

【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】	2020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 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC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DSアセットマネジメント株式会社は、やむを得
ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2020年9月18日から2021年3月18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。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

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
追加型	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

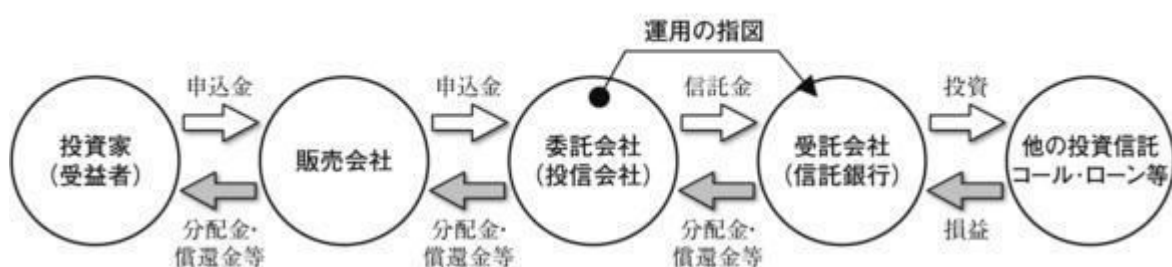
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行^{*}に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

^{*}株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社が合併して発足しました。

(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け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020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

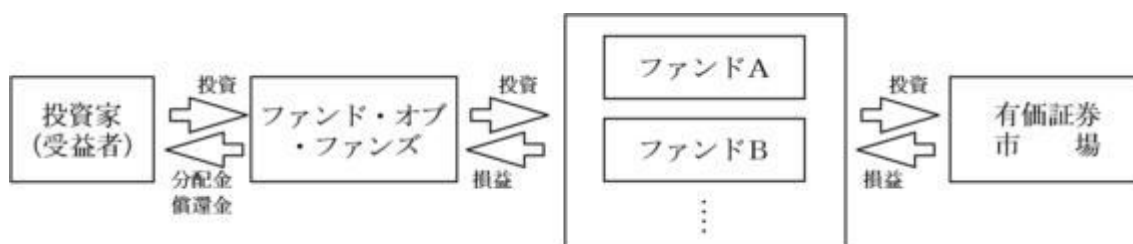
(2020年7月31日現在)

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〕



(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。

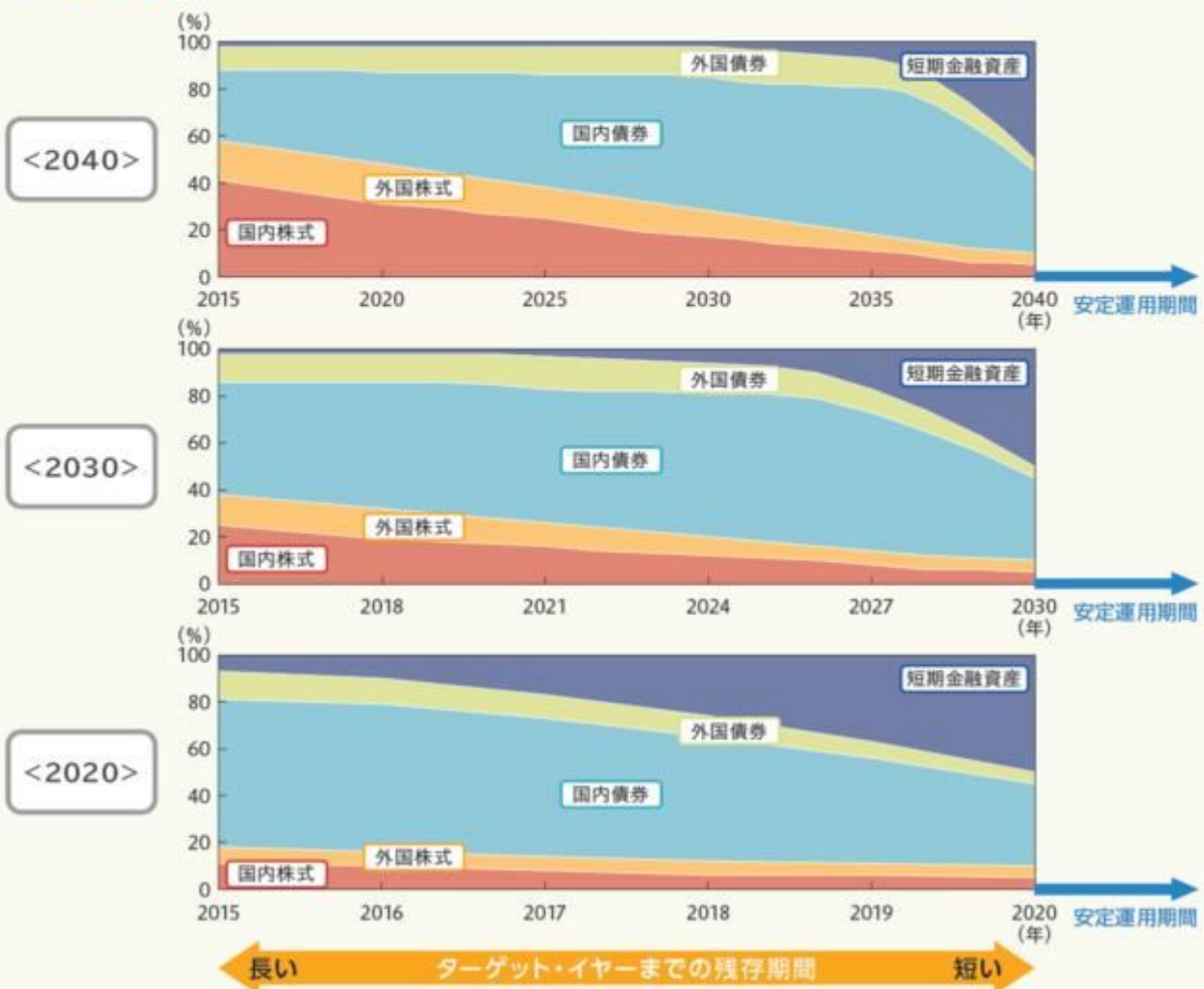
基本的な投資資産配分

▶基本アロケーション

■2020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	33%	18%	6%	5%
外国株式	17%	12%	5%	5%
国内債券	38%	56%	45%	35%
外国債券	10%	12%	7%	5%
短期金融資産	2%	2%	37%	50%

▶イメージ



長い ← ターゲット・イヤーまでの残存期間 → 短い

※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、実際に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 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。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

**最適化法とは**

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

層化抽出法とは

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

- ・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"> ●株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ●外貨建資産への投資は行いません。
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0.0825%(税抜き0.075%)
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<適格機関投資家限定>

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"> ● 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。 ● 外貨建資産への投資は行いません。
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0.055%(税抜き0.05%)
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"> ● 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ● 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
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0.0825%(税抜き0.075%)
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<適格機関投資家限定>

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"> ● 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。 ● 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
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0.066%(税抜き0.06%)
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<適格機関投資家限定>

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"> ● 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。 ● 外貨建資産への投資は行いません。 	
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

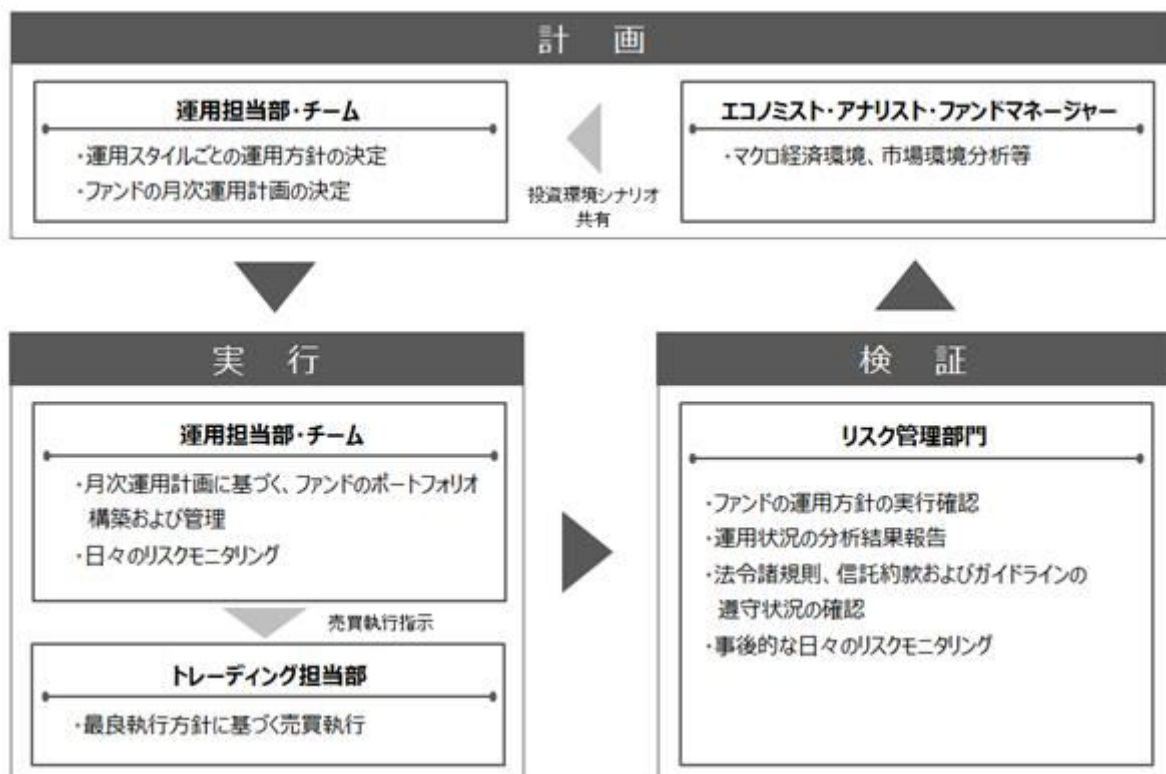
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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。

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

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。

八 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0.0825%（税抜き0.075%）
- 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。

八 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 純資産総額に対して年0.055% (税抜き0.05%)
- 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0.03%
- ニ 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)
- 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・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DS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・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、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

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

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

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

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、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。

MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)はMSCI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、MSCIインクが有しています。また、MSCIインクは「SMAM・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0.0825% (税抜き0.075%)
- 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、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

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0.066%（税抜き0.06%）

- 申込手数料 ありません。
 八 信託財産留保額 追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
 二 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

- 委託会社 三井住友D S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

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

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

（ヘ）市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、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。

□ 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：
2015年8月～2020年7月

分配金再投資基準価額：
2015年8月～2020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：
2015年8月～2020年7月

他の資産クラス：
2015年8月～2020年7月



■ <2020>

年間騰落率：
2015年8月～2020年7月

分配金再投資基準価額：
2015年8月～2020年7月



ファンド：
2015年8月～2020年7月

他の資産クラス：
2015年8月～2020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：
2015年8月～2020年7月

分配金再投資基準価額：
2015年8月～2020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：
2015年8月～2020年7月

他の資産クラス：
2015年8月～2020年7月



※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	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.539%（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0.44%（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。

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	ファンドの運用等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

投資対象とする投資信託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（2020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。

< 2 0 1 0 >	年0.5698%（税抜き0.518%）程度
< 2 0 2 0 >	年0.650705%（税抜き0.59155%）程度
< 2 0 3 0 >	年0.60643%（税抜き0.5513%）程度
< 2 0 4 0 >	年0.61171%（税抜き0.5561%）程度

(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0.0033%（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ます。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息等は、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ます。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、

その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

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せん。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つたりすることから、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。

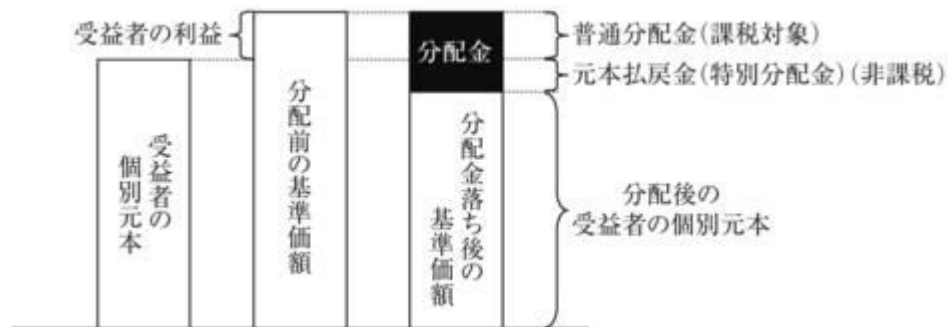
ハ 収益分配金の課税について

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、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2020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

2020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	444,108,367	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,351,402	0.53
合計(純資産総額)		446,459,769	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

2020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	1,198,950,514	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,590,409	0.30
合計(純資産総額)		1,202,540,923	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

2020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	1,799,648,123	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,089,923	0.50
合計(純資産総額)		1,808,738,046	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

2020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	2,767,370,793	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,268,482	0.30
合計(純資産総額)		2,775,639,275	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

2020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 ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	221,764,866	1.0061	223,137,812	1.0056	223,006,749	49.95
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 >	119,393,823	1.3152	157,029,143	1.3086	156,238,756	35.00
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 >	11,673,147	1.8002	21,014,909	1.8846	21,999,212	4.93
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)	7,330,783	2.8257	20,714,996	2.9352	21,517,314	4.82
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)	13,074,255	1.6814	21,983,175	1.6327	21,346,336	4.78

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

2020年7月31日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

投資信託受益証券	99.47
合計	99.47

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

2020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>	414,068,575	1.3153	544,645,100	1.3086	541,850,137	45.06
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>	441,850,516	1.0061	444,574,082	1.0056	444,324,878	36.95
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>	44,465,606	1.7992	80,004,830	1.8846	83,799,881	6.97
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）	42,867,620	1.7332	74,300,045	1.6327	69,989,963	5.82
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）	20,095,958	2.8747	57,770,011	2.9352	58,985,655	4.91

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

2020年 7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

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

2020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>	777,100,988	1.3151	1,022,009,804	1.3086	1,016,914,352	56.22
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）	194,824,243	1.733	337,633,725	1.6327	318,089,541	17.59
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>	115,157,180	1.7989	207,167,421	1.8846	217,025,221	12.00
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）	72,445,568	2.9311	212,351,500	2.9352	212,642,231	11.76
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>	34,781,999	1.0061	34,997,587	1.0056	34,976,778	1.93

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

2020年 7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

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

2020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>	812,416,437	1.3148	1,068,213,719	1.3086	1,063,128,149	38.30
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）	552,597,007	1.7594	972,245,805	1.6327	902,225,133	32.51
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）	159,224,512	2.948	469,403,096	2.9352	467,355,787	16.84
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>	148,168,117	1.7996	266,647,640	1.8846	279,237,633	10.06
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>	55,115,445	1.0061	55,457,105	1.0056	55,424,091	2.00

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

2020年 7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

【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
第19期 (2019年12月20日)	463,667,299	463,667,299	12,755	12,755
2019年 7月末日	473,769,488		12,685	
8月末日	471,096,840		12,684	
9月末日	471,916,492		12,714	

10月末日	467,581,846		12,729
11月末日	465,931,616		12,760
12月末日	463,328,411		12,766
2020年 1月末日	460,214,709		12,770
2月末日	452,699,897		12,697
3月末日	451,243,590		12,550
4月末日	447,001,080		12,608
5月末日	451,224,478		12,678
6月末日	446,997,275		12,671
7月末日	446,459,769		12,695

