318,313.04
BAE SYSTEMS PLC	128,567	4.55	585,622.68
BUNZL PLC	13,431	23.88	320,732.28
DCC PLC	3,732	60.10	224,293.20
FERGUSON PLC	9,945	49.95	496,752.75
MEGGITT PLC	36,960	4.82	178,479.84
MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	1.60	340,872.03
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	8.20	588,197.87
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	3,297,234	0.00	3,297.23
SMITHS GROUP PLC	18,742	13.97	261,825.74
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	13.07	120,531.54
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	5.11	58,468.62
EXPERIAN PLC	38,155	18.60	709,873.77
G4S PLC	74,291	1.88	139,667.08
INTERTEK GROUP PLC	6,794	48.09	326,723.46
RELX PLC	80,620	16.18	1,304,431.60
EASYJET PLC	7,630	10.75	82,022.50
ROYAL MAIL PLC	36,064	2.80	100,979.20
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	4.50	178,891.47
BURBERRY GROUP PLC	17,470	17.32	302,580.40
PERSIMMON PLC	13,916	18.93	263,429.88
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.35	175,336.82
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	34.03	181,584.08
CARNIVAL PLC	8,091	43.48	351,796.68
COMPASS GROUP PLC	65,227	16.70	1,089,617.03
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.90	164,509.80
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,601	41.65	316,581.65
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.22	104,898.65
TUI AG-DI	17,636	11.45	202,020.38
WHITBREAD PLC	7,771	44.65	346,975.15
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	4.45	187,219.95
INFORMA PLC	54,642	6.29	344,135.31
ITV PLC	151,064	1.27	193,059.79
PEARSON PLC	29,681	9.38	278,407.78
WPP PLC	54,571	8.92	486,882.46
KINGFISHER PLC	79,966	2.14	171,447.10
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.52	180,158.75
NEXT PLC	5,406	42.42	229,322.52
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.67	171,307.25
TESCO PLC	426,993	1.92	823,882.99

WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.22	224,451.23
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	21.26	356,551.46
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	94,609	25.50	2,413,002.54
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.15	210,201.60
DIAGEO PLC	102,258	28.07	2,870,893.35
IMPERIAL BRANDS PLC	38,916	23.19	902,462.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	27,459	61.80	1,696,966.20
UNILEVER PLC	47,299	42.15	1,993,652.85
CONVATEC GROUP PLC	61,239	1.39	85,703.98
NMC HEALTH PLC	3,733	27.86	104,001.38
SMITH & NEPHEW PLC	37,643	14.52	546,576.36
ASTRAZENECA PLC	52,240	59.68	3,117,683.20
GLAXOSMITHKLINE PLC	204,536	15.03	3,074,176.08
SHIRE PLC	38,624	44.32	1,711,815.68
BARCLAYS PLC	696,878	1.51	1,055,491.41
HSBC HOLDINGS PLC	829,455	6.52	5,413,852.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,996,126	0.52	1,565,475.83
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.09	439,016.34
STANDARD CHARTERED PLC	113,158	5.92	670,687.46
3I GROUP PLC	37,751	7.75	292,721.25
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	18.21	201,057.17
INVESTEC PLC	33,008	4.33	143,155.69
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	40.30	522,973.10
SCHRODERS PLC	6,213	24.02	149,236.26
ST JAMES' S PLACE PLC	21,830	9.26	202,320.44
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.51	257,312.21
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	19.60	153,703.20
AVIVA PLC	160,889	3.69	594,163.07
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.06	193,980.78
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.28	570,007.30
PRUDENTIAL PLC	106,216	14.08	1,495,521.28
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.05	204,889.46
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	14.05	256,011.82
SAGE GROUP PLC/THE	40,993	5.97	244,892.18
BT GROUP PLC	365,274	2.48	907,523.25
VODAFONE GROUP PLC	1,093,340	1.59	1,743,439.96
CENTRICA PLC	254,915	1.34	342,223.38
NATIONAL GRID PLC	136,631	7.77	1,062,169.39
SEVERN TRENT PLC	9,868	18.20	179,597.60
SSE PLC	44,560	10.59	472,113.20
UNITED UTILITIES GROUP PLC	25,020	7.49	187,549.92
	15,865,429		70,707,780.85

英ポンド 小計				(10,048,989,814)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.24	184,242.24
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	462.20	148,366.20
	GIVAUDAN-REG	371	2,350.00	871,850.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,605	41.50	855,107.50
	SIKA AG	5,281	123.90	654,315.90
	ABB LTD	75,161	19.30	1,450,983.10
	GEBERIT AG-REG	1,593	378.10	602,313.30
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	700	190.50	133,350.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	197.30	335,607.30
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	45.88	322,031.72
	SGS SA	219	2,278.00	498,882.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	124.90	295,013.80
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	21,276	63.20	1,344,643.20
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	289.70	385,301.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	57.00	143,412.00
	DUFREY AG-REG	1,180	93.96	110,872.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,570.00	171,130.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,155.00	276,975.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	74,000.00	296,000.00
	NESTLE SA-REGISTERED	127,704	81.88	10,456,403.52
	SONOVA HOLDING AG	2,643	161.60	427,108.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	622.00	270,570.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	283.70	896,492.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	90,055	84.60	7,618,653.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	29,067	243.85	7,087,987.95
	VIFOR PHARMA AG	1,781	111.35	198,314.35
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	103,978	10.95	1,139,078.99
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	36.16	345,617.28
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	68.95	128,729.65
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	679	602.50	409,097.50
	UBS GROUP AG	158,442	12.39	1,963,888.59
	BALOISE HOLDING AG	1,987	136.30	270,828.10
SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	380.10	559,507.20	
SWISS RE AG	12,513	89.70	1,122,416.10	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,458	292.90	1,891,548.20	
SWISS PRIME SITE-REG	3,252	80.55	261,948.60	
TEMENOS GROUP AG-REG	2,416	118.40	286,054.40	
SWISSCOM AG-REG	1,009	478.90	483,210.10	
	スイスフラン 小計	710,370		44,897,851.39 (5,079,293,927)
	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	223.20	1,525,348.80

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,246	200.60	2,055,347.60	
	ALFA LAVAL AB	12,041	196.05	2,360,638.05	
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	160.50	6,970,515.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	26,741	209.80	5,610,261.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,107	194.22	3,128,301.54	
	EPIROC AB-A	30,249	78.85	2,385,133.65	
	EPIROC AB-B	16,107	74.51	1,200,132.57	
	SANDVIK AB	45,022	127.40	5,735,802.80	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	144.05	2,263,169.55	
	SKF AB-B SHARES	16,642	133.50	2,221,707.00	
	VOLVO AB-B SHS	64,505	118.60	7,650,293.00	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	143.90	1,760,472.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	192.10	2,121,936.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	68.62	1,275,851.66	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	136.12	4,934,077.76	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	318.50	1,130,675.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	367.30	2,774,951.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,955	225.10	5,392,270.50	
	NORDEA BANK ABP	123,125	78.07	9,612,368.75	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	64,701	88.18	5,705,334.18	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,856	102.55	6,240,782.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	201.90	7,880,157.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	181.70	1,138,532.20	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	386.60	7,691,407.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	215.90	2,430,386.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	268.60	841,792.40	
ERICSSON LM-B SHS	126,565	80.46	10,183,419.90		
HEXAGON AB-B SHS	11,065	412.50	4,564,312.50		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	579.50	1,561,173.00		
TELE2 AB-B SHS	18,857	112.45	2,120,469.65		
TELIA CO AB	126,963	43.42	5,512,733.46		
	スウェーデンクローナ 小計	1,031,224		127,979,756.12 (1,584,389,380)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,073	222.20	1,127,220.60	
	EQUINOR ASA	47,614	189.95	9,044,279.30	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	40.55	2,450,598.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	340.00	2,547,280.00	
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	258.50	962,654.00	
	MARINE HARVEST ASA	16,923	194.65	3,294,061.95	
	ORKLA ASA	33,915	71.00	2,407,965.00	
	DNB ASA	40,610	143.65	5,833,626.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,997	135.40	947,393.80	

	TELENOR ASA	31,196	171.70	5,356,353.20	
	ノルウェークローネ 小計	253,978		33,971,433.05 (438,571,200)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	597.60	2,447,769.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,536	297.30	2,537,752.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	7,656	503.40	3,854,030.40	
	ISS A/S	6,409	191.05	1,224,439.45	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	7,985.00	1,341,480.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	8,528.00	2,515,760.00	
	DSV A/S	7,505	457.40	3,432,787.00	
	PANDORA A/S	4,763	278.80	1,327,924.40	
	CARLSBERG AS-B	4,678	715.80	3,348,512.40	
	COLOPLAST-B	4,991	625.80	3,123,367.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	195.10	869,170.50	
	GENMAB A/S	2,773	1,060.00	2,939,380.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	292.00	845,632.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	75,184	296.75	22,310,852.00	
	DANSKE BANK A/S	29,784	134.50	4,005,948.00	
	TRYG A/S	5,005	164.40	822,822.00	
ORSTED A/S	7,743	456.80	3,537,002.40		
	デンマーククローネ 小計	176,937		60,484,630.75 (1,037,916,263)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,988	25.44	254,094.72	
	OIL SEARCH LTD	60,868	6.85	416,945.80	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	6.46	481,832.02	
	SANTOS LTD	71,529	5.22	373,381.38	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	25.81	115,602.99	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,184	30.19	1,152,774.96	
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	11.37	152,176.08	
	ALUMINA LTD	106,977	2.24	239,628.48	
	AMCOR LIMITED	50,321	13.27	667,759.67	
	BHP GROUP LTD	133,459	33.49	4,469,541.91	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	11.60	267,832.40	
	BORAL LIMITED	42,214	4.96	209,381.44	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	4.13	300,911.80	
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.38	207,379.90	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	15.04	281,112.64	
	NEWCREST MINING LIMITED	31,386	21.42	672,288.12	
	ORICA LIMITED	17,981	17.45	313,768.45	
	RIO TINTO LIMITED	14,839	76.60	1,136,667.40	
	SOUTH32 LTD	223,474	3.31	739,698.94	
CIMIC GROUP LTD	4,062	42.65	173,244.30		