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
第19期 (2019年12月20日)	1,307,220,727	1,307,220,727	15,214	15,214
2019年 7月末日	1,330,863,377		15,122	
8月末日	1,322,941,786		15,147	
9月末日	1,323,931,968		15,175	
10月末日	1,326,038,852		15,187	
11月末日	1,305,161,802		15,230	
12月末日	1,274,371,251		15,228	
2020年 1月末日	1,260,558,024		15,237	
2月末日	1,266,268,484		15,147	
3月末日	1,231,057,847		14,931	
4月末日	1,236,150,841		15,003	
5月末日	1,235,456,647		15,097	
6月末日	1,222,642,925		15,081	
7月末日	1,202,540,923		15,112	

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
第19期 (2019年12月20日)	1,846,817,840	1,846,817,840	16,885	16,885
2019年 7月末日	1,778,923,147		16,441	
8月末日	1,773,488,650		16,301	
9月末日	1,799,099,152		16,556	
10月末日	1,822,292,089		16,701	
11月末日	1,839,606,364		16,850	
12月末日	1,851,209,130		16,924	
2020年 1月末日	1,848,348,474		16,886	
2月末日	1,809,027,925		16,582	
3月末日	1,718,900,711		16,048	
4月末日	1,746,544,888		16,240	
5月末日	1,786,699,680		16,567	
6月末日	1,794,044,968		16,548	
7月末日	1,808,738,046		16,619	

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

第19期	(2019年12月20日)	2,887,381,981	2,887,381,981	18,299	18,299
	2019年 7月末日	2,694,755,013		17,439	
	8月末日	2,659,286,973		17,061	
	9月末日	2,757,909,296		17,609	
	10月末日	2,821,633,193		17,925	
	11月末日	2,857,545,289		18,185	
	12月末日	2,890,209,023		18,345	
	2020年 1月末日	2,851,948,472		18,190	
	2月末日	2,747,503,975		17,608	
	3月末日	2,563,336,242		16,741	
	4月末日	2,604,818,193		17,044	
	5月末日	2,744,235,764		17,648	
	6月末日	2,745,166,772		17,609	
	7月末日	2,775,639,275		17,686	

【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
第19期	2018年12月21日～2019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
第19期	2018年12月21日～2019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
第19期	2018年12月21日～2019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
第19期	2018年12月21日～2019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	2.1
第20期（中間期）	0.6

（注）収益率は、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。

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	2.7
第20期（中間期）	0.8

（注）収益率は、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。

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	6.5

第20期(中間期)	1.7
-----------	-----

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

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	9.4
第20期(中間期)	3.1

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DC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	19,771,982	60,051,330
第20期(中間期)	17,330,398	28,083,657

(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	41,370,908	89,942,140
第20期（中間期）	32,626,618	75,357,995

（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	105,554,123	55,618,953
第20期（中間期）	57,878,357	67,716,794

（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	254,762,038	151,978,508
第20期(中間期)	139,177,828	161,113,041

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

参考情報

基準日:2020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
2019年12月	0円
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015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。

<2020>



決算期	分配金
2019年12月	0円
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015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。

<2030>



決算期	分配金
2019年12月	0円
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

■ <2040>



※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
2019年12月	0円
2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015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

■ <2010>

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	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.53
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>	49.95
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>	35.00
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>	4.93
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)	4.82
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)	4.78

※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。

■ <2020>

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	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.30
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>	45.06
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>	36.95
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>	6.97
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)	5.82
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)	4.91

■ <2030>

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	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.50
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>	56.22
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)	17.59
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>	12.00
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)	11.76
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>	1.93

■ <2040>

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	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.30
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>	38.30
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)	32.51
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)	16.84
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>	10.06
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>	2.00

※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) (2020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	3.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.44
日本	株式	ソニー	電気機器	2.33
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.51
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.44
日本	株式	任天堂	その他製品	1.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.24
日本	株式	第一三共	医薬品	1.23
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.09

■SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> (2020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345回利付国債(10年)	0.100	2026/12/20	1.34
日本	国債証券	第409回利付国債(2年)	0.100	2022/02/01	1.31
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	0.100	2029/12/20	1.20
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	0.100	2030/03/20	1.06
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	0.100	2028/12/20	1.05
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.98
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	0.100	2023/09/20	0.93
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	0.100	2029/06/20	0.92
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	0.100	2029/09/20	0.87
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	0.100	2024/09/20	0.87

※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・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) (2020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	99.89

「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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.08
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.57
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	3.13
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.12
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	0.94
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.87
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	0.79

■SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> (2020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 1.75	1.750	2024/06/30	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.47
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	3.500	2030/03/01	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/05/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.40

※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。

■SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> (2020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。

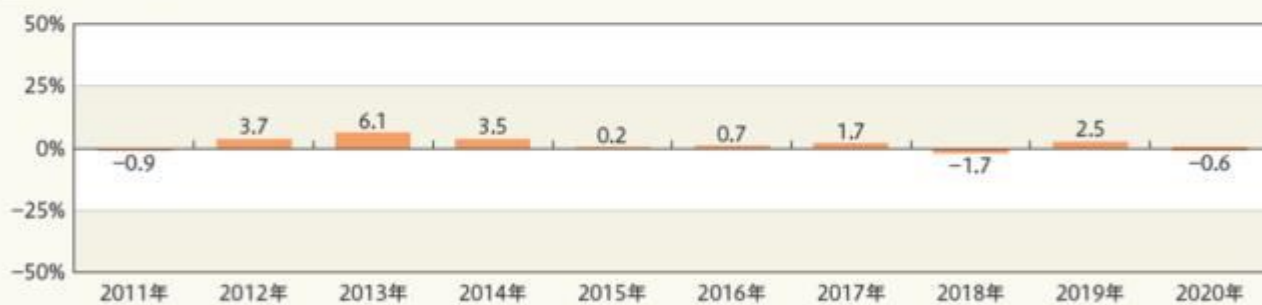
国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.100	2020/07/31	11.35
日本	特殊債券	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.000	2020/08/31	9.24
日本	特殊債券	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.900	2021/03/26	7.66
日本	特殊債券	第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2021/06/30	7.65
日本	特殊債券	第25回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.200	2021/06/14	7.65
日本	特殊債券	第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.100	2021/07/30	3.82
日本	特殊債券	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.800	2020/12/27	3.81
日本	特殊債券	第129回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2021/02/26	3.81
日本	特殊債券	第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2021/01/29	3.81
日本	特殊債券	第57回政府保証関西国際空港債券	1.200	2020/12/14	3.80

※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。

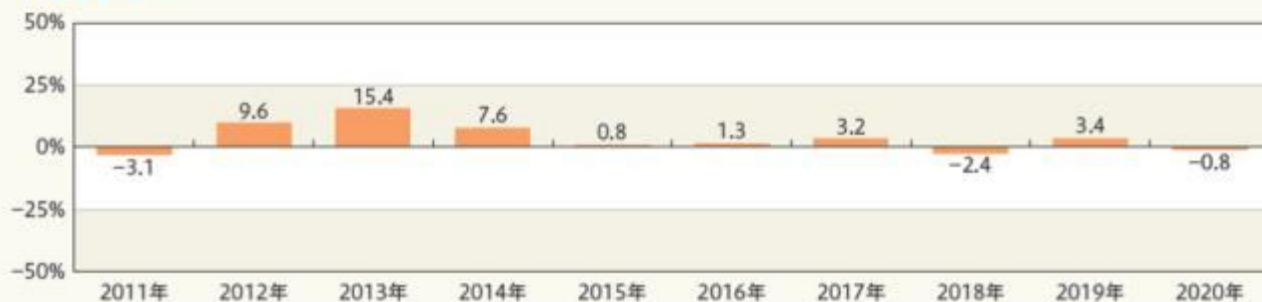
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■<2010>



■<2020>



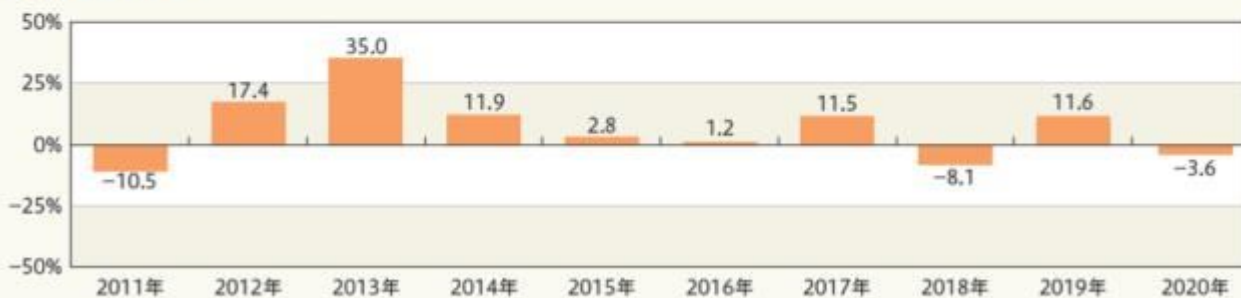
※2020年のファンドの収益率は、年初から2020年7月31日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

■ <2030>



■ <2040>



※2020年のファンドの収益率は、年初から2020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

ありません。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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（コールセンター：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。)

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

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

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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。

ハ 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け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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、)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、)に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 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19期(2018年12月21日から2019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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,122,396	-
コール・ローン	-	4,317,875
投資信託受益証券	503,348,203	460,917,661
未収入金	130,000	-
流動資産合計	506,600,599	465,235,536
資産合計		
	506,600,599	465,235,536
負債の部		
流動負債		
未払金	960,000	530,000
未払解約金	121,171	-
未払受託者報酬	110,506	103,063
未払委託者報酬	994,412	927,507
未払利息	-	9
その他未払費用	8,290	7,658
流動負債合計	2,194,379	1,568,237
負債合計		
	2,194,379	1,568,237
純資産の部		
元本等		
元本	403,800,377	363,521,029
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	100,605,843	100,146,270
元本等合計	504,406,220	463,667,299
純資産合計		
	504,406,220	463,667,299
負債純資産合計		
	506,600,599	465,235,536

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自	平成30年12月21日 至 令和 1年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,780,423		12,319,458
営業収益合計		4,780,423		12,319,458
営業費用				
支払利息		852		1,068
受託者報酬		222,294		210,711
委託者報酬		2,000,392		1,896,293
その他費用		17,340		16,389
営業費用合計		2,240,878		2,124,461
営業利益又は営業損失（ ）		7,021,301		10,194,997
経常利益又は経常損失（ ）		7,021,301		10,194,997
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,021,301		10,194,997
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（ ）		200,652		905,076
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		110,896,284		100,605,843
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,365,172		5,234,563
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		6,365,172		5,234,563
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,834,964		14,984,057
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,834,964		14,984,057
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（ ）		100,605,843		100,146,270

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第19期
	自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期	第19期
	(平成30年12月20日現在)	(令和 1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	403,800,377口	363,521,029口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.2755円 (10,000口当たりの純資産額 12,755円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第18期	第19期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自 平成30年12月21日 至 令和 1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（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>	<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（3,455,077円）、収益調整金（62,614,561円）、および分配準備積立金（34,076,632円）より、分配対象収益は100,146,270円（1万口当たり2,754.87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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

項目	第19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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19期 (令和 1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

第19期(自 平成30年12月21日 至 令和 1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	10,157,135円
合計	10,157,135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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期 （平成30年12月20日現在）	第19期 （令和 1年12月20日現在）
期首元本額	416,378,200円	403,800,377円
期中追加設定元本額	24,358,795円	19,771,982円
期中一部解約元本額	36,936,618円	60,051,330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）	12,589,929	22,830,577	
	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）	7,346,806	22,503,266	
	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＞	12,577,246	22,606,341	
	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＞	122,809,487	161,555,880	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	229,995,625	231,421,597	
合計		385,319,093	460,917,661	

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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	6,766,487	-
コール・ローン	-	12,580,106
投資信託受益証券	1,342,919,968	1,300,260,013
未収入金	-	2,000,000
流動資産合計	1,349,686,455	1,314,840,119
資産合計	1,349,686,455	1,314,840,119
負債の部		
流動負債		
未払金	1,660,000	4,040,000
未払解約金	-	20,802
未払受託者報酬	296,238	288,733
未払委託者報酬	3,332,612	3,248,235
未払利息	-	27
その他未払費用	22,261	21,595
流動負債合計	5,311,111	7,619,392
負債合計	5,311,111	7,619,392
純資産の部		
元本等		
元本	907,805,185	859,233,953
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	436,570,159	447,986,774
元本等合計	1,344,375,344	1,307,220,727
純資産合計	1,344,375,344	1,307,220,727
負債純資産合計	1,349,686,455	1,314,840,119

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期		第19期	
	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自	平成30年12月21日 至 令和1年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		17,544,388		42,870,045
営業収益合計		17,544,388		42,870,045
営業費用				
支払利息		1,946		2,544
受託者報酬		595,199		575,842
委託者報酬		6,695,885		6,478,166
その他費用		46,010		44,419
営業費用合計		7,339,040		7,100,971
営業利益又は営業損失()		24,883,428		35,769,074
経常利益又は経常損失()		24,883,428		35,769,074
当期純利益又は当期純損失()		24,883,428		35,769,074
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()		813,045		1,995,759
期首剰余金又は期首欠損金()		474,082,179		436,570,159
剰余金増加額又は欠損金減少額		26,481,720		20,934,815
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		26,481,720		20,934,815
剰余金減少額又は欠損金増加額		39,923,357		43,291,515
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		39,923,357		43,291,515
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()		436,570,159		447,986,774

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第19期
	自平成30年12月21日 至令和1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18期	第19期
	(平成30年12月20日現在)	(令和1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	907,805,185口	859,233,953口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.5214円 (10,000口当たりの純資産額 15,214円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自平成29年12月21日 至平成30年12月20日	自平成30年12月21日 至令和1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(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>	<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(12,035,562円)、収益調整金(328,091,808円)、および分配準備積立金(175,153,678円)より、分配対象収益は515,281,048円(1万口当たり5,996.97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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

項 目	第19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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19期 (令和 1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

第19期(自 平成30年12月21日 至 令和 1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	38,971,317円
合計	38,971,317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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和 1年12月20日現在)
期首元本額	933,173,385円	907,805,185円
期中追加設定元本額	53,255,891円	41,370,908円
期中一部解約元本額	78,624,091円	89,942,140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）	42,978,886	77,937,911	
	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）	25,258,811	77,367,738	
	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＞	63,914,530	114,879,976	
	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＞	525,736,986	691,607,005	
	S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	336,381,816	338,467,383	
合計		994,271,029	1,300,260,013	

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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,964,494	-
コール・ローン	-	16,987,324
投資信託受益証券	1,653,876,452	1,836,895,486
流動資産合計	1,663,840,946	1,853,882,810
資産合計	1,663,840,946	1,853,882,810
負債の部		
流動負債		
未払金	3,860,000	2,210,000
未払解約金	357,420	20,697
未払受託者報酬	367,278	392,244
未払委託者報酬	4,131,826	4,412,639
未払利息	-	37
その他未払費用	27,651	29,353
流動負債合計	8,744,175	7,064,970
負債合計	8,744,175	7,064,970
純資産の部		
元本等		
元本	1,043,801,134	1,093,736,304
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	611,295,637	753,081,536
元本等合計	1,655,096,771	1,846,817,840
純資産合計	1,655,096,771	1,846,817,840
負債純資産合計	1,663,840,946	1,853,882,810