	BRAMBLES LIMITED	67,015	10.02	671,490.30
	SEEK LIMITED	12,504	17.24	215,568.96
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.32	375,338.88
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,068	21.81	568,543.08
	CROWN RESORTS LTD	16,521	11.78	194,617.38
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	2,137	39.72	84,881.64
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	42.49	112,598.50
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.27	317,576.98
	REA GROUP LTD	1,767	75.35	133,143.45
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.17	65,121.31
	WESFARMERS LIMITED	46,407	31.95	1,482,703.65
	COLES GROUP LIMITED	46,407	11.82	548,530.74
	WOOLWORTHS GROUP LTD	55,613	28.66	1,593,868.58
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	16,808	8.39	141,019.12
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	14.38	459,929.92
	COCHLEAR LIMITED	2,171	170.56	370,285.76
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	53.87	332,647.25
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	21.86	389,916.82
	CSL LIMITED	18,579	178.15	3,309,848.85
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	120,270	23.94	2,879,263.80
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	9.47	169,048.97
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.40	206,346.40
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	72,493	69.40	5,031,014.20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	111,493	23.32	2,600,016.76
	WESTPAC BANKING CORPORATION	142,818	24.33	3,474,761.94
	AMP LIMITED	129,763	2.39	310,133.57
	ASX LTD	9,287	58.36	541,989.32
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	9.65	222,162.30
	MACQUARIE GROUP LTD	13,075	109.91	1,437,073.25
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	6.97	703,983.94
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.40	308,937.60
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	9.87	574,700.49
	SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.06	683,991.38
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	17.06	331,953.48
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	2.88	488,825.28
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.63	117,735.54
	AGL ENERGY LIMITED	25,006	19.64	491,117.84
	AUSNET SERVICES	85,220	1.57	134,221.50
	オーストラリアドル 小計	2,943,583		44,700,932.13 (3,584,120,738)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,032	4.85	150,505.20
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	7.15	303,925.05

	A2 MILK CO LTD	25,383	10.75	272,867.25	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	12.50	274,737.50	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	11.20	221,984.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	4.17	332,799.36	
	MERIDIAN ENERGY LTD	63,346	3.40	215,693.13	
	ニュージーランドドル 小計	283,875		1,772,511.49 (135,224,901)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	109,424	78.55	8,595,255.20	
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	16.98	1,180,110.00	
	MTR CORPORATION	67,000	41.00	2,747,000.00	
	MINH GROUP LTD	32,000	25.10	803,200.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	42.00	2,352,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	24.05	649,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	93,000	50.70	4,715,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	13.90	611,600.00	
	SANDS CHINA LTD	93,600	34.95	3,271,320.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	10.58	677,120.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.36	588,800.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	18.12	1,282,896.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	6.00	2,385,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	24.80	1,309,936.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	29.45	4,623,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	33,100	176.00	5,825,600.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	47,800	231.40	11,060,920.00	
	AIA GROUP LTD	498,000	64.45	32,096,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	107,424	59.20	6,359,500.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	20.65	867,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	15.66	1,534,680.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,622	40.20	1,954,604.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	38.25	1,109,250.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	28.50	783,750.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	10.90	2,848,529.70	
	SINO LAND CO	124,200	13.96	1,733,832.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	64,000	114.90	7,353,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,000	83.60	1,504,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	27.65	1,465,450.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	20.60	1,215,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	48.90	2,347,200.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	45.60	1,504,800.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.52	876,880.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	59.20	1,776,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	66,100	88.30	5,836,630.00	



	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.73	858,030.00
	HONG KONG & CHINA GAS	387,286	16.02	6,204,321.72
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	54.35	3,261,000.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	78.85	969,855.00
	香港ドル 小計	3,866,309		137,140,370.82 (1,972,078,532)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.01	352,186.00
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.57	112,360.40
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.48	237,684.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.24	111,600.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	71,100	2.14	152,154.00
	SATS LTD	26,800	4.59	123,012.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.37	234,868.42
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	0.99	277,893.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	86,650	2.39	207,093.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	35.99	169,153.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.25	88,400.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.12	218,088.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	23.57	1,812,533.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	126,800	11.14	1,412,552.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	54,600	24.36	1,330,056.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.13	253,828.00
	CAPITALAND LTD	104,500	3.14	328,130.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.21	132,181.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.13	133,021.00
	VENTURE CORP LTD	11,900	14.29	170,051.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	334,915	2.96	991,348.40	
	シンガポールドル 小計	1,962,151		8,848,192.72 (726,259,658)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	20.30	582,833.30
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	470.20	378,511.00
	BANK HAPUALIM BM	44,062	25.12	1,106,837.44
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	24.09	1,579,677.66
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	65.80	358,083.60
	AZRIELI GROUP	2,140	189.30	405,102.00
	NICE LTD	2,768	414.00	1,145,952.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	3.77	377,444.86
	イスラエルシュケル 小計	249,620		5,934,441.86 (177,677,189)
	合 計	50,154,486		150,004,951,721 (150,004,951,721)

(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 599銘柄	63.2%	67.5%
カナダドル	株式 88銘柄	3.5%	3.7%
ユーロ	株式 239銘柄	11.5%	12.3%
英ポンド	株式 95銘柄	6.3%	6.7%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.2%	3.4%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	1.0%	1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	2.2%	2.4%
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 39銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	19,703	348,743.10	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	518,860.44	
		AMERICAN TOWER CORP	18,353	2,983,096.62	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	51,312	518,251.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,571	1,007,125.38	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,157	726,649.14	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	8,328	127,668.24	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	380,761.92	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,532	925,807.32	
		DUKE REALTY CORP	13,732	371,862.56	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,828	1,011,714.44	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	693,442.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	506,880.90	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	396,390.80	
		HCP, INC.	20,162	571,391.08	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	552,210.96	
		INVITATION HOMES INC	14,734	304,109.76	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	404,729.55	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	235,616.64	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	302,681.52	
MACERICH COMPANY/THE	3,806	162,820.68			

	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	466,572.36
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	317,656.16
	PROLOGIS INC	26,239	1,607,138.75
	PUBLIC STORAGE	6,516	1,324,377.00
	REALTY INCOME CORPORATION	11,714	756,958.68
	REGENCY CENTERS CORP	6,080	351,120.00
	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,869	2,212,824.55
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	331,222.20
	UDR INC	10,651	438,821.20
	VENTAS INC	14,830	910,710.30
	VEREIT INC	44,740	335,102.60
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	490,621.59
	WELLTOWER INC	14,980	1,065,377.60
	WEYERHAEUSER CO	30,388	705,001.60
	WP CAREY INC	6,694	460,480.26
	米ドル 小計	480,327	24,824,799.90 (2,795,272,468)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	80,554.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	178,137.54
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	112,748.25
	カナダドル 小計	14,851	371,440.29 (31,015,264)
ユーロ	COVIVIO	1,550	129,890.00
	GECINA SA	1,738	208,212.40
	ICADE	1,265	83,363.50
	KLEPIERRE	9,305	263,796.75
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	833,554.80
	ユーロ 小計	19,795	1,518,817.45 (194,682,020)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	34,772	191,176.45
	HAMMERSON PLC	34,414	120,070.44
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	271,631.11
	SEGRO PLC	40,873	242,785.62
	英ポンド 小計	142,762	825,663.62 (117,343,313)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	414,676.59
	DEXUS	43,102	481,880.36
	GOODMAN GROUP	64,265	703,701.75
	GPT GROUP	69,713	386,210.02
	LENDLEASE GROUP	25,262	300,112.56

	MIRVAC GROUP		140,993	324,283.90	
	SCENTRE GROUP		234,290	937,160.00	
	STOCKLAND		103,417	381,608.73	
	SYDNEY AIRPORT		49,760	349,315.20	
	TRANSURBAN GROUP		104,775	1,246,822.50	
	VICINITY CENTRES		146,656	394,504.64	
	オーストラリアドル 小計		1,030,620	5,920,276.25 (474,687,749)	
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD		136,000	1,542,240.00	
	LINK REIT		92,500	7,265,875.00	
	香港ドル 小計		228,500	8,808,115.00 (126,660,693)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		118,300	307,580.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		95,700	172,260.00	
	CAPITALAND MALL TRUST		102,800	236,440.00	
	SUNTEC REIT		65,600	120,048.00	
	シンガポールドル 小計		382,400	836,328.00 (68,645,802)	
合計				3,808,307,309 (3,808,307,309)	

(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	36銘柄	1.7%	73.4%
カナダドル	投資証券	3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.1%	5.1%
英ポンド	投資証券	4銘柄	0.1%	3.1%
オーストラリアドル	投資証券	11銘柄	0.3%	12.5%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	3.3%
シンガポールドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.8%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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>

貸借対照表

	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	330	9,971
コール・ローン	9,678	-
親投資信託受益証券	3,177,097,602	3,724,748,321
未収入金	1,289,999	-
流動資産合計	3,178,397,609	3,724,758,292
資産合計	3,178,397,609	3,724,758,292
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,289,999	-
未払受託者報酬	7,519	13,208
未払委託者報酬	3,758	6,603
その他未払費用	939	1,650
流動負債合計	1,302,215	21,461
負債合計	1,302,215	21,461
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,790,930,806	2,143,614,966
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,386,164,588	1,581,121,865
元本等合計	3,177,095,394	3,724,736,831
純資産合計	3,177,095,394	3,724,736,831
負債純資産合計	3,178,397,609	3,724,758,292

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成30年12月18日 至平成30年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,790,930,806口	2,143,614,966口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7740円 (10,000口当たりの純資産額 17,740円)	1口当たり純資産額 1.7376円 (10,000口当たりの純資産額 17,376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	自平成30年12月18日 至平成30年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月20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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(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 平成30年12月18日 至 平成30年12月20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	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
期首元本額	1,791,658,838円	2,147,006,651円
期中追加設定元本額	-円	-円
期中一部解約元本額	728,032円	3,391,685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
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	2,122,847,556	3,724,748,321	
合計		2,122,847,556	3,724,748,321	

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）

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＞は、「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成29年12月20日現在）	（平成30年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	405,471,755	314,785,633
金銭信託	8,092,878	577,683,890
コール・ローン	237,537,381	-
国債証券	193,072,354,181	165,564,143,521
派生商品評価勘定	2,211	381,586
未収入金	1,029,377,863	1,123,373,963
未収利息	1,500,463,204	1,266,170,787
前払費用	21,285,199	28,823,626
流動資産合計	196,274,584,672	168,875,363,006
資産合計	196,274,584,672	168,875,363,006
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,059,594	1,568,184
未払解約金	490,590,136	1,235,583,895
未払利息	647	-
その他未払費用	478	8,691
流動負債合計	496,650,855	1,237,160,770
負債合計	496,650,855	1,237,160,770
純資産の部		
元本等		
元本	109,365,735,384	95,540,909,854
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	86,412,198,433	72,097,292,382
元本等合計	195,777,933,817	167,638,202,236
純資産合計	195,777,933,817	167,638,202,236
負債純資産合計	196,274,584,672	168,875,363,006