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期		第19期	
	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自	平成30年12月21日 至 令和1年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		58,671,730		119,799,034
営業収益合計		58,671,730		119,799,034
営業費用				
支払利息		2,426		4,683
受託者報酬		727,024		759,964
委託者報酬		8,178,936		8,549,420
その他費用		56,917		59,306
営業費用合計		8,965,303		9,373,373
営業利益又は営業損失()		67,637,033		110,425,661
経常利益又は経常損失()		67,637,033		110,425,661
当期純利益又は当期純損失()		67,637,033		110,425,661
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()		1,272,885		2,636,957
期首剰余金又は期首欠損金()		665,905,591		611,295,637
剰余金増加額又は欠損金減少額		69,700,159		66,674,529
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		69,700,159		66,674,529
剰余金減少額又は欠損金増加額		57,945,965		32,677,334
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		57,945,965		32,677,334
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()		611,295,637		753,081,536

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第19期
	自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期	第19期
	(平成30年12月20日現在)	(令和 1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	1,043,801,134口	1,093,736,304口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.6885円 (10,000口当たりの純資産額 16,885円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第18期	第19期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自 平成30年12月21日 至 令和 1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（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>	<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（44,775,271円）、収益調整金（660,846,784円）、および分配準備積立金（234,467,931円）より、分配対象収益は940,089,986円（1万口当たり8,595.20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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

項 目	第19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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19期 (令和 1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

第19期(自 平成30年12月21日 至 令和 1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	110,101,368円
合計	110,101,368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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期 （平成30年12月20日現在）	第19期 （令和 1年12月20日現在）
期首元本額	1,022,593,212円	1,043,801,134円
期中追加設定元本額	110,295,872円	105,554,123円
期中一部解約元本額	89,087,950円	55,618,953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）	194,480,792	352,671,468	
	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）	78,448,082	240,286,475	
	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＞	121,819,889	218,959,068	
	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＞	752,018,768	989,280,689	
	S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	35,477,824	35,697,786	
合計		1,182,245,355	1,836,895,486	

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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18,681,111	-
コール・ローン	-	17,192,875
投資信託受益証券	2,467,441,681	2,876,060,613
未収入金	-	8,000,000
流動資産合計	2,486,122,792	2,901,253,488
資産合計	2,486,122,792	2,901,253,488
負債の部		
流動負債		
未払金	10,000,000	-
未払解約金	1,164,392	6,472,290
未払受託者報酬	546,738	600,347
未払委託者報酬	6,150,716	6,753,872
未払利息	-	37
その他未払費用	41,324	44,961
流動負債合計	17,903,170	13,871,507
負債合計	17,903,170	13,871,507
純資産の部		
元本等		
元本	1,475,126,579	1,577,910,109
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	993,093,043	1,309,471,872
元本等合計	2,468,219,622	2,887,381,981
純資産合計	2,468,219,622	2,887,381,981
負債純資産合計	2,486,122,792	2,901,253,488

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自	平成30年12月21日 至 令和 1年12月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		147,241,048		256,838,932
営業収益合計		147,241,048		256,838,932
営業費用				
支払利息		6,264		7,739
受託者報酬		1,071,376		1,154,760
委託者報酬		12,052,809		12,990,990
その他費用		84,540		90,265
営業費用合計		13,214,989		14,243,754
営業利益又は営業損失（ ）		160,456,037		242,595,178
経常利益又は経常損失（ ）		160,456,037		242,595,178
当期純利益又は当期純損失（ ）		160,456,037		242,595,178
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（ ）		3,113,129		9,963,703
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,064,708,306		993,093,043
剰余金増加額又は欠損金減少額		219,875,835		186,632,582
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		219,875,835		186,632,582
剰余金減少額又は欠損金増加額		134,148,190		102,885,228
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		134,148,190		102,885,228
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（ ）		993,093,043		1,309,471,872

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第19期
	自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期	第19期
	(平成30年12月20日現在)	(令和 1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	1,475,126,579口	1,577,910,109口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.8299円 (10,000口当たりの純資産額 18,299円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第18期	第19期
	自 平成29年12月21日 至 平成30年12月20日	自 平成30年12月21日 至 令和 1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（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（90,075,762円）、収益調整金（1,226,084,898円）、および分配準備積立金（313,179,291円）より、分配対象収益は1,629,339,951円（1万口当たり10,325.91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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

項目	第19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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19期 (令和 1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

第19期（自 平成30年12月21日 至 令和 1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	237,811,805円
合計	237,811,805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19期 自 平成30年12月21日 至 令和 1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18期 (平成30年12月20日現在)	第19期 (令和 1年12月20日現在)
期首元本額	1,357,113,281円	1,475,126,579円
期中追加設定元本額	289,306,770円	254,762,038円
期中一部解約元本額	171,293,472円	151,978,508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）	558,740,711	1,013,220,405	
	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）	160,416,938	491,357,081	
	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＞	158,914,485	285,632,895	
	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＞	782,913,465	1,029,922,663	
	S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	55,582,955	55,927,569	
合計		1,716,568,554	2,876,060,613	

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30年12月19日現在）	（令和1年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	19,263	-
コール・ローン	-	20,002
親投資信託受益証券	14,160,815,080	10,356,446,813
未収入金	-	44,900,000
流動資産合計	14,160,834,343	10,401,366,815
資産合計	14,160,834,343	10,401,366,815
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	44,900,000
未払受託者報酬	332,470	212,337
未払委託者報酬	290,903	185,792
その他未払費用	33,873	30,872
流動負債合計	657,246	45,329,001
負債合計	657,246	45,329,001
純資産の部		
元本等		
元本	8,929,006,061	5,710,742,431
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,231,171,036	4,645,295,383
元本等合計	14,160,177,097	10,356,037,814
純資産合計	14,160,177,097	10,356,037,814
負債純資産合計	14,160,834,343	10,401,366,815

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 令和 1年12月 3日 至 令和 1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30年12月19日現在)	(令和1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	8,929,006,061口	5,710,742,431口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.8134円 (10,000口当たりの純資産額 18,134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 令和1年12月3日 至 令和1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</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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
期首元本額	9,088,389,450円	5,817,374,884円
期中追加設定元本額	28,370,757円	151,212円
期中一部解約元本額	187,754,146円	106,783,665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）	3,738,519,534	10,356,446,813	
合計		3,738,519,534	10,356,446,813	

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30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,062,350,265	-
コール・ローン	-	3,214,248,657
株式	159,635,332,250	172,541,837,010
派生商品評価勘定	-	26,529,500
未収入金	-	136,152,400
未収配当金	22,968,850	21,938,250
前払金	69,820,000	-
差入委託証拠金	-	2,915,000
流動資産合計	162,790,471,365	175,943,620,817
資産合計	162,790,471,365	175,943,620,817
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	70,027,360	368,800
前受金	-	26,340,000
未払金	11,893,640	-
未払解約金	22,692,957	421,919,286
未払利息	-	8,496
その他未払費用	73,005	-
流動負債合計	104,686,962	448,636,582
負債合計	104,686,962	448,636,582
純資産の部		
元本等		
元本	67,208,910,457	63,350,457,897
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	95,476,873,946	112,144,526,338
元本等合計	162,685,784,403	175,494,984,235
純資産合計	162,685,784,403	175,494,984,235
負債純資産合計	162,790,471,365	175,943,620,817

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年12月 3日 至 令和 1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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年12月19日現在）		（令和 1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	2,704,800,000円	株式	3,132,400,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		67,208,910,457口		63,350,457,897口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.4206円	1口当たり純資産額	2.7702円
	(10,000口当たりの純資産額)	24,206円)	(10,000口当たりの純資産額)	27,702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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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

(令和 1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	2,800,259,300	-	2,826,420,000	26,160,700
	東証株価指数先物	2,800,259,300	-	2,826,420,000	26,160,700
合計		2,800,259,300	-	2,826,420,000	26,160,700

(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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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（T O P I X）	1,956,213,611円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	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
SMAM・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
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	3,486,172,970円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	2,450,832,018円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	9,016,678,236円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	57,327,222円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	978,965,161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 >	55,007,822円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	384,921,677円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	3,098,232,570円
SMAM・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
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	64,109,227円
SMAM・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

(令和 1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	63,743,430,458円
同期中における追加設定元本額	400,605,729円
同期中における一部解約元本額	793,578,290円
令和 1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	9,987,910,146円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	867,876,444円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,120,618,736円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,972,556,627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）	169,981,586円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	6,734,032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）	23,959,981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）	65,633,993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）	108,390,766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）	71,148,493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）	156,474,116円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,429,804,672円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	11,620,947,792円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	728,062,661円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	735,950,619円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	571,839,277円
イオン・バランス戦略ファンド	130,432,540円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	11,752,070円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	57,402,928円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	51,180,598円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	148,540,661円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	78,936,142円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	97,264,375円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,308,796円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	407,153円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	74,615円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	133,881円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	195,612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）	3,738,519,534円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	24,292,053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＞	209,321,405円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,898,108,625円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,295,104,888円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,349,775,245円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	55,996,005円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	209,127,368円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	794,882円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	875,101,499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＞	55,058,558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 >	363,346,655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 >	1,058,492,761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 >	854,157,805円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,737,136,397円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,137,750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 >	58,214,802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 >	69,770,142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 >	44,386,681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 >	21,663,542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 >	177,569,258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 >	341,850,831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 >	180,403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 >	106,043,934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 >	58,092,653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 >	9,215,706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 >	69,696,887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 >	833,794,381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)	194,289,486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 >	19,380,760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 >	1,135,786,746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 >	183,720,852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 >	1,504,949,363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 >	109,048,838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 >	17,400,799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 >	91,893,010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 >	58,946,979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 >	291,571,102円
合計	63,350,457,897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	3,600	2,838.00	10,216,800	
日本水産	95,800	637.00	61,024,600	
マルハニチロ	13,800	2,766.00	38,170,800	
カネコ種苗	4,300	1,490.00	6,407,000	
サカタのタネ	10,900	3,670.00	40,003,000	
ホクト	7,200	1,994.00	14,356,800	
日鉄鉱業	2,500	5,000.00	12,500,000	

三井松島ホールディングス	3,300	1,215.00	4,009,500
国際石油開発帝石	384,900	1,150.50	442,827,450
石油資源開発	12,400	3,080.00	38,192,000
K & O エナジーグループ	5,300	1,656.00	8,776,800
ヒノキヤグループ	3,200	2,295.00	7,344,000
ショーボンドホールディングス	13,500	4,570.00	61,695,000
ミライト・ホールディングス	27,600	1,671.00	46,119,600
タマホーム	5,500	1,682.00	9,251,000
スペースバリューホールディングス	13,800	522.00	7,203,600
安藤・間	57,300	950.00	54,435,000
東急建設	28,000	776.00	21,728,000
コムシスホールディングス	33,800	3,125.00	105,625,000
ミサワホーム	8,500	1,211.00	10,293,500
ピーアールホールディングス	13,000	490.00	6,370,000
高松コンストラクショングループ	6,000	2,838.00	17,028,000
東建コーポレーション	2,800	7,420.00	20,776,000
大成建設	73,400	4,460.00	327,364,000
大林組	220,700	1,236.00	272,785,200
清水建設	223,800	1,125.00	251,775,000
飛鳥建設	8,000	1,508.00	12,064,000
長谷工コーポレーション	84,400	1,480.00	124,912,000
松井建設	11,200	805.00	9,016,000
銭高組	1,300	3,955.00	5,141,500
鹿島建設	172,200	1,476.00	254,167,200
不動テトラ	7,000	1,644.00	11,508,000
大末建設	5,400	980.00	5,292,000
鉄建建設	5,100	2,883.00	14,703,300
西松建設	17,700	2,464.00	43,612,800
三井住友建設	56,000	642.00	35,952,000
大豊建設	5,100	2,938.00	14,983,800
前田建設工業	56,700	1,068.00	60,555,600
奥村組	12,600	3,000.00	37,800,000
東鉄工業	9,000	3,240.00	29,160,000
浅沼組	3,000	4,645.00	13,935,000
戸田建設	92,700	730.00	67,671,000
熊谷組	10,300	3,315.00	34,144,500
北野建設	2,000	2,629.00	5,258,000
矢作建設工業	12,100	831.00	10,055,100
ピーエス三菱	10,600	726.00	7,695,600
日本ハウスホールディングス	20,000	513.00	10,260,000
大東建託	26,500	13,880.00	367,820,000
新日本建設	10,400	972.00	10,108,800

NIPPON	17,700	2,383.00	42,179,100
東亜道路工業	1,800	3,615.00	6,507,000
前田道路	23,200	2,684.00	62,268,800
日本道路	2,300	6,860.00	15,778,000
東亜建設工業	8,300	1,648.00	13,678,400
日本国土開発	15,000	644.00	9,660,000
若築建設	5,300	1,747.00	9,259,100
東洋建設	26,100	531.00	13,859,100
五洋建設	89,300	682.00	60,902,600
世紀東急工業	13,300	895.00	11,903,500
福田組	2,800	5,150.00	14,420,000
住友林業	55,300	1,595.00	88,203,500
日本基礎技術	12,200	408.00	4,977,600
巴コーポレーション	14,400	473.00	6,811,200
大和ハウス工業	218,400	3,401.00	742,778,400
ライト工業	12,600	1,577.00	19,870,200
積水ハウス	241,500	2,377.50	574,166,250
ユアテック	13,800	708.00	9,770,400
中電工	8,200	2,590.00	21,238,000
関電工	29,200	1,077.00	31,448,400
きんでん	51,800	1,725.00	89,355,000
東京エネシス	9,400	918.00	8,629,200
トーエネック	2,900	3,870.00	11,223,000
住友電設	6,300	2,843.00	17,910,900
日本電設工業	11,200	2,294.00	25,692,800
協和エクシオ	33,300	2,774.00	92,374,200
新日本空調	6,100	2,214.00	13,505,400
九電工	15,500	3,300.00	51,150,000
三機工業	15,700	1,552.00	24,366,400
日揮ホールディングス	68,600	1,780.00	122,108,000
中外炉工業	3,200	1,856.00	5,939,200
ヤマト	9,400	768.00	7,219,200
太平電業	5,700	2,350.00	13,395,000
高砂熱学工業	18,600	1,981.00	36,846,600
朝日工業社	2,100	3,440.00	7,224,000
明星工業	14,700	983.00	14,450,100
大気社	10,700	4,050.00	43,335,000
ダイダン	5,500	2,813.00	15,471,500
日比谷総合設備	7,400	1,993.00	14,748,200
東芝プラントシステム	17,000	2,666.00	45,322,000
OSJBホールディングス	41,700	269.00	11,217,300
レイズネクスト	12,600	1,368.00	17,236,800