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年12月18日 至 平成30年12月20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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年12月20日現在)	(平成30年12月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	109,365,735,384口	95,540,909,854口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7901円 (10,000口当たりの純資産額 17,901円)	1口当たり純資産額 1.7546円 (10,000口当たりの純資産額 17,546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 平成30年12月18日 至 平成30年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
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、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 (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委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月20日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成29年12月20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	228,387	-	229,058	671
	米ドル	71,162	-	71,408	246
	英ポンド	48,280	-	48,457	177
	デンマーククローネ	37,335	-	37,571	236
	オーストラリアドル	71,610	-	71,622	12
	売建	1,574,924,543	-	1,580,982,597	6,058,054
	米ドル	669,893,912	-	671,377,339	1,483,427
	カナダドル	42,940,128	-	43,055,552	115,424
	ユーロ	660,819,161	-	664,610,106	3,790,945
	英ポンド	99,276,432	-	99,597,537	321,105
	ノルウェークローネ	15,124,204	-	15,129,799	5,595
	デンマーククローネ	30,733,437	-	30,998,562	265,125
	オーストラリアドル	56,137,269	-	56,213,702	76,433
合計	1,575,152,930	-	1,581,211,655	6,057,383	

(平成30年12月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	1,029,403,277	-	1,030,589,875	1,186,598
	米ドル	481,419,204	-	481,672,653	253,449
	カナダドル	16,222,373	-	16,131,635	90,738
	ユーロ	370,119,692	-	371,284,016	1,164,324
	英ポンド	67,636,089	-	67,645,696	9,607
	ノルウェークロー ネ	12,143,086	-	12,028,791	114,295
	デンマーククロ ネ	8,974,846	-	9,000,960	26,114
	オーストラリアド ル	20,054,185	-	19,878,631	175,554
	シンガポールドル	18,301,079	-	18,307,060	5,981
	南アフリカランド	34,532,723	-	34,640,433	107,710
合計	1,029,403,277	-	1,030,589,875	1,186,598	

## （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 平成30年12月18日

至 平成30年12月20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)

(平成29年12月20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	109,632,576,441円
同期中における追加設定元本額	11,686,625円
同期中における一部解約元本額	278,527,682円
平成29年12月20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	9,319,472,192円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	459,274,015円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,286,373,553円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	657,438,711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)	104,361,905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)	9,157,799円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	29,418,160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)	76,368,088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)	68,080,490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)	34,550,724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)	89,885,625円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	9,924,702円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	104,851,315円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	563,157,541円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	599,753,814円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,913,352円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	266,414円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,256,239円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	3,562,224円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,669,864円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,244,789円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	3,205,926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>	1,774,815,710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>	1,319,549,606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>	14,851,179,195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>	6,648,961,958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>	15,054,801,682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>	43,696,403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>	121,974,110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>	1,213,202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>	938,475,522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>	147,725,620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>	1,434,030,519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 >	1,765,339,037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 >	3,225,831,390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 >	7,898,243,395円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	130,657,843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 >	12,770,657,962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 )	1,147,033,015円
三井住友 ・ 5資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,304,641,226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 >	229,263,825円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	713,185,726円
三井住友 ・ 7資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,688,539,060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 >	171,817,237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 >	48,083,151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 >	15,190,605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 >	171,912,206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 >	624,328,555円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	196,185,158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 >	183,960,784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 >	54,582,186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 >	7,027,104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 >	1,592,315,188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 >	23,792,981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 >	4,637,499,307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 >	2,248,436,510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 >	7,143,194,418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 >	2,637,262,820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 >	720,813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 >	398,221,098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 5 < 適格機関投資家限定 >	190,808,561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 >	377,393,254円
合計	109,365,735,384円

(平成30年12月20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	96,220,120,290円
同期中における追加設定元本額	59,814,966円
同期中における一部解約元本額	739,025,402円
平成30年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 外国債券インデックスファンド S	10,552,181,053円
三井住友 ・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	554,981,860円
三井住友 ・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	1,516,082,759円
三井住友 ・ D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	773,983,428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 )	56,510,075円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4資産タイプ )	9,185,952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)	32,173,453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)	86,212,038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)	96,489,932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)	50,280,962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)	119,916,910円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	14,714,494円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	57,966,123円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,813,690円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	286,012,337円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,224,123円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	29,360,624円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	20,112,960円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	43,440,822円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,588,027円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,921,564円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,545,232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>	2,122,847,556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>	142,253,859円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,229,320,389円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,918,967,421円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,327,507,557円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	42,432,859円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	109,586,916円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	544,270円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	793,608,171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>	123,320,327円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,319,059,860円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,628,414,856円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,086,872,560円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,940,252,899円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,309,441円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,677,932,176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)	825,914,711円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,717,850,971円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	194,311,927円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	475,801,494円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,533,609,862円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	157,621,225円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	42,642,821円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,014,639円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	152,842,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	567,337,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	183,364,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	176,647,546円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	53,460,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,902,208円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,421,926,455円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,730,393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 >	3,953,188,104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 >	1,777,524,029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 >	6,196,835,258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 >	731,917,710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 >	28,771,508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 >	43,259,298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 >	475,549,050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 5 < 適格機関投資家限定 >	227,852,361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 >	561,077,401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 >	25,855円
合計	95,540,909,854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 1	500,000.00	492,578.12	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,953,359.39	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,953,359.39	
		US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,745,968.76	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,936,718.75	
		US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,677,390.64	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,891,953.14	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,328,789.08	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,594,109.37	
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,360,820.33	
		US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	494,062.50	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,952,187.50	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,949,375.00	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,492,000.00	
		US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,366,015.62	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,817,890.64	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,962,031.25	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,959,218.75	

US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,943,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,955,468.75	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,923,828.15	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,932,812.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,929,062.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,945,156.25	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,913,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,228,328.12	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,932,968.75	
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,613,570.33	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,921,718.75	
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,331,937.51	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,880,937.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,311,054.70	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,360,546.87	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,828,906.25	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,944,921.90	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,950,546.89	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	982,578.13	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,963,593.76	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,899,453.14	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,864,296.89	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,861,718.75	
US TREASURY N/B 1.5	4,800,000.00	4,395,750.00	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,957,500.00	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,974,218.76	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,443,398.45	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,948,906.25	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,431,367.20	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,894,296.89	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,857,187.52	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,369,570.33	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,874,843.75	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,872,500.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,859,140.64	
US TREASURY N/B 1.625	5,300,000.00	4,926,515.62	
US TREASURY N/B 1.625	5,300,000.00	4,914,507.83	
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,262,085.94	
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,965,625.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,925,234.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,919,609.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,403,750.00	

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,915,625.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,913,515.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,913,046.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,911,406.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,904,375.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,895,234.39
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,488,921.87
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,964,843.75
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,346,000.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,953,281.26
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,926,640.64
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,925,234.39
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,655,242.19
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,892,500.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,916,093.75
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,725,328.13
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,967,890.64
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,273,945.32
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,580,125.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,960,859.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,958,750.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,955,468.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,950,781.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,947,968.75
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,226,429.70
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,437,656.25
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,041,148.45
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,934,843.75
US TREASURY N/B 2	500,000.00	488,359.37
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,928,515.64
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,358,632.84
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,933,906.26
US TREASURY N/B 2	4,200,000.00	4,058,578.14
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,414,453.12
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,376,000.00
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,116,242.20
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,875,953.15
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,972,109.39
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,670,890.62
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,679,281.25
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,947,500.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,959,453.14
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,955,234.39

US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,948,437.50	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,920,937.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,024,437.50	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,947,500.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,894,062.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,400,195.33	
US TREASURY N/B 2.125	4,400,000.00	4,271,093.77	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,744,734.38	
US TREASURY N/B 2.125	3,400,000.00	3,283,656.25	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,966,562.52	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,974,687.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,983,125.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,772,875.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,941,640.64	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,960,625.00	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,465,195.32	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,145,945.34	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,025,648.45	
US TREASURY N/B 2.25	5,500,000.00	5,340,585.96	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,012,718.77	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	4,995,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,946,671.90	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,594,937.50	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,989,843.76	
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	2,983,125.00	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,988,281.26	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,187,718.75	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,508,562.52	
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,833,125.00	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,967,578.15	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,649,234.37	
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,551,484.39	
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,621,476.58	
US TREASURY N/B 2.5	4,400,000.00	3,972,718.77	
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,421,484.37	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,996,875.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,496,132.84	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	499,843.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,999,062.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,998,437.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,998,125.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,283,539.08	

US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,010,312.52
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,404,484.38
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000.00	6,027,187.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,009,531.26
US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,131,929.71
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,230,031.25
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,122,312.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,007,187.50
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,016,015.65
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	601,734.37
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	4,789,500.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,910,937.50
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	2,677,062.50
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,275,312.51
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,421,835.94
US TREASURY N/B 2.875	7,200,000.00	7,248,375.00
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,223,203.13
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,111,601.56
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,534,453.12
US TREASURY N/B 2.875	8,300,000.00	8,364,195.34
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,926,640.64
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,896,875.00
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,504,093.76
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,075,000.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,158,367.20
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,799,296.88
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,995,000.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,995,000.00
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,891,195.33
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,493,945.32
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,192,609.38
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,088,617.20
US TREASURY N/B 3	1,500,000.00	1,494,843.75
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,034,687.50
US TREASURY N/B 3.125	1,500,000.00	1,545,000.00
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,043,437.50
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,042,187.50
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,426,359.38
US TREASURY N/B 3.125	5,100,000.00	5,206,781.25
US TREASURY N/B 3.125	1,200,000.00	1,224,843.75
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,030,078.15
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,261,562.52
US TREASURY N/B 3.375	900,000.00	963,843.75