日本製粉	20,200	1,711.00	34,562,200
日清製粉グループ本社	79,400	1,972.00	156,576,800
昭和産業	6,100	3,155.00	19,245,500
鳥越製粉	8,500	906.00	7,701,000
中部飼料	8,900	1,635.00	14,551,500
フィード・ワン	53,400	184.00	9,825,600
日本甜菜製糖	4,700	2,042.00	9,597,400
三井製糖	5,900	2,314.00	13,652,600
日新製糖	3,400	2,030.00	6,902,000
森永製菓	16,500	5,450.00	89,925,000
中村屋	2,500	4,420.00	11,050,000
江崎グリコ	21,000	5,050.00	106,050,000
名糖産業	4,900	1,322.00	6,477,800
井村屋グループ	3,800	2,001.00	7,603,800
不二家	4,300	2,183.00	9,386,900
山崎製パン	53,300	1,962.00	104,574,600
モロゾフ	1,700	5,030.00	8,551,000
亀田製菓	4,000	4,885.00	19,540,000
寿スピリッツ	6,700	7,720.00	51,724,000
カルビー	32,200	3,630.00	116,886,000
森永乳業	13,300	4,375.00	58,187,500
六甲バター	5,300	1,798.00	9,529,400
ヤクルト本社	48,500	6,010.00	291,485,000
明治ホールディングス	46,500	7,440.00	345,960,000
雪印メグミルク	17,100	2,514.00	42,989,400
プリマハム	10,700	2,588.00	27,691,600
日本ハム	26,900	4,580.00	123,202,000
丸大食品	7,000	2,335.00	16,345,000
S Foods	5,400	2,802.00	15,130,800
伊藤ハム米久ホールディングス	45,300	724.00	32,797,200
サッポロホールディングス	24,400	2,739.00	66,831,600
アサヒグループホールディングス	148,000	5,142.00	761,016,000
キリンホールディングス	299,600	2,476.00	741,809,600
宝ホールディングス	53,700	1,013.00	54,398,100
オエノンホールディングス	22,200	399.00	8,857,800
養命酒製造	3,500	1,968.00	6,888,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	49,800	2,802.00	139,539,600
サントリー食品インターナショナル	47,000	4,645.00	218,315,000
ダイトーグループホールディングス	3,500	4,560.00	15,960,000
伊藤園	21,300	5,510.00	117,363,000
キーコーヒー	6,700	2,313.00	15,497,100
日清オイリオグループ	8,800	3,870.00	34,056,000

不二製油グループ本社	17,300	2,999.00	51,882,700
かどや製油	1,300	3,740.00	4,862,000
J・オイルミルズ	3,600	4,395.00	15,822,000
キッコーマン	50,600	5,450.00	275,770,000
味の素	157,200	1,818.00	285,789,600
キューピー	39,400	2,462.00	97,002,800
ハウス食品グループ本社	26,300	3,795.00	99,808,500
カゴメ	27,100	2,642.00	71,598,200
焼津水産化学工業	5,700	1,044.00	5,950,800
アリアケジャパン	6,400	7,690.00	49,216,000
ニチレイ	33,600	2,511.00	84,369,600
東洋水産	36,100	4,690.00	169,309,000
イトアンド	3,700	1,785.00	6,604,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,400	1,127.00	4,958,800
日清食品ホールディングス	29,900	8,170.00	244,283,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,154.00	9,046,800
一正蒲鉾	4,300	1,045.00	4,493,500
フジッコ	7,600	1,964.00	14,926,400
ロック・フィールド	7,800	1,552.00	12,105,600
日本たばこ産業	407,700	2,525.50	1,029,646,350
ケンコーマヨネーズ	4,400	2,526.00	11,114,400
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,736.00	8,853,600
なとり	5,400	1,707.00	9,217,800
ピクルスコーポレーション	2,000	2,888.00	5,776,000
北の達人コーポレーション	23,600	684.00	16,142,400
ユーグレナ	29,100	793.00	23,076,300
ミヨシ油脂	4,300	1,304.00	5,607,200
理研ビタミン	3,000	4,015.00	12,045,000
片倉工業	11,100	1,387.00	15,395,700
ゲンゼ	5,100	4,945.00	25,219,500
東洋紡	28,200	1,626.00	45,853,200
ユニチカ	23,700	393.00	9,314,100
富士紡ホールディングス	3,900	3,495.00	13,630,500
倉敷紡績	7,100	2,605.00	18,495,500
日本毛織	22,500	1,149.00	25,852,500
ガイドーリミテッド	15,000	279.00	4,185,000
帝国繊維	8,300	2,170.00	18,011,000
帝人	55,300	2,096.00	115,908,800
東レ	500,400	754.80	377,701,920
住江織物	2,600	2,892.00	7,519,200
アツギ	9,600	863.00	8,284,800
ダイニック	6,400	804.00	5,145,600

セーレン	16,900	1,578.00	26,668,200
小松マテーレ	12,800	823.00	10,534,400
ワコールホールディングス	18,200	2,961.00	53,890,200
ホギメディカル	8,000	3,665.00	29,320,000
レナウン	35,000	115.00	4,025,000
T S I ホールディングス	24,500	555.00	13,597,500
マツオカコーポレーション	2,800	2,465.00	6,902,000
ワールド	10,000	2,837.00	28,370,000
三陽商会	5,100	1,390.00	7,089,000
オンワードホールディングス	41,700	660.00	27,522,000
ゴールドウイン	12,600	7,870.00	99,162,000
デサント	13,900	2,041.00	28,369,900
特種東海製紙	4,400	4,065.00	17,886,000
王子ホールディングス	285,300	609.00	173,747,700
日本製紙	30,700	1,859.00	57,071,300
三菱製紙	11,700	495.00	5,791,500
北越コーポレーション	45,700	563.00	25,729,100
中越パルプ工業	4,300	1,673.00	7,193,900
大王製紙	29,400	1,496.00	43,982,400
レンゴー	65,300	826.00	53,937,800
トーモク	5,100	1,847.00	9,419,700
ザ・パック	5,000	4,020.00	20,100,000
クラレ	108,000	1,362.00	147,096,000
旭化成	459,400	1,266.50	581,830,100
昭和電工	48,700	2,940.00	143,178,000
住友化学	507,300	510.00	258,723,000
住友精化	3,300	3,665.00	12,094,500
日産化学	38,500	4,775.00	183,837,500
ラサ工業	3,300	1,596.00	5,266,800
クレハ	5,800	6,640.00	38,512,000
多木化学	2,300	4,505.00	10,361,500
テイカ	5,200	1,972.00	10,254,400
石原産業	12,900	1,086.00	14,009,400
日本曹達	10,200	3,025.00	30,855,000
東ソー	105,200	1,723.00	181,259,600
トクヤマ	19,900	2,940.00	58,506,000
セントラル硝子	14,500	2,688.00	38,976,000
東亜合成	43,600	1,333.00	58,118,800
大阪ソーダ	6,900	3,205.00	22,114,500
関東電化工業	16,800	1,007.00	16,917,600
デンカ	24,900	3,335.00	83,041,500
信越化学工業	118,400	11,960.00	1,416,064,000

日本カーバイド工業	3,200	1,492.00	4,774,400
堺化学工業	4,600	2,596.00	11,941,600
第一稀元素化学工業	9,400	893.00	8,394,200
エア・ウォーター	55,700	1,616.00	90,011,200
大陽日酸	66,200	2,447.00	161,991,400
日本化学工業	2,400	3,495.00	8,388,000
日本パーカラライジング	35,400	1,188.00	42,055,200
高压ガス工業	12,400	871.00	10,800,400
チタン工業	1,800	2,720.00	4,896,000
四国化成工業	10,400	1,346.00	13,998,400
戸田工業	2,500	2,226.00	5,565,000
ステラ ケミファ	4,000	3,265.00	13,060,000
保土谷化学工業	2,800	4,195.00	11,746,000
日本触媒	10,800	6,870.00	74,196,000
大日精化工業	6,200	3,335.00	20,677,000
カネカ	17,700	3,640.00	64,428,000
三菱瓦斯化学	64,500	1,693.00	109,198,500
三井化学	62,600	2,701.00	169,082,600
J S R	64,300	2,083.00	133,936,900
東京応化工業	12,000	4,375.00	52,500,000
大阪有機化学工業	7,200	1,534.00	11,044,800
三菱ケミカルホールディングス	461,000	828.50	381,938,500
K Hネオケム	12,300	2,394.00	29,446,200
ダイセル	94,000	1,047.00	98,418,000
住友ベークライト	10,900	4,230.00	46,107,000
積水化学工業	148,200	1,927.00	285,581,400
日本ゼオン	62,300	1,379.00	85,911,700
アイカ工業	20,700	3,560.00	73,692,000
宇部興産	34,200	2,443.00	83,550,600
積水樹脂	12,300	2,334.00	28,708,200
タキロンシーアイ	16,100	718.00	11,559,800
旭有機材	4,500	1,742.00	7,839,000
日立化成	31,900	4,560.00	145,464,000
ニチバン	4,100	1,980.00	8,118,000
リケンテクノス	19,200	523.00	10,041,600
大倉工業	3,900	2,014.00	7,854,600
積水化成成品工業	10,200	832.00	8,486,400
群栄化学工業	2,400	2,616.00	6,278,400
ミライアル	3,300	1,430.00	4,719,000
ダイキョーニシカワ	14,400	888.00	12,787,200
森六ホールディングス	4,100	2,416.00	9,905,600
日本化薬	43,100	1,355.00	58,400,500

カーリットホールディングス	9,500	651.00	6,184,500
日本精化	6,700	1,291.00	8,649,700
扶桑化学工業	6,900	3,105.00	21,424,500
トリケミカル研究所	1,600	8,220.00	13,152,000
A D E K A	31,900	1,667.00	53,177,300
日油	25,900	3,720.00	96,348,000
ハリマ化成グループ	6,200	1,197.00	7,421,400
花王	168,500	9,042.00	1,523,577,000
第一工業製薬	2,900	4,635.00	13,441,500
三洋化成工業	4,000	5,500.00	22,000,000
大日本塗料	9,100	1,192.00	10,847,200
日本ペイントホールディングス	56,800	5,540.00	314,672,000
関西ペイント	77,600	2,650.00	205,640,000
中国塗料	20,300	1,052.00	21,355,600
日本特殊塗料	5,900	1,523.00	8,985,700
藤倉化成	13,200	588.00	7,761,600
太陽ホールディングス	5,000	4,360.00	21,800,000
D I C	28,700	3,115.00	89,400,500
サカタインクス	15,100	1,207.00	18,225,700
東洋インキS Cホールディングス	13,900	2,693.00	37,432,700
T & K T O K A	7,100	1,040.00	7,384,000
富士フイルムホールディングス	134,800	5,389.00	726,437,200
資生堂	139,800	7,856.00	1,098,268,800
ライオン	91,300	2,139.00	195,290,700
高砂香料工業	4,600	2,577.00	11,854,200
マンダム	15,800	3,005.00	47,479,000
ミルボン	9,400	6,230.00	58,562,000
ファンケル	28,600	2,941.00	84,112,600
コーセー	13,200	16,030.00	211,596,000
コタ	5,100	1,526.00	7,782,600
ポーラ・オルビスホールディングス	30,000	2,668.00	80,040,000
ノエビアホールディングス	6,600	5,780.00	38,148,000
エステー	5,400	1,723.00	9,304,200
アグロ カネショウ	3,300	1,518.00	5,009,400
コニシ	11,800	1,525.00	17,995,000
長谷川香料	9,700	2,041.00	19,797,700
小林製薬	19,700	9,260.00	182,422,000
荒川化学工業	7,000	1,660.00	11,620,000
メック	5,400	1,623.00	8,764,200
タカラバイオ	18,700	2,087.00	39,026,900
J C U	8,700	3,305.00	28,753,500
デクセリアルズ	19,000	1,090.00	20,710,000

アース製薬	5,300	5,760.00	30,528,000
北興化学工業	9,100	599.00	5,450,900
大成ラミック	3,300	2,907.00	9,593,100
クミアイ化学工業	29,500	979.00	28,880,500
日本農薬	14,600	581.00	8,482,600
アキレス	5,600	1,830.00	10,248,000
有沢製作所	11,700	1,010.00	11,817,000
日東電工	48,200	6,300.00	303,660,000
レック	8,100	1,344.00	10,886,400
三光合成	11,600	441.00	5,115,600
藤森工業	6,100	3,570.00	21,777,000
前澤化成工業	6,600	1,201.00	7,926,600
未来工業	4,500	2,202.00	9,909,000
J S P	4,600	1,957.00	9,002,200
エフピコ	7,800	6,680.00	52,104,000
天馬	5,300	2,016.00	10,684,800
信越ポリマー	12,600	1,043.00	13,141,800
東リ	23,100	332.00	7,669,200
ニフコ	25,500	3,050.00	77,775,000
バルカー	5,900	2,645.00	15,605,500
ユニ・チャーム	136,100	3,713.00	505,339,300
協和キリン	70,200	2,484.00	174,376,800
武田薬品工業	586,000	4,474.00	2,621,764,000
アステラス製薬	619,500	1,909.50	1,182,935,250
大日本住友製薬	52,500	2,105.00	110,512,500
塩野義製薬	89,900	6,802.00	611,499,800
田辺三菱製薬	85,200	2,006.00	170,911,200
あすか製薬	9,000	1,281.00	11,529,000
日本新薬	18,400	9,170.00	168,728,000
中外製薬	73,400	9,972.00	731,944,800
科研製薬	12,200	6,150.00	75,030,000
エーザイ	84,300	8,272.00	697,329,600
ロート製薬	35,900	3,360.00	120,624,000
小野薬品工業	162,000	2,470.50	400,221,000
久光製薬	20,700	5,350.00	110,745,000
持田製薬	10,000	4,580.00	45,800,000
参天製薬	130,900	2,032.00	265,988,800
扶桑薬品工業	3,600	2,096.00	7,545,600
日本ケミファ	1,500	2,953.00	4,429,500
ツムラ	22,100	3,235.00	71,493,500
日医工	20,100	1,393.00	27,999,300
キッセイ薬品工業	12,800	3,130.00	40,064,000

生化学工業	14,200	1,256.00	17,835,200
栄研化学	12,800	2,036.00	26,060,800
鳥居薬品	4,500	3,035.00	13,657,500
J C R ファーマ	5,000	8,650.00	43,250,000
東和薬品	9,000	2,897.00	26,073,000
富士製薬工業	5,600	1,352.00	7,571,200
沢井製薬	14,700	6,890.00	101,283,000
ゼリア新薬工業	13,000	2,105.00	27,365,000
第一三共	201,400	7,070.00	1,423,898,000
キョーリン製薬ホールディングス	14,700	1,928.00	28,341,600
大幸薬品	3,300	3,195.00	10,543,500
ダイト	4,400	3,175.00	13,970,000
大塚ホールディングス	134,100	4,961.00	665,270,100
大正製薬ホールディングス	14,800	8,300.00	122,840,000
ペプチドリーム	35,700	5,250.00	187,425,000
日本コークス工業	81,700	78.00	6,372,600
ニチレキ	9,500	1,325.00	12,587,500
ユシロ化学工業	5,900	1,484.00	8,755,600
富士石油	25,200	245.00	6,174,000
出光興産	79,100	3,015.00	238,486,500
J X T G ホールディングス	1,090,700	505.50	551,348,850
コスモエネルギーホールディングス	20,700	2,556.00	52,909,200
横浜ゴム	40,700	2,228.00	90,679,600
TOYO TIRE	41,200	1,632.00	67,238,400
ブリヂストン	216,700	4,237.00	918,157,900
住友ゴム工業	63,400	1,401.00	88,823,400
オカモト	4,500	4,130.00	18,585,000
ニッタ	7,900	3,305.00	26,109,500
住友理工	13,700	1,041.00	14,261,700
三ツ星ベルト	9,600	2,167.00	20,803,200
バンドー化学	13,500	949.00	12,811,500
日東紡績	10,600	4,370.00	46,322,000
A G C	69,500	3,985.00	276,957,500
日本板硝子	21,500	669.00	14,383,500
日本山村硝子	5,400	1,348.00	7,279,200
日本電気硝子	28,500	2,480.00	70,680,000
オハラ	3,600	1,460.00	5,256,000
住友大阪セメント	13,700	4,900.00	67,130,000
太平洋セメント	44,500	3,405.00	151,522,500
日本ヒューム	9,300	867.00	8,063,100
日本コンクリート工業	20,500	284.00	5,822,000
三谷セキサン	3,500	3,725.00	13,037,500