	US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,548,515.62	
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	870,812.50	
	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,063,281.28	
	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,103,515.65	
	US TREASURY N/B 3.625	3,800,000.00	4,205,531.25	
	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,542,578.15	
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,688,554.69	
	US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,518,437.52	
	US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,716,328.12	
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,201,718.75	
	US TREASURY N/B 4.25	1,800,000.00	2,170,125.00	
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	608,984.37	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,832,695.32	
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,712,812.50	
	US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,210,484.38	
	US TREASURY N/B 4.5	900,000.00	1,101,023.44	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,237,812.50	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,240,156.25	
	US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,651,085.94	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,932,070.32	
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	651,992.19	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	605,000.00	
	US TREASURY N/B 5.375	720,000.00	907,875.00	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	612,890.62	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,213,828.13	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,263,359.38	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	925,562.50	
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	666,562.50	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	633,554.69	
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,495,101.56	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,097,421.88	
	米ドル 小計	684,020,000.00	677,907,071.85 (76,332,336,290)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,912,020.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,275,300.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,950,100.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,937,600.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	926,460.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,490,295.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,991,620.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,966,520.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,160,040.00	

	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	999,470.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,093,224.00
	CANADA-GOV'T 2	1,100,000.00	1,103,520.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,500,000.00	1,529,100.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,369,552.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,026,800.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	2,047,500.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	596,020.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,031,830.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,046,320.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,915,425.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,522,000.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,992,705.00
	CANADA-GOV'T 5	1,200,000.00	1,725,816.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	811,428.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,000,000.00	1,458,890.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	734,640.00
	カナダドル 小計	37,100,000.00	39,614,195.00 (3,307,785,282)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	36,000,000.00	38,247,840.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	16,877,600.00
	MEXICAN BONOS 6.5	33,000,000.00	30,946,740.00
	MEXICAN BONOS 7.5	10,000,000.00	9,285,300.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	49,714,500.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	19,509,200.00
	MEXICAN BONOS 8.5	33,000,000.00	32,412,930.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	38,255,200.00
	メキシコペソ 小計	242,000,000.00	235,249,310.00 (1,317,396,136)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,360,890.00
	BELGIAN 0.8	1,800,000.00	1,860,822.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	710,066.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	502,000.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,861,320.00
	BELGIAN 0304 5	1,800,000.00	2,775,492.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,715,670.00
	BELGIAN 0318 3.75	1,600,000.00	1,723,136.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,556,562.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,469,650.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,293,230.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,992,961.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,663,320.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	568,985.00

BELGIAN 0333 3	500,000.00	621,120.00
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,018,670.00
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	533,920.00
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,455,034.00
BELGIAN 1	1,300,000.00	1,291,238.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	403,060.00
BELGIAN 1.6	500,000.00	483,855.00
BELGIAN 1.9	700,000.00	747,964.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	510,460.00
BELGIAN 3.75	900,000.00	1,300,401.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	985,350.00
BTPS 0.2	2,000,000.00	1,991,760.00
BTPS 0.35	500,000.00	500,015.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,475,445.00
BTPS 0.45	2,000,000.00	1,987,480.00
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,605,744.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,903,380.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,010,440.00
BTPS 0.9	800,000.00	786,216.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,947,460.00
BTPS 1.05	500,000.00	503,925.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	998,440.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,846,280.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,004,460.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,001,360.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	955,120.00
BTPS 1.5	700,000.00	671,055.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,906,880.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,731,480.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	992,700.00
BTPS 2	1,300,000.00	1,278,524.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,530,192.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,442,055.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,063,880.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	975,480.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,066,260.00
BTPS 2.3	600,000.00	620,304.00
BTPS 2.45	600,000.00	559,428.00
BTPS 2.5	600,000.00	614,244.00
BTPS 2.7	1,700,000.00	1,510,841.00
BTPS 2.8	900,000.00	773,838.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	950,560.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,462,395.00



BTPS 3.45	1,100,000.00	1,090,859.00	
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,434,734.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,666,925.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,137,380.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,429,152.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,176,160.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,649,250.00	
BTPS 4	2,700,000.00	2,989,629.00	
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,408,560.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,827,386.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,573,677.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,369,930.00	
BTPS 4.5	1,700,000.00	1,941,553.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,856,256.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,835,575.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,476,362.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	1,932,336.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,234,440.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,161,910.00	
BTPS 5	2,570,000.00	3,139,923.20	
BTPS 5	2,000,000.00	2,455,340.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,329,286.00	
BTPS 5.25	1,900,000.00	2,324,099.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,292,160.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,294,420.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	2,852,124.00	
BTPS 6	2,900,000.00	3,796,796.00	
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,392,729.60	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,342,990.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,334,460.00	
BUNDESOBL-171 0	2,000,000.00	2,017,100.00	
BUNDESOBL-172 0.25	2,000,000.00	2,033,080.00	
BUNDESOBL-173 0	2,500,000.00	2,535,400.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,047,610.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,299,610.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,800,000.00	2,843,904.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,850,000.00	2,853,363.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,600,000.00	3,745,836.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	935,595.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,550,325.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,300,000.00	2,368,057.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,800,000.00	1,924,272.00	

DEUTSCHLAND REP 1	2,650,000.00	2,846,550.50
DEUTSCHLAND REP 1.25	400,000.00	440,816.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,683,350.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,699,750.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,166,840.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,700,000.00	4,050,390.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,698,925.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,210,100.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,665,300.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,574,700.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,507,842.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,597,170.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,062,048.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	2,966,523.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,169,980.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	1,851,156.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,500,000.00	3,947,700.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,529,645.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,100,000.00	1,575,794.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,103,707.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,084,480.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	300,000.00	483,204.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,363,822.20
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,597,872.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	700,000.00	1,156,169.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,549,450.00
FINNISH GOV'T 0.5	100,000.00	99,585.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	500,970.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	206,378.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,074,410.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,072,750.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,109,830.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	669,560.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	726,474.00
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	736,820.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,093,460.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,255,210.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,024,630.00
FRANCE O.A.T. 0	2,700,000.00	2,728,998.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,010,460.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,012,080.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,334,178.00
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,960,100.00

FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	2,957,130.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,034,740.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,332,142.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	900,000.00	904,239.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,627,200.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,602,350.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	2,000,600.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,200,000.00	3,410,240.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,337,360.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,600,000.00	3,951,504.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,500,618.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	968,830.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,174,400.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,508,064.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000.00	4,821,633.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,697,925.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,300,000.00	3,896,970.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,368,545.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,561,650.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,755,946.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	3,439,850.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,220,200.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	3,300,000.00	4,073,553.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,287,660.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,800,000.00	2,661,408.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,888,169.40	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,479,995.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000.00	4,603,358.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000.00	5,283,036.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,300,000.00	3,554,167.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,442,100.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,900,000.00	4,697,043.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,176,060.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	827,118.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	401,336.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	722,582.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	700,280.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,029,970.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	306,093.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,053,580.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	680,190.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,168,930.00	

IRISH GOVT 3.9	500,000.00	584,145.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,055,656.80
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,101,030.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,962,975.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,500,000.00	1,521,900.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,020,600.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,723,851.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,538,985.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,454,922.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	413,468.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,749,120.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,117,140.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,644,315.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,800,000.00	2,250,702.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	1,889,563.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	879,288.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,598,685.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,169,140.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,425,680.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,172,310.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,028,489.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,108,690.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,017,840.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,447,740.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	204,626.00
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	428,484.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	188,950.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	519,160.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,500,000.00	1,645,515.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,093,170.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	723,822.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	710,330.00
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	688,104.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,110,500.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,135,380.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	875,015.00
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,606,200.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,973,842.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,334,360.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,496,920.00
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,105,368.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,028,340.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,046,860.00

	SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,047,840.00	
	SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,037,640.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,040,500.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,209,720.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,202,604.00	
	SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,017,620.00	
	SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,538,580.00	
	SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,322,320.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,354,088.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,071,500.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,173,760.00	
	SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,057,020.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	100,000.00	102,696.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,357,292.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,800,000.00	1,943,460.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,269,488.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,227,408.00	
	SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,650,000.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,850,000.00	2,450,584.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,385,940.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,800,000.00	3,496,668.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,900,000.00	2,703,681.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,438,380.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,189,660.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,600,000.00	2,324,464.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,100,000.00	1,481,370.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,826,076.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,035,350.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,061,773.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,900,000.00	2,823,571.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,604,360.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,393,825.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,153,414.00	
	ユーロ 小計	442,120,000.00	507,065,144.70 (64,995,610,247)	
英債券	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,187,856.00	
	UK TSY GILT 0.75	300,000.00	298,179.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,700,000.00	1,711,271.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,946,632.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,250,000.00	2,321,302.50	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,582,020.00	
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	439,200.00	

	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,445,556.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,102,600.00
	UK TSY GILT 1.75	1,300,000.00	1,304,147.00
	UK TSY GILT 1.75	500,000.00	492,930.00
	UK TSY GILT 2	2,100,000.00	2,142,378.00
	UK TSY GILT 2	1,800,000.00	1,917,738.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,870,748.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,015,088.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,871,258.00
	UK TSY GILT 3.25	2,100,000.00	2,700,012.00
	UK TSY GILT 3.5	2,300,000.00	3,095,823.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,194,140.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,102,680.00
	UK TSY GILT 3.75	1,650,000.00	1,783,683.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,410,368.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,653,180.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,851,631.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,390,620.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,869,826.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,358,070.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,577,356.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,322,560.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,604,689.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,215,444.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,868,733.00
	UK TSY GILT 4.5	700,000.00	981,729.00
	UK TSY GILT 4.5	1,700,000.00	2,596,512.00
	UK TSY GILT 4.75	1,250,000.00	1,713,875.00
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,966,900.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,986,704.00
	UK TSY GILT 6	600,000.00	866,976.00
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,909,494.00
	英債券 小計	61,920,000.00	76,669,908.50 (10,896,327,396)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	7,200,000.00	7,581,528.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,511,420.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,738,900.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	10,300,000.00	11,618,606.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	5,000,000.00	7,080,650.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	8,600,000.00	9,512,460.00
	スウェーデンクローナ 小計	43,100,000.00	49,043,564.00 (607,159,322)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,939,000.00

	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,044,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	7,000,000.00	7,174,300.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	2,000,000.00	2,031,800.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,299,600.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,375,600.00
ノルウェークローネ 小計		29,000,000.00	29,864,300.00 (385,548,113)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,555,650.00
	DENMARK - BULLET 0.5	1,000,000.00	1,024,300.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,427,000.00
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,337,600.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,714,000.00
	DENMARK - BULLET 4	1,000,000.00	1,042,000.00
	DENMARK - BULLET 4.5	12,200,000.00	21,259,720.00
デンマーククローネ 小計		40,700,000.00	52,360,270.00 (898,502,233)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,300,000.00	2,306,716.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,003,600.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,014,000.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,434,300.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	2,000,000.00	1,954,000.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,300,000.00	6,579,090.00
	POLAND GOVT BOND 4	1,500,000.00	1,620,600.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,136,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,436,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,770,528.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,245,000.00
ポーランドズロチ 小計		32,800,000.00	34,499,834.00 (1,031,200,038)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,987,760.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,002,300.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	404,440.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,300,000.00	2,272,630.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	400,000.00	402,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,582,895.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,060,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,858,534.20
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,548,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	810,480.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,127,523.10
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,300,000.00	2,442,370.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,048,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,073,000.00