アジアパイルホールディングス	13,300	610.00	8,113,000
東海カーボン	73,800	1,115.00	82,287,000
日本カーボン	3,700	4,350.00	16,095,000
東洋炭素	4,600	2,361.00	10,860,600
ノリタケカンパニーリミテド	4,000	4,705.00	18,820,000
TOTO	50,300	4,725.00	237,667,500
日本碍子	85,400	1,902.00	162,430,800
日本特殊陶業	54,600	2,144.00	117,062,400
MARUWA	2,800	8,150.00	22,820,000
品川リフラクトリーズ	2,400	3,535.00	8,484,000
黒崎播磨	1,500	6,590.00	9,885,000
ヨータイ	8,200	752.00	6,166,400
東京窯業	16,500	353.00	5,824,500
フジインコーポレーテッド	6,400	2,954.00	18,905,600
ニチアス	19,300	2,762.00	53,306,600
ニチハ	9,700	2,742.00	26,597,400
日本製鉄	311,500	1,702.00	530,173,000
神戸製鋼所	129,300	607.00	78,485,100
中山製鋼所	13,000	573.00	7,449,000
合同製鐵	4,100	2,820.00	11,562,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	187,900	1,459.00	274,146,100
東京製鐵	34,200	803.00	27,462,600
共英製鋼	8,000	2,159.00	17,272,000
大和工業	15,100	2,739.00	41,358,900
東京鐵鋼	4,000	1,577.00	6,308,000
大阪製鐵	4,500	1,384.00	6,228,000
淀川製鋼所	9,100	2,077.00	18,900,700
丸一鋼管	22,900	3,150.00	72,135,000
モリ工業	2,700	2,507.00	6,768,900
大同特殊鋼	11,400	4,905.00	55,917,000
日本冶金工業	5,900	2,340.00	13,806,000
山陽特殊製鋼	5,400	1,597.00	8,623,800
愛知製鋼	3,900	3,895.00	15,190,500
日立金属	74,900	1,610.00	120,589,000
大平洋金属	4,900	2,549.00	12,490,100
新日本電工	50,200	180.00	9,036,000
栗本鐵工所	4,300	2,157.00	9,275,100
三菱製鋼	6,700	1,100.00	7,370,000
シンニッタン	14,700	437.00	6,423,900
大紀アルミニウム工業所	11,200	776.00	8,691,200
日本輕金属ホールディングス	178,000	234.00	41,652,000
三井金属鉱業	18,900	2,834.00	53,562,600

東邦亜鉛	4,000	2,107.00	8,428,000
三菱マテリアル	45,700	3,075.00	140,527,500
住友金属鉱山	89,200	3,545.00	316,214,000
D O W Aホールディングス	17,600	4,195.00	73,832,000
古河機械金属	12,500	1,462.00	18,275,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,800	1,522.00	11,871,600
東邦チタニウム	13,700	921.00	12,617,700
U A C J	10,700	2,588.00	27,691,600
C Kサンエツ	1,800	3,450.00	6,210,000
古河電気工業	21,500	2,891.00	62,156,500
住友電気工業	260,000	1,680.50	436,930,000
フジクラ	85,900	462.00	39,685,800
昭和電線ホールディングス	9,600	1,275.00	12,240,000
タツタ電線	15,300	608.00	9,302,400
リョービ	8,500	2,125.00	18,062,500
アーレスティ	11,500	561.00	6,451,500
アサヒホールディングス	12,500	2,664.00	33,300,000
稲葉製作所	5,500	1,433.00	7,881,500
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,083.00	6,873,900
トーカロ	19,400	1,138.00	22,077,200
アルファC o	4,300	1,307.00	5,620,100
S U M C O	83,500	1,804.00	150,634,000
川田テクノロジーズ	1,700	6,770.00	11,509,000
R S Technologies	2,200	3,895.00	8,569,000
東洋製罐グループホールディングス	44,600	1,950.00	86,970,000
ホッカンホールディングス	4,800	1,979.00	9,499,200
コロナ	5,900	1,126.00	6,643,400
横河ブリッジホールディングス	13,000	1,983.00	25,779,000
三和ホールディングス	66,800	1,245.00	83,166,000
文化シャッター	21,200	987.00	20,924,400
三協立山	10,500	1,279.00	13,429,500
アルインコ	7,000	1,295.00	9,065,000
L I X I Lグループ	103,000	1,988.00	204,764,000
ノーリツ	14,900	1,502.00	22,379,800
長府製作所	7,200	2,492.00	17,942,400
リンナイ	13,600	8,620.00	117,232,000
日東精工	13,000	644.00	8,372,000
岡部	14,600	969.00	14,147,400
ジーテクト	8,700	1,862.00	16,199,400
東プレ	12,900	1,802.00	23,245,800
高周波熱錬	14,200	917.00	13,021,400
東京製綱	6,700	1,327.00	8,890,900

パイオラックス	10,200	2,214.00	22,582,800
エイチワン	9,300	843.00	7,839,900
日本発條	75,000	1,029.00	77,175,000
三益半導体工業	6,200	2,161.00	13,398,200
日本製鋼所	21,500	2,169.00	46,633,500
三浦工業	30,100	3,730.00	112,273,000
タクマ	23,700	1,309.00	31,023,300
ツガミ	14,800	1,117.00	16,531,600
オークマ	8,000	5,920.00	47,360,000
東芝機械	7,900	2,969.00	23,455,100
アマダホールディングス	87,300	1,277.00	111,482,100
アイダエンジニアリング	18,200	1,012.00	18,418,400
F U J I	28,700	1,980.00	56,826,000
牧野フライス製作所	8,000	4,990.00	39,920,000
オーエスジー	32,400	2,116.00	68,558,400
旭ダイヤモンド工業	19,100	660.00	12,606,000
D M G 森精機	43,900	1,721.00	75,551,900
ソディック	16,700	997.00	16,649,900
ディスコ	9,400	26,350.00	247,690,000
日東工器	4,300	2,476.00	10,646,800
日進工具	2,100	2,578.00	5,413,800
パンチ工業	9,200	557.00	5,124,400
豊和工業	5,700	849.00	4,839,300
島精機製作所	11,300	2,715.00	30,679,500
オプトラン	8,000	2,968.00	23,744,000
イワキポンプ	4,500	1,187.00	5,341,500
フリュー	8,600	1,060.00	9,116,000
ヤマシンフィルタ	15,200	877.00	13,330,400
日阪製作所	10,300	1,009.00	10,392,700
やまびこ	13,800	1,227.00	16,932,600
平田機工	3,300	7,210.00	23,793,000
ペガサスミシン製造	10,700	509.00	5,446,300
マルマエ	3,500	999.00	3,496,500
タツモ	3,600	1,316.00	4,737,600
ナプテスコ	40,900	3,405.00	139,264,500
三井海洋開発	7,600	2,706.00	20,565,600
レオン自動機	6,900	1,615.00	11,143,500
S M C	22,100	50,750.00	1,121,575,000
ホソカワミクロン	2,700	4,670.00	12,609,000
ユニオンツール	2,600	3,235.00	8,411,000
オイレス工業	9,300	1,690.00	15,717,000
日精エー・エス・ビー機械	2,600	4,695.00	12,207,000

サトーホールディングス	10,100	3,420.00	34,542,000
技研製作所	6,400	4,890.00	31,296,000
日精樹脂工業	7,300	1,039.00	7,584,700
ワイエイシイホールディングス	4,100	768.00	3,148,800
小松製作所	318,700	2,682.00	854,753,400
住友重機械工業	39,800	3,170.00	126,166,000
日立建機	27,500	3,325.00	91,437,500
日工	12,400	895.00	11,098,000
巴工業	3,900	2,310.00	9,009,000
井関農機	7,900	1,700.00	13,430,000
TOWA	7,800	1,161.00	9,055,800
北川鉄工所	3,600	2,448.00	8,812,800
ローツェ	3,200	4,260.00	13,632,000
クボタ	373,200	1,763.50	658,138,200
荏原実業	2,600	2,253.00	5,857,800
三菱化工機	3,700	1,960.00	7,252,000
月島機械	13,400	1,710.00	22,914,000
帝国電機製作所	7,100	1,419.00	10,074,900
新東工業	16,700	1,077.00	17,985,900
澁谷工業	6,300	3,175.00	20,002,500
アイチ コーポレーション	13,700	741.00	10,151,700
小森コーポレーション	17,600	1,150.00	20,240,000
鶴見製作所	6,100	2,116.00	12,907,600
住友精密工業	1,800	3,390.00	6,102,000
酒井重工業	1,900	2,938.00	5,582,200
荏原製作所	29,300	3,400.00	99,620,000
西島製作所	8,900	945.00	8,410,500
北越工業	8,500	1,316.00	11,186,000
ダイキン工業	89,700	15,560.00	1,395,732,000
オルガノ	2,600	6,550.00	17,030,000
トーヨーカネツ	3,900	2,368.00	9,235,200
栗田工業	37,800	3,285.00	124,173,000
椿本チエイン	9,600	3,925.00	37,680,000
大同工業	6,200	838.00	5,195,600
アネスト岩田	11,900	1,078.00	12,828,200
ダイフク	35,600	6,650.00	236,740,000
加藤製作所	4,500	1,765.00	7,942,500
タダノ	34,800	1,002.00	34,869,600
フジテック	25,100	1,766.00	44,326,600
C K D	19,700	1,835.00	36,149,500
キトー	6,000	1,714.00	10,284,000
平和	19,700	2,246.00	44,246,200

理想科学工業	6,600	1,924.00	12,698,400
SANKYO	16,100	3,565.00	57,396,500
日本金銭機械	9,400	919.00	8,638,600
マースグループホールディングス	5,500	2,031.00	11,170,500
フクシマガリレイ	4,400	4,100.00	18,040,000
ダイコク電機	4,500	1,674.00	7,533,000
竹内製作所	11,600	1,689.00	19,592,400
アマノ	18,500	3,415.00	63,177,500
JUKI	10,600	898.00	9,518,800
マックス	10,700	2,134.00	22,833,800
グローリー	19,700	3,370.00	66,389,000
新晃工業	6,900	2,012.00	13,882,800
大和冷機工業	10,700	1,272.00	13,610,400
セガサミーホールディングス	70,400	1,619.00	113,977,600
日本ピストンリング	4,400	1,569.00	6,903,600
リケン	3,400	4,385.00	14,909,000
TPR	9,000	2,192.00	19,728,000
ツバキ・ナカシマ	14,600	1,668.00	24,352,800
ホシザキ	20,600	9,960.00	205,176,000
大豊工業	7,400	893.00	6,608,200
日本精工	130,700	1,064.00	139,064,800
NTN	161,900	349.00	56,503,100
ジェイテクト	65,900	1,349.00	88,899,100
不二越	6,600	4,895.00	32,307,000
日本トムソン	22,900	504.00	11,541,600
THK	40,800	2,961.00	120,808,800
ユーシン精機	6,700	1,038.00	6,954,600
前澤給装工業	3,700	2,211.00	8,180,700
イーグル工業	8,900	1,141.00	10,154,900
日本ピラー工業	7,800	1,559.00	12,160,200
キッツ	29,000	761.00	22,069,000
マキタ	91,500	3,830.00	350,445,000
日立造船	56,000	427.00	23,912,000
三菱重工業	117,700	4,295.00	505,521,500
IHI	50,900	2,481.00	126,282,900
スター精密	11,200	1,605.00	17,976,000
日清紡ホールディングス	47,800	1,045.00	49,951,000
イビデン	43,500	2,667.00	116,014,500
コニカミノルタ	155,100	721.00	111,827,100
ブラザー工業	85,500	2,295.00	196,222,500
ミネベアミツミ	130,100	2,302.00	299,490,200
日立製作所	338,300	4,670.00	1,579,861,000

三菱電機	704,000	1,536.50	1,081,696,000
富士電機	42,200	3,415.00	144,113,000
東洋電機製造	3,800	1,608.00	6,110,400
安川電機	75,600	4,230.00	319,788,000
シンフォニアテクノロジー	9,400	1,381.00	12,981,400
明電舎	13,100	2,284.00	29,920,400
オリジン	3,400	1,507.00	5,123,800
山洋電気	3,500	5,560.00	19,460,000
デンヨー	6,500	2,084.00	13,546,000
東芝テック	8,800	4,640.00	40,832,000
芝浦メカトロニクス	1,600	3,790.00	6,064,000
マブチモーター	19,300	4,285.00	82,700,500
日本電産	84,700	15,555.00	1,317,508,500
トレックス・セミコンダクター	4,900	1,639.00	8,031,100
東光高岳	5,500	1,192.00	6,556,000
宮越ホールディングス	3,900	1,114.00	4,344,600
ダイヘン	7,700	3,650.00	28,105,000
ヤーマン	11,200	749.00	8,388,800
JVCケンウッド	60,000	270.00	16,200,000
ミマキエンジニアリング	9,300	525.00	4,882,500
第一精工	3,000	2,510.00	7,530,000
日新電機	16,700	1,350.00	22,545,000
大崎電気工業	16,200	715.00	11,583,000
オムロン	65,300	6,580.00	429,674,000
日東工業	10,700	2,604.00	27,862,800
I D E C	10,500	2,285.00	23,992,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24,100	2,429.00	58,538,900
サクサホールディングス	3,000	1,942.00	5,826,000
メルコホールディングス	2,800	3,085.00	8,638,000
日本電気	85,400	4,525.00	386,435,000
富士通	67,900	10,265.00	696,993,500
沖電気工業	29,900	1,554.00	46,464,600
電気興業	3,700	3,450.00	12,765,000
サンケン電気	8,000	3,335.00	26,680,000
アイホン	5,100	1,870.00	9,537,000
ルネサスエレクトロニクス	336,300	754.00	253,570,200
セイコーエプソン	86,900	1,714.00	148,946,600
ワコム	47,800	475.00	22,705,000
アルバック	14,100	4,610.00	65,001,000
E I Z O	5,500	4,000.00	22,000,000
日本信号	18,500	1,443.00	26,695,500
京三製作所	19,000	610.00	11,590,000

能美防災	9,600	2,429.00	23,318,400
ホーチキ	6,000	1,806.00	10,836,000
エレコム	7,700	4,290.00	33,033,000
パナソニック	805,200	1,026.50	826,537,800
シャープ	81,600	1,745.00	142,392,000
アンリツ	45,700	2,147.00	98,117,900
富士通ゼネラル	19,800	2,427.00	48,054,600
ソニー	444,900	7,453.00	3,315,839,700
T D K	33,800	12,400.00	419,120,000
帝国通信工業	5,800	1,223.00	7,093,400
タムラ製作所	24,200	692.00	16,746,400
アルプスアルパイン	62,200	2,531.00	157,428,200
日本トリム	1,300	4,625.00	6,012,500
ローランド ディー . ジー .	4,800	2,270.00	10,896,000
フォスター電機	7,700	2,074.00	15,969,800
S M K	2,400	3,010.00	7,224,000
ヨコオ	4,600	3,310.00	15,226,000
ホシデン	19,300	1,423.00	27,463,900
ヒロセ電機	10,900	13,860.00	151,074,000
日本航空電子工業	16,000	2,253.00	36,048,000
T O A	8,900	1,140.00	10,146,000
マクセルホールディングス	15,400	1,522.00	23,438,800
古野電気	10,100	1,378.00	13,917,800
ユニデンホールディングス	2,800	1,907.00	5,339,600
スミダコーポレーション	6,400	1,309.00	8,377,600
アイコム	4,600	2,742.00	12,613,200
リオン	3,500	3,055.00	10,692,500
船井電機	9,500	696.00	6,612,000
横河電機	64,700	1,943.00	125,712,100
新電元工業	2,800	3,965.00	11,102,000
アズビル	44,100	3,180.00	140,238,000
東亜ディーケーケー	5,500	1,080.00	5,940,000
日本光電工業	29,600	2,933.00	86,816,800
チノー	4,200	1,425.00	5,985,000
共和電業	15,200	451.00	6,855,200
堀場製作所	14,000	7,490.00	104,860,000
アドバンテスト	52,400	5,980.00	313,352,000
エスペック	6,500	2,263.00	14,709,500
キーエンス	63,800	38,970.00	2,486,286,000
日置電機	3,900	3,915.00	15,268,500
シスメックス	50,500	7,410.00	374,205,000
日本マイクロニクス	11,500	1,196.00	13,754,000