	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,383,708.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,738,240.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,100,000.00	1,136,095.95	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,728,020.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,600,000.00	3,077,620.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,862,250.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,050,180.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,394,650.00	
	オーストラリアドル 小計	39,900,000.00	42,992,296.25 (3,447,122,313)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,110,001.86	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,034,320.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	414,350.76	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	725,235.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	600,000.00	637,762.68	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	316,006.86	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,043,081.30	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	817,996.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	560,555.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,200,000.00	1,330,159.08	
	シンガポールドル 小計	7,600,000.00	7,989,468.54 (655,775,577)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	5,000,000.00	4,943,049.10	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,100,000.00	8,684,588.64	
	MALAYSIA GOVT 4.378	6,500,000.00	6,554,143.05	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,053,397.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,910,503.40	
	マレーシアリングgit 小計	28,600,000.00	28,145,681.19 (757,681,737)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	63,000,000.00	43,388,100.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	19,000,000.00	18,826,150.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	63,000,000.00	51,111,900.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	6,000,000.00	5,361,600.00	
	南アフリカランド 小計	151,000,000.00	118,687,750.00 (931,698,837)	
	合計		165,564,143,521 (165,564,143,521)	

(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 219銘柄	45.5%	46.1%
カナダドル	国債証券 26銘柄	2.0%	2.0%



メキシコペソ	国債証券	8銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券	260銘柄	38.8%	39.3%
英ポンド	国債証券	39銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	11銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.1%
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%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.6%	0.6%

### 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。

### S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	435	970
コール・ローン	539	-
親投資信託受益証券	507,207,072	592,271,290
未収入金	360,000	-
流動資産合計	507,568,046	592,272,260
資産合計	507,568,046	592,272,260
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	360,000	-
流動負債合計	360,000	-
負債合計	360,000	-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	503,416,563	588,251,581
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,791,483	4,020,679
元本等合計	507,208,046	592,272,260
純資産合計	507,208,046	592,272,260
負債純資産合計	507,568,046	592,272,260

#### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	503,416,563口	588,251,581口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0075円 (10,000口当たりの純資産額 10,075円)	1口当たり純資産額 1.0068円 (10,000口当たりの純資産額 10,068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 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
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、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。</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</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19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（親投資信託受益証券）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>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 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19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	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
期首元本額	490,073,343円	594,837,530円
期中追加設定元本額	33,896,451円	11,796,587円
期中一部解約元本額	20,553,231円	18,382,536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
親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	586,233,090	592,271,290	

合計	586,233,090	592,271,290	
----	-------------	-------------	--

## 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）

S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## マネーインカム・マザーファンド

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成29年12月19日現在）	（平成30年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	346,533,566	647,966,752
コール・ローン	428,518,410	-
特殊債券	1,920,448,580	2,247,468,200
未収利息	4,376,562	6,476,831
前払費用	5,302,078	1,752,051
流動資産合計	2,705,179,196	2,903,663,834
資産合計	2,705,179,196	2,903,663,834
負債の部		
流動負債		
未払金	-	101,452,000
未払解約金	15,471,069	-
未払利息	1,187	-
その他未払費用	32	17,287
流動負債合計	15,472,288	101,469,287
負債合計	15,472,288	101,469,287
純資産の部		
元本等		
元本	2,660,488,891	2,773,612,622
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,218,017	28,581,925
元本等合計	2,689,706,908	2,802,194,547
純資産合計	2,689,706,908	2,802,194,547
負債純資産合計	2,705,179,196	2,903,663,834

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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	(平成29年12月19日現在)	(平成30年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,660,488,891口	2,773,612,622口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0110円 (10,000口当たりの純資産額 10,110円)	1口当たり純資産額 1.0103円 (10,000口当たりの純資産額 10,103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 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19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、特殊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、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。</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</p>

	<p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、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	(平成30年12月19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（特殊債券）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>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 平成30年 4月14日 至 平成30年12月19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）

（平成29年12月19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	1,308,650,457円
同期中における追加設定元本額	1,849,317,468円
同期中における一部解約元本額	497,479,034円
平成29年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	59,435,039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）	35,767,892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）	12,175,201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）	10,893,530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）	5,520,498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）	14,539,743円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	501,688,499円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 ＜適格機関投資家限定＞	487,692,909円
S M A M ・ F G マネーファンドV A ＜適格機関投資家限定＞	1,532,379,068円
合計	2,660,488,891円

（平成30年12月19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	2,395,913,189円
同期中における追加設定元本額	1,619,866,398円
同期中における一部解約元本額	1,242,166,965円
平成30年12月19日現在における元本の内訳	



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)	170,630,934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)	77,245,157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)	53,656,301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)	13,659,185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)	15,504,251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)	7,905,082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)	19,556,281円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	586,233,090円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	477,800,441円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	1,351,025,388円
合計	2,773,612,622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
特殊債券	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,459,000	
	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,226,000	
	第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	201,054,270	
	第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	131,000,000	132,051,930	
	第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,880,000	
	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,042,000	
	第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,207,000	
	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,357,000	
	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,027,000	
	第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	200,276,000	
	第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,236,000	
	第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,655,000	
	第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,453,000	
	第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,146,000	
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	100,260,000		

第24回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	100,138,000	
合計	2,232,000,000	2,247,468,200	

## 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19期中間計算期間(平成30年12月21日から令和1年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第19期中間計算期間 (令和1年6月20日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	599,491
コール・ローン	2,104,675
投資信託受益証券	483,768,004
流動資産合計	486,472,170
資産合計	486,472,170
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	550,000
未払受託者報酬	107,648
未払委託者報酬	968,786
未払利息	5
その他未払費用	8,050
流動負債合計	1,634,489
負債合計	1,634,489
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	383,054,294
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	101,783,387
元本等合計	484,837,681
純資産合計	484,837,681
負債純資産合計	486,472,170

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	7,649,801
営業収益合計	7,649,801
営業費用	
支払利息	571
受託者報酬	107,648
委託者報酬	968,786
その他費用	8,581
営業費用合計	1,085,586
営業利益又は営業損失（ ）	6,564,215
経常利益又は経常損失（ ）	6,564,215
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,564,215
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（ ）	377,890
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	100,605,843
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,407,339
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	3,407,339
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,416,120
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,416,120
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	101,783,387

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第19期中間計算期間 (令和 1年 6月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		383,054,294口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2657円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,657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19期中間計算期間 (令和1年6月20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19期中間計算期間 (令和1年6月20日現在)
期首元本額	403,800,377円
期中追加設定元本額	13,002,951円
期中一部解約元本額	33,749,034円

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第19期中間計算期間  
(令和1年6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,569,697
コール・ローン	5,510,841
投資信託受益証券	1,329,965,195
流動資産合計	1,337,045,733
資産合計	1,337,045,733
負債の部	
流動負債	
未払金	1,490,000
未払受託者報酬	287,109
未払委託者報酬	3,229,931
未払利息	15
その他未払費用	21,574
流動負債合計	5,028,629
負債合計	5,028,629
純資産の部	
元本等	
元本	883,491,158
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	448,525,946
元本等合計	1,332,017,104
純資産合計	1,332,017,104
負債純資産合計	1,337,045,733



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	27,375,227
営業収益合計	27,375,227
営業費用	
支払利息	1,413
受託者報酬	287,109
委託者報酬	3,229,931
その他費用	22,499
営業費用合計	3,540,952
営業利益又は営業損失（ ）	23,834,275
経常利益又は経常損失（ ）	23,834,275
中間純利益又は中間純損失（ ）	23,834,275
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（ ）	475,297
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	436,570,159
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,583,348
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	9,583,348
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,986,539
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,986,539
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	448,525,946

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第19期中間計算期間 (令和 1年 6月20日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		883,491,158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)	1.5077円 15,077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19期中間計算期間 (令和1年6月20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19期中間計算期間 (令和1年6月20日現在)
期首元本額	907,805,185円
期中追加設定元本額	19,318,117円
期中一部解約元本額	43,632,144円

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第19期中間計算期間 (令和 1年 6月20日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	2,390,689
コール・ローン	8,393,155
投資信託受益証券	1,755,963,466
流動資産合計	1,766,747,310
資産合計	1,766,747,310
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	2,380,000
未払解約金	20,436
未払受託者報酬	367,720
未払委託者報酬	4,136,781
未払利息	23
その他未払費用	27,706
流動負債合計	6,932,666
負債合計	6,932,666
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,078,041,173
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	681,773,471
元本等合計	1,759,814,644
純資産合計	1,759,814,644
負債純資産合計	1,766,747,310

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	53,697,014
営業収益合計	53,697,014
営業費用	
支払利息	2,459
受託者報酬	367,720
委託者報酬	4,136,781
その他費用	29,331
営業費用合計	4,536,291
営業利益又は営業損失（ ）	49,160,723
経常利益又は経常損失（ ）	49,160,723
中間純利益又は中間純損失（ ）	49,160,723
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（ ）	638,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	611,295,637
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,538,897
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	36,538,897
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,582,805
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,582,805
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	681,773,471

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第19期中間計算期間 ( 令和 1年 6月20日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,078,041,173口
2. 1単位当たり純資産の額	1.6324円
	(10,000口当たりの純資産額 16,324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19期中間計算期間 (令和 1年 6月20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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(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19期中間計算期間 (令和 1年 6月20日現在)
期首元本額	1,043,801,134円
期中追加設定元本額	59,116,020円
期中一部解約元本額	24,875,981円

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第19期中間計算期間  
(令和1年6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,876,497
コール・ローン	10,098,714
投資信託受益証券	2,649,011,275
流動資産合計	2,661,986,486
資産合計	2,661,986,486
負債の部	
流動負債	
未払金	470,000
未払解約金	1,660,731
未払受託者報酬	554,413
未払委託者報酬	6,237,118
未払利息	27
その他未払費用	41,735
流動負債合計	8,964,024
負債合計	8,964,024
純資産の部	
元本等	
元本	1,537,073,335
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,115,949,127
元本等合計	2,653,022,462
純資産合計	2,653,022,462
負債純資産合計	2,661,986,486