メガチップス	7,000	1,935.00	13,545,000
O B A R A G R O U P	3,800	3,775.00	14,345,000
コーセル	9,900	1,296.00	12,830,400
イリソ電子工業	6,000	5,030.00	30,180,000
オブテックスグループ	11,900	1,583.00	18,837,700
千代田インテグレ	3,800	2,460.00	9,348,000
レーザーテック	14,400	10,200.00	146,880,000
スタンレー電気	49,300	3,170.00	156,281,000
岩崎電気	4,600	1,527.00	7,024,200
ウシオ電機	41,400	1,642.00	67,978,800
ハリオス テクノ ホールディング	9,200	475.00	4,370,000
日本セラミック	7,400	2,819.00	20,860,600
山一電機	5,700	1,693.00	9,650,100
図研	5,100	2,505.00	12,775,500
日本電子	14,000	3,240.00	45,360,000
カシオ計算機	62,600	2,199.00	137,657,400
ファナック	66,900	21,030.00	1,406,907,000
日本シイエムケイ	17,800	665.00	11,837,000
エンプラス	3,600	3,625.00	13,050,000
ローム	31,200	8,710.00	271,752,000
浜松ホトニクス	50,400	4,540.00	228,816,000
三井ハイテック	8,000	1,638.00	13,104,000
新光電気工業	23,600	1,262.00	29,783,200
京セラ	99,100	7,481.00	741,367,100
太陽誘電	31,300	3,105.00	97,186,500
村田製作所	206,800	6,516.00	1,347,508,800
双葉電子工業	11,500	1,404.00	16,146,000
北陸電気工業	4,200	1,173.00	4,926,600
ニチコン	24,200	1,168.00	28,265,600
日本ケミコン	5,900	2,125.00	12,537,500
K O A	11,000	1,418.00	15,598,000
市光工業	11,200	838.00	9,385,600
小糸製作所	42,100	5,570.00	234,497,000
ミツバ	14,000	795.00	11,130,000
S C R E E Nホールディングス	12,300	7,530.00	92,619,000
キャノン電子	7,500	2,140.00	16,050,000
キャノン	378,800	3,101.00	1,174,658,800
リコー	179,100	1,165.00	208,651,500
象印マホービン	21,100	1,878.00	39,625,800
東京エレクトロン	46,900	23,910.00	1,121,379,000
トヨタ紡織	20,200	1,846.00	37,289,200
ユニプレス	13,800	1,624.00	22,411,200

豊田自動織機	56,900	6,480.00	368,712,000	
モリタホールディングス	12,500	1,785.00	22,312,500	
三櫻工業	8,500	1,408.00	11,968,000	
デンソー	155,000	5,068.00	785,540,000	
東海理化電機製作所	18,400	2,255.00	41,492,000	
三井E & Sホールディングス	14,900	966.00	14,393,400	
川崎重工業	54,700	2,490.00	136,203,000	
名村造船所	27,400	265.00	7,261,000	
日本車輛製造	3,300	3,135.00	10,345,500	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,336.00	12,291,200	
日産自動車	830,600	671.70	557,914,020	
いすゞ自動車	204,900	1,334.00	273,336,600	
トヨタ自動車	784,800	7,831.00	6,145,768,800	代用有価証券 400,000株
日野自動車	87,700	1,165.00	102,170,500	
三菱自動車工業	261,100	481.00	125,589,100	
エフテック	7,600	813.00	6,178,800	
武蔵精密工業	15,900	1,529.00	24,311,100	
日産車体	14,200	1,039.00	14,753,800	
新明和工業	19,200	1,507.00	28,934,400	
極東開発工業	12,700	1,643.00	20,866,100	
日信工業	14,300	2,216.00	31,688,800	
トピー工業	6,000	2,062.00	12,372,000	
ティラド	3,500	2,061.00	7,213,500	
タチエス	12,000	1,502.00	18,024,000	
N O K	38,100	1,732.00	65,989,200	
フタバ産業	20,100	788.00	15,838,800	
K Y B	8,000	3,320.00	26,560,000	
大同メタル工業	16,800	789.00	13,255,200	
プレス工業	35,700	453.00	16,172,100	
太平洋工業	15,000	1,492.00	22,380,000	
ケーヒン	16,000	2,562.00	40,992,000	
河西工業	11,000	914.00	10,054,000	
アイシン精機	57,700	4,150.00	239,455,000	
マツダ	206,800	961.00	198,734,800	
今仙電機製作所	9,500	1,009.00	9,585,500	
本田技研工業	554,300	3,163.00	1,753,250,900	
スズキ	139,700	4,750.00	663,575,000	
S U B A R U	218,900	2,811.50	615,437,350	
安永	4,100	1,284.00	5,264,400	
ヤマハ発動機	92,000	2,293.00	210,956,000	
ショーワ	16,600	2,265.00	37,599,000	
T B K	15,300	464.00	7,099,200	

エクセディ	9,400	2,520.00	23,688,000
豊田合成	22,700	2,806.00	63,696,200
愛三工業	12,300	841.00	10,344,300
日本プラスト	8,400	749.00	6,291,600
ヨロズ	7,700	1,467.00	11,295,900
エフ・シー・シー	11,300	2,402.00	27,142,600
シマノ	26,300	17,770.00	467,351,000
テイ・エス テック	16,400	3,450.00	56,580,000
ジャムコ	4,800	1,469.00	7,051,200
テルモ	199,300	3,932.00	783,647,600
日機装	21,600	1,448.00	31,276,800
日本エム・ディ・エム	4,600	2,220.00	10,212,000
島津製作所	84,300	3,415.00	287,884,500
J M S	9,600	842.00	8,083,200
長野計器	7,800	935.00	7,293,000
ブイ・テクノロジー	3,300	5,820.00	19,206,000
東京計器	6,400	1,032.00	6,604,800
インターアクション	4,200	2,817.00	11,831,400
東京精密	12,800	4,210.00	53,888,000
マニー	28,300	3,005.00	85,041,500
ニコン	113,600	1,429.00	162,334,400
トプコン	36,100	1,446.00	52,200,600
オリンパス	390,000	1,642.50	640,575,000
理研計器	6,100	2,345.00	14,304,500
タムロン	5,900	2,634.00	15,540,600
H O Y A	141,800	10,215.00	1,448,487,000
ノーリツ鋼機	5,200	1,635.00	8,502,000
エー・アンド・デイ	7,900	1,081.00	8,539,900
朝日インテック	59,700	3,160.00	188,652,000
シチズン時計	82,700	612.00	50,612,400
メニコン	9,600	4,500.00	43,200,000
松風	4,300	1,729.00	7,434,700
セイコーホールディングス	9,800	2,856.00	27,988,800
ニプロ	49,900	1,322.00	65,967,800
スノーピーク	4,500	1,099.00	4,945,500
パラマウントベッドホールディングス	7,300	4,630.00	33,799,000
トランザクシオン	5,300	987.00	5,231,100
ニホンフラッシュ	3,700	2,894.00	10,707,800
前田工織	8,100	2,141.00	17,342,100
永大産業	14,700	356.00	5,233,200
アートネイチャー	8,200	838.00	6,871,600
バンダイナムコホールディングス	73,000	6,521.00	476,033,000

SHOEI	3,400	5,270.00	17,918,000
フランスベッドホールディングス	11,800	996.00	11,752,800
パイロットコーポレーション	12,500	4,585.00	57,312,500
萩原工業	4,400	1,752.00	7,708,800
トッパン・フォームズ	14,900	1,228.00	18,297,200
フジシールインターナショナル	15,900	2,433.00	38,684,700
タカラトミー	31,800	1,381.00	43,915,800
廣濟堂	7,600	811.00	6,163,600
プロネクサス	7,200	1,220.00	8,784,000
大建工業	5,000	1,970.00	9,850,000
凸版印刷	99,200	2,299.00	228,060,800
大日本印刷	91,700	3,025.00	277,392,500
共同印刷	2,000	2,985.00	5,970,000
NISSHA	14,800	1,143.00	16,916,400
TAKARA & COMPANY	3,700	1,762.00	6,519,400
アシックス	58,900	1,821.00	107,256,900
小松ウオール工業	2,600	2,344.00	6,094,400
ヤマハ	41,700	6,160.00	256,872,000
河合楽器製作所	2,500	3,885.00	9,712,500
クリナップ	9,000	722.00	6,498,000
ピジョン	42,600	4,065.00	173,169,000
キングジム	6,800	881.00	5,990,800
リンテック	17,000	2,486.00	42,262,000
イトーキ	18,500	582.00	10,767,000
任天堂	43,200	43,720.00	1,888,704,000
三菱鉛筆	11,500	1,704.00	19,596,000
タカラスタANDARD	14,100	2,000.00	28,200,000
コクヨ	34,000	1,674.00	56,916,000
ナカバヤシ	7,400	621.00	4,595,400
グローブライド	3,600	2,657.00	9,565,200
オカムラ	24,300	1,066.00	25,903,800
美津濃	6,500	2,794.00	18,161,000
東京電力ホールディングス	558,300	480.00	267,984,000
中部電力	215,400	1,579.50	340,224,300
関西電力	267,200	1,286.00	343,619,200
中国電力	96,800	1,460.00	141,328,000
北陸電力	66,000	813.00	53,658,000
東北電力	176,000	1,122.00	197,472,000
四国電力	63,800	1,106.00	70,562,800
九州電力	143,700	965.00	138,670,500
北海道電力	68,100	541.00	36,842,100
沖縄電力	13,000	2,106.00	27,378,000

電源開発	55,700	2,714.00	151,169,800
イーレックス	10,400	1,863.00	19,375,200
レノバ	11,500	1,230.00	14,145,000
東京瓦斯	136,000	2,697.50	366,860,000
大阪瓦斯	136,700	2,157.00	294,861,900
東邦瓦斯	34,900	4,595.00	160,365,500
北海道瓦斯	4,600	1,664.00	7,654,400
広島ガス	17,000	364.00	6,188,000
西部瓦斯	7,800	2,618.00	20,420,400
静岡ガス	20,400	1,001.00	20,420,400
メタウォーター	3,200	4,435.00	14,192,000
SBSホールディングス	6,600	1,937.00	12,784,200
東武鉄道	73,900	4,020.00	297,078,000
相鉄ホールディングス	22,800	2,976.00	67,852,800
東急	177,400	2,032.00	360,476,800
京浜急行電鉄	90,400	2,099.00	189,749,600
小田急電鉄	104,000	2,595.00	269,880,000
京王電鉄	36,500	6,710.00	244,915,000
京成電鉄	48,800	4,255.00	207,644,000
富士急行	9,800	4,280.00	41,944,000
新京成電鉄	2,800	2,369.00	6,633,200
東日本旅客鉄道	124,000	9,878.00	1,224,872,000
西日本旅客鉄道	62,800	9,587.00	602,063,600
東海旅客鉄道	58,500	22,080.00	1,291,680,000
西武ホールディングス	94,600	1,816.00	171,793,600
鴻池運輸	10,600	1,668.00	17,680,800
西日本鉄道	20,000	2,557.00	51,140,000
ハマキョウレックス	5,500	3,580.00	19,690,000
サカイ引越センター	3,700	7,050.00	26,085,000
近鉄グループホールディングス	66,600	5,930.00	394,938,000
阪急阪神ホールディングス	88,900	4,760.00	423,164,000
南海電気鉄道	32,100	2,982.00	95,722,200
京阪ホールディングス	29,600	5,240.00	155,104,000
神戸電鉄	1,700	3,975.00	6,757,500
名古屋鉄道	54,500	3,400.00	185,300,000
山陽電気鉄道	5,900	2,198.00	12,968,200
日本通運	23,500	6,460.00	151,810,000
ヤマトホールディングス	117,100	1,843.00	215,815,300
山九	18,500	5,580.00	103,230,000
丸全昭和運輸	5,700	3,200.00	18,240,000
センコーグループホールディングス	35,900	944.00	33,889,600
トナミホールディングス	1,800	5,310.00	9,558,000

ニッコンホールディングス	23,800	2,752.00	65,497,600
福山通運	8,400	4,075.00	34,230,000
セイノーホールディングス	49,700	1,482.00	73,655,400
神奈川中央交通	2,300	4,075.00	9,372,500
日立物流	11,800	3,005.00	35,459,000
丸和運輸機関	6,900	2,511.00	17,325,900
C & F ロジホールディングス	7,600	1,457.00	11,073,200
九州旅客鉄道	59,600	3,635.00	216,646,000
S Gホールディングス	70,000	2,523.00	176,610,000
日本郵船	55,400	1,974.00	109,359,600
商船三井	41,900	2,937.00	123,060,300
川崎汽船	19,800	1,843.00	36,491,400
N S ユナイテッド海運	4,400	2,283.00	10,045,200
飯野海運	38,200	369.00	14,095,800
乾汽船	5,800	1,146.00	6,646,800
日本航空	122,300	3,382.00	413,618,600
A N Aホールディングス	122,200	3,642.00	445,052,400
トランコム	2,000	8,000.00	16,000,000
日新	6,300	1,851.00	11,661,300
三菱倉庫	21,300	2,871.00	61,152,300
三井倉庫ホールディングス	8,100	2,003.00	16,224,300
住友倉庫	24,000	1,500.00	36,000,000
澁澤倉庫	4,600	2,334.00	10,736,400
東陽倉庫	20,900	344.00	7,189,600
日本トランスシティ	17,300	567.00	9,809,100
川西倉庫	3,200	1,064.00	3,404,800
安田倉庫	7,500	1,029.00	7,717,500
東洋埠頭	4,900	1,402.00	6,869,800
上組	38,600	2,434.00	93,952,400
近鉄エクスプレス	14,000	1,872.00	26,208,000
エーアイティー	6,400	979.00	6,265,600
日本コンセプト	3,600	1,496.00	5,385,600
N E C ネットズエスアイ	6,500	3,570.00	23,205,000
システナ	24,400	1,747.00	42,626,800
デジタルアーツ	3,500	5,430.00	19,005,000
日鉄ソリューションズ	10,200	3,625.00	36,975,000
キューブシステム	6,800	794.00	5,399,200
コア	3,900	1,405.00	5,479,500
ソリトンシステムズ	4,700	1,303.00	6,124,100
ソフトクリエイトホールディングス	4,000	1,807.00	7,228,000
T I S	23,000	6,490.00	149,270,000
電算システム	3,300	3,020.00	9,966,000

グリー	49,700	506.00	25,148,200
コーエーテクモホールディングス	14,100	2,820.00	39,762,000
三菱総合研究所	3,300	4,175.00	13,777,500
ファインデックス	7,600	1,444.00	10,974,400
ブレインパッド	1,500	5,510.00	8,265,000
K L a b	14,000	830.00	11,620,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	9,500	965.00	9,167,500
ネクソン	196,800	1,470.00	289,296,000
アイスタイル	18,700	685.00	12,809,500
エムアップ	2,500	2,539.00	6,347,500
エイチーム	6,700	1,150.00	7,705,000
エニグモ	6,500	925.00	6,012,500
コロプラ	23,200	1,261.00	29,255,200
ブロードリーフ	36,100	683.00	24,656,300
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,008.00	5,443,200
システム情報	4,300	1,021.00	4,390,300
メディアドゥホールディングス	2,500	3,935.00	9,837,500
じげん	19,600	534.00	10,466,400
フィックスターズ	8,000	1,510.00	12,080,000
C A R T A H O L D I N G S	4,500	1,228.00	5,526,000
オブティム	2,400	3,265.00	7,836,000
セレス	3,200	1,250.00	4,000,000
S H I F T	1,800	7,700.00	13,860,000
ティーガイア	6,100	2,692.00	16,421,200
セック	1,500	3,710.00	5,565,000
豆蔵ホールディングス	5,400	1,446.00	7,808,400
テクマトリックス	5,000	2,347.00	11,735,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,300	2,363.00	40,879,900
G M O ペイメントゲートウェイ	11,500	7,190.00	82,685,000
システムリサーチ	2,600	1,804.00	4,690,400
インターネットイニシアティブ	10,600	2,826.00	29,955,600
さくらインターネット	8,400	690.00	5,796,000
G M O クラウド	1,800	2,573.00	4,631,400
S R A ホールディングス	4,400	2,679.00	11,787,600
e B A S E	4,800	1,120.00	5,376,000
アバント	5,800	1,019.00	5,910,200
アドソル日進	2,800	2,245.00	6,286,000
フリービット	5,500	932.00	5,126,000
コムチュア	7,900	2,426.00	19,165,400
アステリア	5,700	625.00	3,562,500
マークライنز	4,300	2,015.00	8,664,500
メディカル・データ・ビジョン	6,100	825.00	5,032,500

g u m i	10,200	880.00	8,976,000
モバイルファクトリー	2,300	1,356.00	3,118,800
テラスカイ	3,000	2,342.00	7,026,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	1,667.00	6,501,300
ダブルスタンダード	1,100	4,780.00	5,258,000
オープンドア	4,000	1,606.00	6,424,000
アカツキ	2,600	5,820.00	15,132,000
U b i c o mホールディングス	2,300	1,163.00	2,674,900
L I N E	16,100	5,250.00	84,525,000
チェンジ	1,800	2,563.00	4,613,400
オークネット	5,800	1,422.00	8,247,600
A O I T Y O H o l d i n g s	8,700	713.00	6,203,100
マクロミル	13,600	999.00	13,586,400
オロ	2,200	3,645.00	8,019,000
サインポスト	1,500	2,040.00	3,060,000
ソルクシーズ	4,400	945.00	4,158,000
プロトコーポレーション	7,500	1,188.00	8,910,000
野村総合研究所	115,100	2,344.00	269,794,400
サイバネットシステム	6,500	868.00	5,642,000
インテージホールディングス	10,700	930.00	9,951,000
ソースネクスト	34,800	448.00	15,590,400
インフォコム	7,700	2,501.00	19,257,700
ラクスル	3,900	3,750.00	14,625,000
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,658.00	14,093,000
フォーカスシステムズ	6,200	889.00	5,511,800
クレスコ	2,500	3,565.00	8,912,500
フジ・メディア・ホールディングス	67,100	1,555.00	104,340,500
オービック	23,900	14,430.00	344,877,000
ジャストシステム	11,200	6,180.00	69,216,000
T D C ソフト	7,200	932.00	6,710,400
Zホールディングス	949,700	429.00	407,421,300
トレンドマイクロ	30,900	5,750.00	177,675,000
I Dホールディングス	3,900	1,522.00	5,935,800
日本オラクル	13,900	9,940.00	138,166,000
アルファシステムズ	2,700	2,875.00	7,762,500
フューチャー	8,700	1,840.00	16,008,000
C A C H o l d i n g s	5,900	1,641.00	9,681,900
S Bテクノロジー	3,000	1,942.00	5,826,000
オービックビジネスコンサルタント	7,000	5,070.00	35,490,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	3,055.00	95,927,000
アイティフォー	10,300	869.00	8,950,700
大塚商会	37,200	4,490.00	167,028,000

サイボウズ	9,700	1,219.00	11,824,300
ソフトブレーン	5,500	632.00	3,476,000
電通国際情報サービス	4,300	4,175.00	17,952,500
デジタルガレージ	12,700	4,375.00	55,562,500
E Mシステムズ	5,300	2,070.00	10,971,000
ウェザーニューズ	3,000	3,445.00	10,335,000
C I J	8,200	965.00	7,913,000
WOWOW	3,500	2,800.00	9,800,000
スカラ	6,400	775.00	4,960,000
I M A G I C A G R O U P	7,800	608.00	4,742,400
ネットワンシステムズ	26,500	2,664.00	70,596,000
アルゴグラフィックス	6,000	3,380.00	20,280,000
マーベラス	13,100	745.00	9,759,500
エイベックス	12,600	1,255.00	15,813,000
日本ユニシス	21,700	3,445.00	74,756,500
兼松エレクトロニクス	3,800	3,590.00	13,642,000
東京放送ホールディングス	42,300	1,911.00	80,835,300
日本テレビホールディングス	58,300	1,459.00	85,059,700
朝日放送グループホールディングス	10,800	778.00	8,402,400
テレビ朝日ホールディングス	19,700	2,068.00	40,739,600
スカパーJ S A Tホールディングス	47,000	480.00	22,560,000
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,480.00	14,880,000
ビジョン	6,700	1,738.00	11,644,600
コネクシオ	4,800	1,574.00	7,555,200
日本電信電話	461,800	5,671.00	2,618,867,800
K D D I	514,800	3,286.00	1,691,632,800
ソフトバンク	627,400	1,435.50	900,632,700
光通信	7,100	27,930.00	198,303,000
N T T ドコモ	510,100	3,065.00	1,563,456,500
エムティーアイ	9,100	741.00	6,743,100
G M O インターネット	27,500	2,127.00	58,492,500
K A D O K A W A	19,100	1,924.00	36,748,400
学研ホールディングス	2,500	7,460.00	18,650,000
ゼンリン	14,000	1,960.00	27,440,000
アイネット	4,700	1,546.00	7,266,200
松竹	4,600	16,380.00	75,348,000
東宝	41,500	4,510.00	187,165,000
東映	2,600	16,800.00	43,680,000
エヌ・ティ・ティ・データ	182,800	1,460.00	266,888,000
ピー・シー・エー	1,300	5,000.00	6,500,000
D T S	14,900	2,476.00	36,892,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,700	5,500.00	163,350,000

シーイーシー	7,700	2,137.00	16,454,900
カブコン	33,100	3,095.00	102,444,500
ジャステック	6,400	1,124.00	7,193,600
S C S K	16,000	5,700.00	91,200,000
日本システムウエア	2,600	2,466.00	6,411,600
アイネス	8,300	1,358.00	11,271,400
T K C	5,700	5,240.00	29,868,000
富士ソフト	9,000	4,275.00	38,475,000
N S D	11,400	3,650.00	41,610,000
コナミホールディングス	25,200	4,435.00	111,762,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	3,745.00	11,235,000
J B C Cホールディングス	5,600	1,884.00	10,550,400
ミロク情報サービス	6,300	3,430.00	21,609,000
ソフトバンクグループ	548,100	4,703.00	2,577,714,300
伊藤忠食品	1,900	5,370.00	10,203,000
エレマテック	8,100	1,159.00	9,387,900
J A L U X	2,700	2,520.00	6,804,000
あらた	5,600	4,585.00	25,676,000
東京エレクトロン デバイス	3,600	2,577.00	9,277,200
フィールズ	8,500	570.00	4,845,000
双日	378,200	358.00	135,395,600
アルフレッサ ホールディングス	76,500	2,283.00	174,649,500
横浜冷凍	20,700	1,010.00	20,907,000
アルコニックス	8,300	1,443.00	11,976,900
神戸物産	23,800	3,765.00	89,607,000
あい ホールディングス	10,500	1,996.00	20,958,000
ダイワボウホールディングス	5,900	6,510.00	38,409,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,900	1,944.00	32,853,600
ラクト・ジャパン	2,800	3,560.00	9,968,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,500	1,050.00	14,175,000
八洲電機	8,400	920.00	7,728,000
レスターホールディングス	7,400	1,982.00	14,666,800
ジュテックホールディングス	2,400	1,168.00	2,803,200
T O K A Iホールディングス	36,200	1,135.00	41,087,000
三洋貿易	4,100	2,476.00	10,151,600
ウイン・パートナーズ	5,600	1,527.00	8,551,200
シップヘルスケアホールディングス	11,200	5,020.00	56,224,000
コメダホールディングス	15,900	2,093.00	33,278,700
小野建	7,500	1,397.00	10,477,500
佐島電機	7,300	940.00	6,862,000
伯東	5,300	1,371.00	7,266,300
コンドーテック	5,800	1,156.00	6,704,800

ナガイレーベン	10,600	2,610.00	27,666,000
三菱食品	7,000	3,090.00	21,630,000
松田産業	5,800	1,623.00	9,413,400
第一興商	10,600	5,500.00	58,300,000
メディカルホールディングス	74,300	2,398.00	178,171,400
S P K	2,600	2,922.00	7,597,200
萩原電気ホールディングス	3,200	2,929.00	9,372,800
アズワン	4,600	10,010.00	46,046,000
尾家産業	3,600	1,443.00	5,194,800
シモジマ	6,100	1,254.00	7,649,400
ドウシシャ	6,800	1,817.00	12,355,600
高速	5,500	1,272.00	6,996,000
ハピネット	6,700	1,406.00	9,420,200
日本ライフライン	20,400	1,505.00	30,702,000
マルカ	3,300	2,388.00	7,880,400
I D O M	21,000	627.00	13,167,000
進和	4,700	2,486.00	11,684,200
ダイトロン	3,900	1,943.00	7,577,700
シークス	9,200	1,621.00	14,913,200
オーハシテクニカ	5,700	1,518.00	8,652,600
伊藤忠商事	484,900	2,545.00	1,234,070,500
丸紅	722,300	819.00	591,563,700
長瀬産業	39,000	1,655.00	64,545,000
蝶理	4,900	2,260.00	11,074,000
豊田通商	77,400	3,950.00	305,730,000
三共生興	15,000	595.00	8,925,000
兼松	24,900	1,484.00	36,951,600
三井物産	609,200	1,979.50	1,205,911,400
日本紙パルプ商事	4,100	4,285.00	17,568,500
日立ハイテクノロジーズ	24,100	7,740.00	186,534,000
カメイ	9,600	1,384.00	13,286,400
スターゼン	2,700	4,360.00	11,772,000
山善	26,100	1,107.00	28,892,700
椿本興業	1,600	4,160.00	6,656,000
住友商事	437,800	1,655.00	724,559,000
内田洋行	3,200	7,210.00	23,072,000
三菱商事	486,700	2,932.00	1,427,004,400
第一実業	3,800	3,845.00	14,611,000
キャノンマーケティングジャパン	20,300	2,602.00	52,820,600
西華産業	5,400	1,379.00	7,446,600
佐藤商事	7,700	991.00	7,630,700
菱洋エレクトロ	7,200	2,018.00	14,529,600

東京産業	9,100	615.00	5,596,500
ユアサ商事	6,200	3,720.00	23,064,000
神鋼商事	2,200	2,792.00	6,142,400
阪和興業	13,100	2,908.00	38,094,800
正栄食品工業	4,700	3,935.00	18,494,500
カナデン	7,000	1,393.00	9,751,000
菱電商事	6,100	1,666.00	10,162,600
フルサト工業	5,200	1,742.00	9,058,400
岩谷産業	15,600	3,760.00	58,656,000
極東貿易	3,200	2,271.00	7,267,200
イワキ	12,300	465.00	5,719,500
三愛石油	17,200	1,200.00	20,640,000
稲畑産業	14,300	1,663.00	23,780,900
明和産業	8,400	619.00	5,199,600
ワキタ	15,700	1,116.00	17,521,200
東邦ホールディングス	22,600	2,395.00	54,127,000
サンゲツ	19,000	2,126.00	40,394,000
ミツウロコグループホールディングス	10,700	1,414.00	15,129,800
シナネンホールディングス	3,900	1,940.00	7,566,000
伊藤忠エネクス	14,800	926.00	13,704,800
サンリオ	19,500	2,195.00	42,802,500
サンワテクノス	6,600	1,190.00	7,854,000
リョーサン	7,700	2,864.00	22,052,800
新光商事	11,700	879.00	10,284,300
トーホー	4,300	1,948.00	8,376,400
三信電気	4,400	1,787.00	7,862,800
東陽テクニカ	10,000	1,224.00	12,240,000
モスフードサービス	9,300	3,035.00	28,225,500
加賀電子	7,100	2,666.00	18,928,600
ソーダニッカ	10,500	632.00	6,636,000
立花エレテック	5,800	1,820.00	10,556,000
PALTAC	11,000	5,500.00	60,500,000
太平洋興発	6,600	818.00	5,398,800
西本Wismettacホールディングス	1,700	3,845.00	6,536,500
国際紙パルプ商事	20,500	308.00	6,314,000
ヤマタネ	4,800	1,568.00	7,526,400
日鉄物産	4,600	5,270.00	24,242,000
泉州電業	2,800	3,430.00	9,604,000
トラスコ中山	14,200	2,939.00	41,733,800
オートバックスセブン	26,100	1,743.00	45,492,300
モリト	7,700	807.00	6,213,900
加藤産業	10,600	3,710.00	39,326,000

イノテック	5,800	1,132.00	6,565,600
イエローハット	13,100	1,971.00	25,820,100
J Kホールディングス	9,300	673.00	6,258,900
日伝	6,600	2,135.00	14,091,000
杉本商事	4,700	2,061.00	9,686,700
因幡電機産業	19,400	2,804.00	54,397,600
東テク	2,800	2,651.00	7,422,800
ミスミグループ本社	86,700	2,684.00	232,702,800
タキヒヨー	2,800	1,965.00	5,502,000
スズケン	29,400	4,535.00	133,329,000
ジェコス	7,200	1,081.00	7,783,200
ローソン	17,700	6,260.00	110,802,000
サンエー	5,600	4,915.00	27,524,000
カワチ薬品	5,500	2,192.00	12,056,000
エービーシー・マート	10,800	7,500.00	81,000,000
アスクル	7,500	3,285.00	24,637,500
ゲオホールディングス	12,700	1,381.00	17,538,700
アダストリア	9,800	2,633.00	25,803,400
くら寿司	3,700	4,925.00	18,222,500
キャンドウ	5,000	1,649.00	8,245,000
パルグループホールディングス	3,700	3,595.00	13,301,500
エディオン	31,100	1,227.00	38,159,700
サーラコーポレーション	16,300	638.00	10,399,400
ハローズ	2,900	2,767.00	8,024,300
フジオフードシステム	3,400	3,620.00	12,308,000
あみやき亭	2,200	3,695.00	8,129,000
ひらまつ	20,500	294.00	6,027,000
大黒天物産	2,100	3,275.00	6,877,500
ハニーズホールディングス	7,100	1,616.00	11,473,600
アルペン	5,900	1,842.00	10,867,800
クオールホールディングス	10,600	1,536.00	16,281,600
ジーンズホールディングス	3,800	7,320.00	27,816,000
ビックカメラ	40,300	1,258.00	50,697,400
D C Mホールディングス	36,400	1,074.00	39,093,600
MonotaRO	49,400	2,805.00	138,567,000
DDホールディングス	3,300	1,522.00	5,022,600
アーランドサービスホールディングス	5,600	1,910.00	10,696,000
J . フロント リテイリング	82,700	1,476.00	122,065,200
ドトール・日レスホールディングス	10,500	2,166.00	22,743,000
マツモトキヨシホールディングス	28,400	4,285.00	121,694,000
ブロンコビリー	3,900	2,806.00	10,943,400
Z O Z O	48,000	2,101.00	100,848,000