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	85,939,594
営業収益合計	85,939,594
営業費用	
支払利息	3,820
受託者報酬	554,413
委託者報酬	6,237,118
その他費用	43,881
営業費用合計	6,839,232
営業利益又は営業損失（ ）	79,100,362
経常利益又は経常損失（ ）	79,100,362
中間純利益又は中間純損失（ ）	79,100,362
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（ ）	2,440,258
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	993,093,043
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,183,545
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	90,183,545
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,987,565
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,987,565
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,115,949,127

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第19期中間計算期間 自 平成30年12月21日 至 令和 1年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第19期中間計算期間 ( 令和 1年 6月20日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,537,073,335口
2. 1単位当たり純資産の額	1.7260円
	(10,000口当たりの純資産額 17,260円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

項目	第19期中間計算期間 (令和1年6月20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19期中間計算期間 (令和1年6月20日現在)
期首元本額	1,475,126,579円
期中追加設定元本額	127,192,256円
期中一部解約元本額	65,245,500円

## (参考)

「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」および「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」投資信託受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

## 貸借対照表

(単位:円)

(令和1年6月19日現在)

## 資産の部

(令和 1年 6月19日現在)

流動資産	
金銭信託	1,490,131
コール・ローン	3,968,181
親投資信託受益証券	11,127,024,230
未収入金	1,220,000
流動資産合計	11,133,702,542
資産合計	11,133,702,542
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,659,999
未払受託者報酬	260,554
未払委託者報酬	227,975
未払利息	11
その他未払費用	35,650
流動負債合計	7,184,189
負債合計	7,184,189
純資産の部	
元本等	
元本	6,927,738,807
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,198,779,546
元本等合計	11,126,518,353
純資産合計	11,126,518,353
負債純資産合計	11,133,702,542

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年12月1日 至令和1年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 6月19日現在)
----	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数		6,927,738,807口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6061円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,061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	(令和 1年 6月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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	(令和 1年 6月19日現在)
期首元本額	9,088,389,450円
期中追加設定元本額	352,247,305円
期中一部解約元本額	2,512,897,948円

## (参考)

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

（単位：円）

（令和 1年 6月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	630,288,596
コール・ローン	1,678,442,233
株式	164,086,058,020
派生商品評価勘定	3,021,920
未収配当金	1,301,219,827
前払金	1,350,000
差入委託証拠金	54,840,000
流動資産合計	167,755,220,596
資産合計	167,755,220,596
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,611,680
未払金	42,960
未払解約金	106,591,287
未払利息	4,736
その他未払費用	41,895
流動負債合計	111,292,558
負債合計	111,292,558
純資産の部	
元本等	
元本	68,356,459,271
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,287,468,767
元本等合計	167,643,928,038
純資産合計	167,643,928,038
負債純資産合計	167,755,220,596

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年 6月19日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和1年6月19日現在)
1. 担保資産	<p>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。</p> <p style="text-align: right;">株式 2,708,800,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	68,356,459,271口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.4525円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 24,525円)</p>

## (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	(令和1年6月19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ぬ。

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）

（令和 1年 6月19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	3,440,369,760	-	3,438,780,000	1,589,760
	東証株価指数先物	3,440,369,760	-	3,438,780,000	1,589,760
	合計	3,440,369,760	-	3,438,780,000	1,589,760

（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。

（その他の注記）

（令和 1年 6月19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	66,912,228,971円
同期中における追加設定元本額	8,457,076,735円
同期中における一部解約元本額	7,012,846,435円
令和 1年 6月19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	10,260,091,590円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	890,506,936円



三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,151,865,591円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,955,211,641円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	76,433,487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)	7,178,506円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	24,861,471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)	64,453,708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)	107,420,668円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	67,025,139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)	151,779,673円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,863,857,148円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	9,826,373,099円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,020,948,833円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	969,690,562円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	924,668,356円
イオン・バランス戦略ファンド	15,759,205円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,652,903円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	25,327,036円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	27,838,129円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	92,482,624円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	54,763,080円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	85,729,347円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	10,157,529円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,537,012,938円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	25,283,533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〉	225,151,325円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,456,981,691円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,521,985,640円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,211,387,284円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	59,944,639円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	226,776,172円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	761,723円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	948,529,137円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	58,426,213円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	390,355,502円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,117,775,166円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	970,249,878円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,133,797,202円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,614,813円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	760,774,897円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	64,850,126円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	14,848,178円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	681,868,378円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	109,431,650円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,923,196円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	23,097,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	213,120,040円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	396,395,318円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	162,209,912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 >	119,755,379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 >	63,077,521円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,591,895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 >	78,132,755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 >	944,060,807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 )	202,635,435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 >	20,958,549円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	1,518,387,061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 >	216,497,008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 >	1,575,906,619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 >	133,073,322円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	13,522,662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 >	115,020,144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 5 < 適格機関投資家限定 >	55,004,075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 >	114,040,222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 >	130,167,356円
合計	68,356,459,271円

## S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

( 単位 : 円 )

( 令和 1年 6月19日現在 )

<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	3,270
コール・ローン	8,709
親投資信託受益証券	31,713,336,785
流動資産合計	31,713,348,764
<b>資産合計</b>	
31,713,348,764	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	4,011,121
未払委託者報酬	4,011,058
その他未払費用	486,000
流動負債合計	8,508,179
<b>負債合計</b>	
8,508,179	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	23,903,031,166
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	7,801,809,419
元本等合計	31,704,840,585
<b>純資産合計</b>	
31,704,840,585	
<b>負債純資産合計</b>	
31,713,348,764	

## 注記表

( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成30年 6月21日 至 令和 1年 6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（令和 1年 6月19日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		23,903,031,166口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3264円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,264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	（令和 1年 6月19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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（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	（令和 1年 6月19日現在）
期首元本額	24,238,325,216円
期中追加設定元本額	3,001,984,586円
期中一部解約元本額	3,337,278,636円

（参考）

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

#### 国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）	
（令和 1年 6月19日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	95,030,766
コール・ローン	253,064,473
国債証券	89,154,293,730
地方債証券	8,544,227,500
特殊債券	10,510,462,936
社債券	5,968,552,000
未収入金	102,652,000
未収利息	346,600,477
前払費用	8,691,808
流動資産合計	114,983,575,690
資産合計	114,983,575,690
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	32,956,615
未払利息	714
その他未払費用	12,400
流動負債合計	132,969,729

（令和 1年 6月19日現在）

負債合計	132,969,729
純資産の部	
元本等	
元本	80,153,346,623
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,697,259,338
元本等合計	114,850,605,961
純資産合計	114,850,605,961
負債純資産合計	114,983,575,690

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年6月21日 至 令和 1年6月19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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年 6月19日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		80,153,346,623口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4329円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,329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	（令和 1年 6月19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)

(令和1年6月19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	77,206,605,986円
同期中における追加設定元本額	14,402,048,345円
同期中における一部解約元本額	11,455,307,708円
令和1年6月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	51,349,573,702円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	6,483,362,845円
国内債券インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	188,135,119円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	22,132,274,957円
合計	80,153,346,623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)

## 貸借対照表

(単位:円)

(令和1年6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,434,341
コール・ローン	5,035,640

(令和 1年 6月20日現在)

親投資信託受益証券	6,116,122,652
未収入金	20,379,993
流動資産合計	6,142,972,626
資産合計	6,142,972,626
負債の部	
流動負債	
未払解約金	21,489,993
未払受託者報酬	206,805
未払委託者報酬	75,193
未払利息	13
その他未払費用	39,428
流動負債合計	21,811,432
負債合計	21,811,432
純資産の部	
元本等	
元本	2,210,274,677
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,910,886,517
元本等合計	6,121,161,194
純資産合計	6,121,161,194
負債純資産合計	6,142,972,626

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年12月1日 至令和1年6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 6月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,210,274,677口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7694円

(10,000口当たりの純資産額

27,694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	(令和 1年 6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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	(令和 1年 6月20日現在)
期首元本額	2,743,356,764円
期中追加設定元本額	99,981,017円
期中一部解約元本額	633,063,104円

## (参考)

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)は、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

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)

(令和 1年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	992,767,886
金銭信託	58,207,927
コール・ローン	204,354,574
株式	176,975,921,079
投資証券	4,670,559,864
派生商品評価勘定	28,984,484
未収入金	4,791,323
未収配当金	277,866,907
差入委託証拠金	727,611,657
流動資産合計	183,941,065,701
資産合計	183,941,065,701
負債の部	
流動負債	
前受金	27,996,484
未払金	11,875,558
未払解約金	283,924,700
未払利息	560
その他未払費用	6,887
流動負債合計	323,804,189
負債合計	323,804,189
純資産の部	
元本等	
元本	51,334,747,087
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	132,282,514,425
元本等合計	183,617,261,512
純資産合計	183,617,261,512
負債純資産合計	183,941,065,701

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年12月1日 至令和1年6月20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	(令和1年6月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	51,334,747,087口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.5769円
	(10,000口当たりの純資産額)	35,769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	(令和1年6月20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)

(令和 1年 6月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,923,203,083	-	1,951,199,567	27,996,484
	SPMINI 1909	1,388,511,706	-	1,407,050,777	18,539,071
	DJ EUR 1909	330,987,068	-	338,257,190	7,270,122
	FTSE 1909	119,448,504	-	120,177,948	729,444
	SPI200 1909	84,255,805	-	85,713,652	1,457,847
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	141,102,000	-	140,114,000	988,000
	米ドル	141,102,000	-	140,114,000	988,000
合計		2,064,305,083	-	2,091,313,567	28,984,484

(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。

(その他の注記)

(令和 1年 6月20日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,246,578,230円
同期中における追加設定元本額	9,337,066,090円
同期中における一部解約元本額	8,248,897,233円
令和 1年 6月20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	15,135,218,602円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	306,831,123円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,227,246,443円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	811,939,645円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	61,979,242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)	2,133,991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)	8,514,805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)	22,932,457円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,428,628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)	32,891,666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)	78,831,189円
外国株式指数ファンド	521,908,274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	3,648,768,198円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	619,147,653円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	582,687,088円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	556,229,553円
イオン・バランス戦略ファンド	41,660,009円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,181,333円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	17,429,244円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	19,043,116円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	63,481,043円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	37,567,016円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	58,909,941円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,146,506円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,709,894,784円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,704,546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>	76,749,837円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,573,560,420円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,489,192,188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 >	6,355,108,247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 >	20,213,639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 >	103,737,458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 >	392,744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 >	744,751,050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 >	60,411,931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 >	175,645,387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 >	775,699,406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 >	671,389,914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 >	1,587,244,181円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,104,987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）	320,126,412円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	512,827,074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 >	137,303,024円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	9,845,402円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	442,469,234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 >	24,179,963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 >	13,163,561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 >	6,722,410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 >	46,127,331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 >	114,562,699円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	112,721,861円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（標準型）V A < 適格機関投資家限定 >	1,041,951,498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 >	148,739,209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 >	6,115,998,283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 >	287,789,221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 >	2,350,166,831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 >	8,326,192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 >	73,048,442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 5 < 適格機関投資家限定 >	34,931,650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 >	72,681,418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 >	184,157,888円
合計	51,334,747,087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 >

#### 貸借対照表

（単位：円）

（令和1年6月20日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,210
コール・ローン	7,761
親投資信託受益証券	3,067,951,936
流動資産合計	3,067,961,907

（令和 1年 6月20日現在）

資産合計	3,067,961,907
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	10,910
未払委託者報酬	5,453
その他未払費用	1,362
流動負債合計	17,725
負債合計	17,725
純資産の部	
元本等	
元本	1,755,582,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,312,361,739
元本等合計	3,067,944,182
純資産合計	3,067,944,182
負債純資産合計	3,067,961,907

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年12月18日 至 令和 1年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年 6月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,755,582,443口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7475円
	(10,000口当たりの純資産額 17,475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	(令和 1年 6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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	(令和 1年 6月20日現在)
期首元本額	2,147,006,651円
期中追加設定元本額	1,011,186,468円
期中一部解約元本額	1,402,610,676円

## (参考)

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>は、「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	240,481,888
金銭信託	61,332,255
コール・ローン	215,323,366
国債証券	157,614,662,047
派生商品評価勘定	1,834,043
未収入金	700,075,379
未収利息	1,124,913,231
前払費用	37,832,309
流動資産合計	159,996,454,518
資産合計	
159,996,454,518	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	228,312
未払解約金	446,096,601
未払利息	590
その他未払費用	8,779
流動負債合計	446,334,282
負債合計	
446,334,282	
純資産の部	
元本等	
元本	90,383,691,016
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	69,166,429,220
元本等合計	159,550,120,236
純資産合計	
159,550,120,236	
負債純資産合計	
159,996,454,518	

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年12月18日 至 令和 1年 6月20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	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	(令和 1年 6月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		90,383,691,016口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7653円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,653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	(令和 1年 6月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## (令和 1年 6月20日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	316,080	-	315,981	99
	米ドル	27,023	-	26,870	153
	メキシコペソ	24,031	-	24,012	19
	ユーロ	159,641	-	159,422	219

英ポンド	105,385	-	105,677	292
売建	705,423,437	-	703,817,607	1,605,830
米ドル	321,089,740	-	319,307,427	1,782,313
カナダドル	17,132,539	-	17,198,776	66,237
メキシコペソ	12,588,989	-	12,596,890	7,901
ユーロ	293,013,620	-	292,989,679	23,941
英ポンド	43,598,390	-	43,752,173	153,783
オーストラリアドル	18,000,159	-	17,972,662	27,497
合計	705,739,517	-	704,133,588	1,605,731

## (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。

## (その他の注記)

(令和 1年 6月20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	96,220,120,290円
同期中における追加設定元本額	6,011,551,937円
同期中における一部解約元本額	11,847,981,211円
令和 1年 6月20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	11,383,076,749円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	612,610,519円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,634,359,336円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	816,386,594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)	96,403,853円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,821,430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)	30,706,397円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	84,107,085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)	118,661,350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)	61,343,329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)	135,624,326円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,709,536円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	267,586,326円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	272,144,368円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	150,817,932円
イオン・バランス戦略ファンド	118,341,280円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,959,206円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,083,014円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	43,791,796円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	85,269,491円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	31,984,177円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,271,325円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,283,383円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,737,920,997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>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,393,062,873円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,696,827,692円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,765,808,711円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,186,441円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	543,034円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	746,117,773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>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,266,599,602円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,557,680,756円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,026,320,137円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,536,313,341円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,255,372円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,077,978,932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)	424,688,754円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,026,316,890円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	183,551,837円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	80,292,551円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	887,746,476円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	152,344,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,608,212円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	143,958,264円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	551,131,326円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	171,602,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,401,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	52,035,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,651,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,344,717,506円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,153,877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 >	3,390,597,066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 >	1,521,840,655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 >	6,185,538,375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 >	693,320,307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 >	42,391,812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 >	48,317,584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 >	513,683,353円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 05 < 適格機関投資家限定 >	245,972,943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 >	507,974,141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 >	734,113,877円
合計	90,383,691,016円

## S M A M ・ マネーインカムファンド &lt; 適格機関投資家限定 &gt;

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和1年6月19日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	265
コール・ローン	705
親投資信託受益証券	696,803,886
流動資産合計	696,804,856
資産合計	696,804,856
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	692,281,800
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	4,523,056
元本等合計	696,804,856
純資産合計	696,804,856
負債純資産合計	696,804,856

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成31年 4月16日 至 令和 1年 6月19日
-----	--------------------------------

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和1年6月19日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	692,281,800口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0065円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,065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	(令和1年6月19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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (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	（令和 1年 6月19日現在）
期首元本額	702,357,104円
期中追加設定元本額	4,629,537円
期中一部解約元本額	14,704,841円

## （参考）

S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（令和 1年 6月19日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	176,953,661
コール・ローン	471,223,024
特殊債券	2,006,859,526
未収利息	7,013,137
前払費用	446,236
流動資産合計	2,662,495,584
資産合計	2,662,495,584
負債の部	
流動負債	
未払利息	1,329
その他未払費用	13,241
流動負債合計	14,570
負債合計	14,570
純資産の部	
元本等	
元本	2,636,057,935
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,423,079
元本等合計	2,662,481,014
純資産合計	2,662,481,014
負債純資産合計	2,662,495,584

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成31年4月16日 至 令和 1年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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	（令和 1年 6月19日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		2,636,057,935口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0100円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,100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	（令和 1年 6月19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（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)

(令和 1年 6月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,470,784,621円
同期中における追加設定元本額	337,992,365円
同期中における一部解約元本額	172,719,051円
令和 1年 6月19日現在における元本の内訳	
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)	196,380,309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)	90,956,520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)	70,654,522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)	14,758,087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)	19,078,253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)	9,825,713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)	21,684,834円
米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	689,904,838円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	498,583,702円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	1,023,834,645円
合計	2,636,057,935円



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

2019年7月31日現在

資産総額	476,272,819円
負債総額	2,503,331円
純資産総額( - )	473,769,488円
発行済口数	373,496,419口
1口当たり純資産額( / )	1.2685円
(1万口当たり純資産額)	(12,685円)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

2019年7月31日現在

資産総額	1,332,415,554円
負債総額	1,552,177円
純資産総額( - )	1,330,863,377円
発行済口数	880,109,939口
1口当たり純資産額( / )	1.5122円
(1万口当たり純資産額)	(15,122円)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

2019年7月31日現在

資産総額	1,781,703,200円
負債総額	2,780,053円
純資産総額( - )	1,778,923,147円
発行済口数	1,081,995,119口
1口当たり純資産額( / )	1.6441円
(1万口当たり純資産額)	(16,441円)

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

2019年7月31日現在

資産総額	2,702,212,558円
負債総額	7,457,545円

純資産総額（ - ）	2,694,755,013円
発行済口数	1,545,225,906口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7439円
（1万口当たり純資産額）	（17,439円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

##### イ 名義書換

該当事項はありません。

##### ロ 受益者名簿

作成しません。

##### ハ 受益者に対する特典

ありません。

##### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

###### （イ）受益権の譲渡

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

###### （ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

##### ホ 受益権の再分割

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

##### ヘ 償還金

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

##### ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2019年7月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

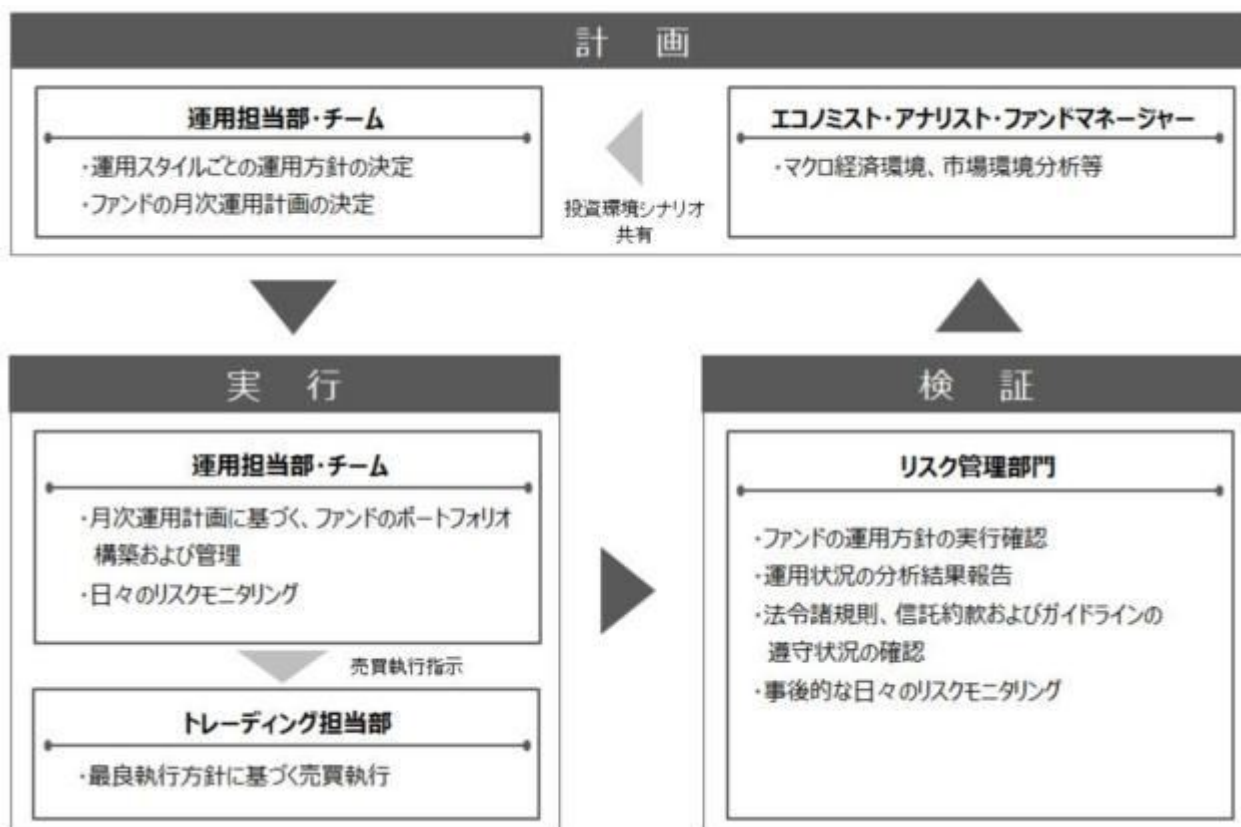
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7月31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	764	8,401,903
単体型株式投資信託	116	591,868
追加型公社債投資信託	1	28,636
単体型公社債投資信託	189	534,447
合計	1,070	9,556,856

## 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（平成30年4月1日から平成31年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		

有形固定資産	1		
建物		185,371	173,517
器具備品		300,694	751,471
有形固定資産合計		486,065	924,988
無形固定資産			
ソフトウェア		409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定		5,755	183,528
電話加入権		56	44
商標権		-	60
無形固定資産合計		415,576	663,501
投資その他の資産			
投資有価証券		10,616,594	10,829,628
関係会社株式		10,412,523	10,252,067
長期差入保証金		658,505	2,004,451
長期前払費用		69,423	97,107
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計		23,159,314	24,617,457
固定資産合計		24,060,956	26,205,946
資産合計		53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
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	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成29年4月1日	(自	平成30年4月1日
	至	平成30年3月31日)	至	平成31年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		36,538,981		39,156,499
運用受託報酬		8,362,118		6,277,217
投資助言報酬		1,440,233		1,332,888
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		-
サービス支援手数料		128,324		182,502
その他		55,820		49,507
営業収益計		46,530,479		46,998,614
営業費用				
支払手数料		16,961,384		18,499,433
広告宣伝費		353,971		361,696
公告費		1,140		125
調査費				
調査費		1,654,233		1,752,905
委託調査費		5,972,473		6,050,441
営業雑経費				
通信費		40,066		46,551
印刷費		339,048		338,465
協会費		-		24,700
諸会費		45,465		23,756
情報機器関連費		2,582,734		2,872,416
販売促進費		34,333		49,118
その他		136,669		148,307
営業費用合計		28,121,520		30,167,918
一般管理費				

給料		
役員報酬	196,529	190,951
給料・手当	6,190,716	6,308,066
賞与	601,375	514,259
賞与引当金繰入額	1,566,810	1,235,936
交際費	25,709	27,802
寄付金	-	82
事務委託費	256,413	286,905
旅費交通費	220,569	228,538
租税公課	282,036	285,369
不動産賃借料	654,286	612,410
退職給付費用	419,884	463,553
固定資産減価償却費	329,756	378,530
諸経費	285,490	290,243
一般管理費合計	11,029,580	10,822,651
営業利益	7,379,378	6,008,044

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	51,335	-
受取利息	520	623
時効成立分配金・償還金	2,622	72
原稿・講演料	894	1,951
雑収入	10,669	36,408
営業外収益合計	66,042	39,055
営業外費用		
為替差損	5,125	15,760
雑損失	913	7,027
営業外費用合計	6,038	22,787
経常利益	7,439,383	6,024,312
特別利益		
投資有価証券償還益	61,842	289,451
投資有価証券売却益	30,980	7,247
過去勤務費用償却益	1	79,850
特別利益合計	92,822	376,549
特別損失		
固定資産除却損	2	1,462
投資有価証券償還損		13,668
投資有価証券売却損		14,605
関係会社株式評価損	3	160,455
合併関連費用	4	187,140
特別損失合計	505,996	377,331
税引前当期純利益	7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税	2,350,891	1,750,031
法人税等調整額	280,166	90,084
法人税等合計	2,070,725	1,840,116
当期純利益	4,955,483	4,183,413

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074
当期変動額							
剰余金の配当							1,887,480
当期純利益							4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078

	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	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額					
剰余金の配当	1,887,480	1,887,480			1,887,480
当期純利益	4,955,483	4,955,483			4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（自 平成30年 4 月 1 日 至 平成31年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------



	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

## [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) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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)

時価のないもの

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

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28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、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 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。

## (2) 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。

## (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正(企業会計基準第28号平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、

繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

#### (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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

##### 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。

当事業年度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。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31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 Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

#### (損益計算書関係)

##### 1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

##### 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

##### 3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

##### 4 合併関連費用

合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用であります。

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30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	17,640株	-	-	17,640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
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000.00	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度になるもの  
平成30年6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

	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株	17,622,360株	-	17,640,000株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

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
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度になるもの  
令和1年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

## (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おります。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おります。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

## (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及び50%出資した関連会社の株式であり、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、子会社株式及び関連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、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。

### (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、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

## 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、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（平成30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	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

当事業年度（平成31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	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-

(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(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)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
其他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

其他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)其他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(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(平成30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	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度(平成31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	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握

することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成31年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度（平成30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	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(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	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成31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	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(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	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 平成29年4月1日 至 平成30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
532,099	30,980	9,634

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31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
728,127	7,247	14,605

## 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、有価証券について160,455千円（関係会社株式160,455千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

（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 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

## (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 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
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	3,319,830	3,418,601

## (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 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

(注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。

2.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 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
割引率	0.000%	0.000%

## 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147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

## (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 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798

		有価証券届出書（内国投資信託受益証券）
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額（注）	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

（注）評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損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 （平成30年3月31日）	当事業年度 （平成31年3月31日）
法定実効税率	30.8%	30.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

（セグメント情報等）

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(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

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

該当事項はありません。



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 平成30年4月1日 至 平成31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	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(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

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

該当事項はありません。

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 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

(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 平成30年4月1日 至 平成31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	2,499,836	未払 手数料	399,447
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	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(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 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15円

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

2. 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
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金額(千円)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

取得による企業結合

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

(3)企業結合日

平成31年4月1日

(4)企業結合の法的形式

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方式であります。

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1)合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当て交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

(3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

(参考)大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31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る監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14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

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄 裕 印  
業務執行社員

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（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31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すべ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。

## 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 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。

(注2) 四捨五入は監査の対象には含まれていません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	21,360,895	20,475,527

前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-

長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
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	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540
協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994

その他		122,930	63,596
営業費用計		17,381,079	16,727,567
一般管理費			
給料			
役員報酬		218,127	217,030
給料・手当		2,809,008	3,002,836
賞与		86,028	48,878
退職金		9,864	2,855
福利厚生費		647,269	638,399
交際費		29,121	38,883
旅費交通費		159,224	153,694
租税公課		199,255	160,817
不動産賃借料		622,807	639,392
退職給付費用		219,724	324,082
固定資産減価償却費		71,624	141,154
賞与引当金繰入額		1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額		36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額		85,500	72,900
諸経費		901,001	1,011,941
一般管理費計		7,357,787	7,562,768
営業利益		6,839,032	4,444,730
営業外収益			
受取配当金		23,350	35,946
受取利息		199	178
投資有価証券売却益		6,350	45,345
その他		2,831	10,431
営業外収益計		32,732	91,902
営業外費用			
投資有価証券売却損		5,000	4,735
解約違約金		-	982
為替差損		1,784	828
その他		0	410
営業外費用計		6,784	6,956
経常利益		6,864,980	4,529,676
特別損失			
合併関連費用	2	-	179,376
固定資産除却損		-	4,121
特別損失計		-	183,498
税引前当期純利益		6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税		2,242,775	1,339,010
法人税等調整額		78,014	73,635
法人税等合計		2,164,761	1,412,646
当期純利益		4,700,218	2,933,531

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30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	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	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	
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	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	
当期首残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605



当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650
-------	------------	------------	--------	--------	------------

## 注記事項

## (重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>				
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>2～30年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(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。</p>	建物	2～30年	器具備品	4～15年
建物	2～30年			
器具備品	4～15年			
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒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。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>				
<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> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>				

## (表示方法の変更)

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

（追加情報）

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

（貸借対照表関係）

第46期 (平成30年3月31日)		第47期 (平成31年3月31日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	465,964千円	建物	556,889千円
器具備品	266,621千円	器具備品	297,262千円
リース資産	8,719千円	リース資産	12,584千円

（損益計算書関係）

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末

普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

## (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・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

## 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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用(*)	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4) 未収入金	4,542	4,542	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2) 未払費用(*)	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

(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・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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。

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

(6) 長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

## 負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

区分	第46期(平成30年3月31日)	第47期(平成31年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期(平成31年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. 其他有価証券

第46期(平成30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
----	----------	------	----

貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 45,071千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

（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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965
繰延税金負債		
建物	-	54,715

その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

## 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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

## (セグメント情報等)

セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

## 2. 地域ごとの情報



## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## 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

該当事項はありません。

## 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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## 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

該当事項はありません。

## 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。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
----	--------	----	-------------	-------------------	-------------------	---------------	-------	------------------	----	------------------

その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

(注)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。

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
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(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

#### 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

- a. 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D S アセットマネジメント株式会社に変更しました。

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（2019年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2019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	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、2019年3月末現在。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### □ 販売会社

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

## 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

## 第3【その他】

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

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

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 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

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（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

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（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31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すべ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。

**強調事項**

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**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**

平成31年1月29日

三井住友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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成29年12月21日から平成30年12月20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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成30年12月20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すべ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。

**利害関係**

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

以上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成31年1月29日

三井住友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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020の平成29年12月21日から平成30年12月20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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020の平成30年12月20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すべ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。

**利害関係**

三井住友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. XBR 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**

平成31年1月29日

三井住友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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成29年12月21日から平成30年12月20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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成30年12月20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すべ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。

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成31年1月29日

三井住友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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040の平成29年12月21日から平成30年12月20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。

**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。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040の平成30年12月20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すべ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。

**利害関係**

三井住友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

令和1年7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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の令和1年6月20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（平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。



## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年7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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の令和1年6月20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（平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。



## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年7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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の令和1年6月20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（平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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. 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

令和1年7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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の令和1年6月20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（平成30年12月21日から令和1年6月20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。

### 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。