物語コーポレーション	1,800	8,500.00	15,300,000
ココカラファイン	7,200	6,490.00	46,728,000
三越伊勢丹ホールディングス	121,400	1,006.00	122,128,400
H a m e e	2,800	1,342.00	3,757,600
ウエルシアホールディングス	20,600	6,760.00	139,256,000
クリエイトSDホールディングス	9,500	2,755.00	26,172,500
チムニー	3,000	2,311.00	6,933,000
シュッピン	5,900	1,186.00	6,997,400
ネクステージ	10,300	1,274.00	13,122,200
ジョイフル本田	20,400	1,450.00	29,580,000
鳥貴族	3,000	2,232.00	6,696,000
キリン堂ホールディングス	3,200	2,112.00	6,758,400
ホットランド	6,300	1,372.00	8,643,600
すかいらーくホールディングス	77,900	2,209.00	172,081,100
SFPホールディングス	3,700	2,247.00	8,313,900
綿半ホールディングス	3,100	1,930.00	5,983,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,500	967.00	17,889,500
B E E N O S	3,400	1,364.00	4,637,600
あさひ	6,200	1,313.00	8,140,600
日本調剤	2,300	3,760.00	8,648,000
コスモス薬品	3,100	22,550.00	69,905,000
セブン&アイ・ホールディングス	271,500	4,046.00	1,098,489,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,600	1,823.00	33,907,800
ツルハホールディングス	15,000	13,930.00	208,950,000
サンマルクホールディングス	5,400	2,334.00	12,603,600
トリドールホールディングス	8,700	2,698.00	23,472,600
T O K Y O B A S E	7,300	632.00	4,613,600
ジャパンミート	3,900	2,176.00	8,486,400
パロックジャパンリミテッド	6,700	957.00	6,411,900
クスリのアオキホールディングス	6,900	6,890.00	47,541,000
力の源ホールディングス	4,100	860.00	3,526,000
スシローグローバルホールディングス	7,600	8,860.00	67,336,000
L I X I L ビバ	7,000	2,004.00	14,028,000
メディカルシステムネットワーク	9,200	524.00	4,820,800
ノジマ	11,600	2,298.00	26,656,800
カッパ・クリエイト	10,200	1,499.00	15,289,800
良品計画	92,000	2,551.00	234,692,000
アドヴァン	11,300	1,323.00	14,949,900
アルビス	3,300	2,272.00	7,497,600
コナカ	15,200	423.00	6,429,600
G - 7ホールディングス	2,100	4,640.00	9,744,000

イオン北海道	8,400	790.00	6,636,000
コジマ	14,100	519.00	7,317,900
コーナン商事	9,400	2,592.00	24,364,800
エコス	3,300	1,729.00	5,705,700
ワタミ	9,000	1,305.00	11,745,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	166,000	1,861.00	308,926,000
西松屋チェーン	15,400	942.00	14,506,800
ゼンショーホールディングス	33,500	2,420.00	81,070,000
幸楽苑ホールディングス	5,200	2,041.00	10,613,200
サイゼリヤ	11,400	2,658.00	30,301,200
V Tホールディングス	30,100	485.00	14,598,500
フジ・コーポレーション	2,500	2,374.00	5,935,000
ユナイテッドアローズ	7,500	3,250.00	24,375,000
ハイデイ日高	9,600	2,180.00	20,928,000
コロワイド	23,900	2,203.00	52,651,700
ピーシーデポコーポレーション	11,800	555.00	6,549,000
壱番屋	4,900	5,490.00	26,901,000
スギホールディングス	13,900	6,160.00	85,624,000
薬王堂ホールディングス	3,200	2,497.00	7,990,400
ヴィア・ホールディングス	13,300	679.00	9,030,700
スクロール	15,800	361.00	5,703,800
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,678.00	19,549,400
ファミリーマート	55,500	2,659.00	147,574,500
木曾路	9,100	2,965.00	26,981,500
S R Sホールディングス	11,200	1,042.00	11,670,400
千趣会	17,800	514.00	9,149,200
ケーヨー	18,800	577.00	10,847,600
上新電機	8,000	2,641.00	21,128,000
日本瓦斯	11,200	3,620.00	40,544,000
ロイヤルホールディングス	11,800	2,535.00	29,913,000
いなげや	8,900	1,492.00	13,278,800
島忠	13,200	3,010.00	39,732,000
チヨダ	7,600	1,594.00	12,114,400
ライフコーポレーション	5,400	2,568.00	13,867,200
リンガーハット	8,800	2,513.00	22,114,400
Mr Max HD	12,500	503.00	6,287,500
A O K Iホールディングス	13,600	1,153.00	15,680,800
オークワ	11,000	1,407.00	15,477,000
コメリ	10,500	2,377.00	24,958,500
青山商事	14,600	1,571.00	22,936,600
しまむら	8,000	9,310.00	74,480,000
高島屋	51,600	1,264.00	65,222,400

松屋	14,900	890.00	13,261,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,000	1,288.00	42,504,000
近鉄百貨店	2,800	3,840.00	10,752,000
パルコ	7,200	1,355.00	9,756,000
丸井グループ	63,600	2,619.00	166,568,400
アクシアル リテイリング	5,600	3,975.00	22,260,000
イオン	266,400	2,274.00	605,793,600
イズミ	14,200	4,030.00	57,226,000
平和堂	13,600	2,098.00	28,532,800
フジ	8,500	1,986.00	16,881,000
ヤオコー	7,600	5,470.00	41,572,000
ゼビオホールディングス	8,800	1,356.00	11,932,800
ケーズホールディングス	67,100	1,437.00	96,422,700
Olympicグループ	6,300	644.00	4,057,200
日産東京販売ホールディングス	17,800	288.00	5,126,400
Genky DrugStores	3,700	2,374.00	8,783,800
総合メディカルホールディングス	6,300	2,012.00	12,675,600
ブックオフグループホールディングス	4,900	1,054.00	5,164,600
アインホールディングス	9,500	6,750.00	64,125,000
元気寿司	2,400	2,886.00	6,926,400
ヤマダ電機	210,500	575.00	121,037,500
アークランドサカモト	10,900	1,280.00	13,952,000
ニトリホールディングス	30,000	17,180.00	515,400,000
グルメ杵屋	6,200	1,221.00	7,570,200
吉野家ホールディングス	23,500	2,736.00	64,296,000
松屋フーズホールディングス	3,300	4,465.00	14,734,500
サガミホールディングス	9,800	1,381.00	13,533,800
関西スーパーマーケット	6,600	1,068.00	7,048,800
王将フードサービス	5,000	6,430.00	32,150,000
プレナス	7,800	1,928.00	15,038,400
ミニストップ	5,800	1,464.00	8,491,200
アークス	13,400	2,304.00	30,873,600
バローホールディングス	14,800	2,121.00	31,390,800
ベルク	3,200	5,540.00	17,728,000
大庄	5,200	1,650.00	8,580,000
ファーストリテイリング	9,300	66,420.00	617,706,000
サンドラッグ	26,000	3,975.00	103,350,000
サクスパー ホールディングス	8,300	936.00	7,768,800
ベルーナ	15,300	717.00	10,970,100
じもとホールディングス	59,100	111.00	6,560,100
めぶきフィナンシャルグループ	361,100	281.00	101,469,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,541.00	15,410,000

九州フィナンシャルグループ	112,600	481.00	54,160,600
ゆうちょ銀行	196,300	1,058.00	207,685,400
富山第一銀行	19,600	355.00	6,958,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	409,100	458.00	187,367,800
西日本フィナンシャルホールディングス	47,300	868.00	41,056,400
関西みらいフィナンシャルグループ	41,100	719.00	29,550,900
三十三フィナンシャルグループ	6,500	1,749.00	11,368,500
第四北越フィナンシャルグループ	12,100	3,060.00	37,026,000
新生銀行	50,800	1,670.00	84,836,000
あおぞら銀行	41,100	2,920.00	120,012,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,780,600	599.00	2,863,579,400
りそなホールディングス	760,700	484.50	368,559,150
三井住友トラスト・ホールディングス	131,100	4,405.00	577,495,500
三井住友フィナンシャルグループ	480,300	4,104.00	1,971,151,200
千葉銀行	238,200	635.00	151,257,000
群馬銀行	135,400	389.00	52,670,600
武蔵野銀行	10,600	1,926.00	20,415,600
千葉興業銀行	20,600	385.00	7,931,000
筑波銀行	30,800	244.00	7,515,200
七十七銀行	23,700	1,847.00	43,773,900
青森銀行	5,400	2,931.00	15,827,400
秋田銀行	5,200	2,258.00	11,741,600
山形銀行	8,700	1,642.00	14,285,400
岩手銀行	5,000	2,969.00	14,845,000
東邦銀行	60,000	278.00	16,680,000
東北銀行	4,000	1,054.00	4,216,000
みちのく銀行	5,000	1,530.00	7,650,000
ふくおかフィナンシャルグループ	58,300	2,126.00	123,945,800
静岡銀行	171,200	835.00	142,952,000
十六銀行	9,000	2,615.00	23,535,000
スルガ銀行	72,700	523.00	38,022,100
八十二銀行	166,800	495.00	82,566,000
山梨中央銀行	9,200	1,200.00	11,040,000
大垣共立銀行	13,700	2,431.00	33,304,700
福井銀行	5,900	1,917.00	11,310,300
北國銀行	7,600	3,710.00	28,196,000
清水銀行	2,900	2,190.00	6,351,000
富山銀行	1,600	2,463.00	3,940,800
滋賀銀行	13,700	2,757.00	37,770,900
南都銀行	11,900	2,794.00	33,248,600
百五銀行	64,700	356.00	23,033,200
京都銀行	24,700	4,775.00	117,942,500

紀陽銀行	24,500	1,660.00	40,670,000
ほくほくフィナンシャルグループ	46,800	1,140.00	53,352,000
広島銀行	101,200	542.00	54,850,400
山陰合同銀行	42,000	671.00	28,182,000
中国銀行	60,000	1,117.00	67,020,000
伊予銀行	97,600	617.00	60,219,200
百十四銀行	7,600	2,179.00	16,560,400
四国銀行	10,400	1,066.00	11,086,400
阿波銀行	11,400	2,572.00	29,320,800
大分銀行	4,200	2,802.00	11,768,400
宮崎銀行	4,500	2,745.00	12,352,500
佐賀銀行	4,700	1,826.00	8,582,200
沖縄銀行	6,500	3,735.00	24,277,500
琉球銀行	15,700	1,217.00	19,106,900
セブン銀行	235,600	353.00	83,166,800
みずほフィナンシャルグループ	9,433,600	170.20	1,605,598,720
山口フィナンシャルグループ	87,800	756.00	66,376,800
名古屋銀行	6,000	3,395.00	20,370,000
北洋銀行	108,300	248.00	26,858,400
愛知銀行	2,900	3,730.00	10,817,000
中京銀行	3,000	2,239.00	6,717,000
大光銀行	2,500	1,717.00	4,292,500
愛媛銀行	10,200	1,201.00	12,250,200
京葉銀行	30,800	645.00	19,866,000
栃木銀行	39,600	236.00	9,345,600
東和銀行	12,300	907.00	11,156,100
トモニホールディングス	57,600	428.00	24,652,800
フィデアホールディングス	73,000	138.00	10,074,000
池田泉州ホールディングス	78,200	217.00	16,969,400
F P G	22,800	1,029.00	23,461,200
S B I ホールディングス	77,700	2,295.00	178,321,500
ジャフコ	10,600	4,280.00	45,368,000
大和証券グループ本社	557,300	557.50	310,694,750
野村ホールディングス	1,223,100	562.00	687,382,200
岡三証券グループ	62,600	397.00	24,852,200
丸三証券	22,500	514.00	11,565,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,400	329.00	27,109,600
水戸証券	26,500	228.00	6,042,000
いちよし証券	13,600	652.00	8,867,200
松井証券	40,900	880.00	35,992,000
マネックスグループ	56,100	275.00	15,427,500
極東証券	11,100	755.00	8,380,500

岩井コスモホールディングス	8,000	1,277.00	10,216,000
藍澤證券	12,500	733.00	9,162,500
スパークス・グループ	30,000	263.00	7,890,000
かんぽ生命保険	24,900	1,891.00	47,085,900
S O M P Oホールディングス	130,600	4,391.00	573,464,600
アニコム ホールディングス	5,800	3,630.00	21,054,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	181,700	3,651.00	663,386,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	56,900	2,718.00	154,654,200
第一生命ホールディングス	393,100	1,854.50	729,003,950
東京海上ホールディングス	248,300	6,142.00	1,525,058,600
T & Dホールディングス	214,500	1,429.00	306,520,500
アドバンスクリエイト	1,500	1,897.00	2,845,500
全国保証	19,600	4,705.00	92,218,000
C a s a	3,000	1,422.00	4,266,000
アルヒ	11,200	2,289.00	25,636,800
プレミアグループ	4,000	2,307.00	9,228,000
クレディセゾン	48,900	1,868.00	91,345,200
芙蓉総合リース	7,300	7,370.00	53,801,000
みずほリース	10,900	3,450.00	37,605,000
東京センチュリー	14,000	5,790.00	81,060,000
日本証券金融	32,200	536.00	17,259,200
アイフル	111,700	240.00	26,808,000
リコーリース	5,800	4,050.00	23,490,000
イオンフィナンシャルサービス	42,500	1,704.00	72,420,000
アコム	138,800	488.00	67,734,400
ジャックス	7,800	2,737.00	21,348,600
オリエントコーポレーション	195,600	160.00	31,296,000
日立キャピタル	16,200	2,878.00	46,623,600
アプラスフィナンシャル	44,100	90.00	3,969,000
オリックス	434,300	1,828.00	793,900,400
三菱U F Jリース	176,200	721.00	127,040,200
日本取引所グループ	199,500	1,950.00	389,025,000
イー・ギャランティ	7,100	1,316.00	9,343,600
N E Cキャピタルソリューション	3,300	2,535.00	8,365,500
いちご	90,200	464.00	41,852,800
日本駐車場開発	85,300	160.00	13,648,000
スター・マイカ・ホールディングス	4,500	1,680.00	7,560,000
ヒューリック	149,000	1,339.00	199,511,000
三栄建築設計	4,000	1,616.00	6,464,000
野村不動産ホールディングス	42,200	2,654.00	111,998,800
三重交通グループホールディングス	18,000	624.00	11,232,000
サムティ	9,900	2,203.00	21,809,700

ディア・ライフ	10,300	565.00	5,819,500
日本商業開発	6,100	1,621.00	9,888,100
プレサンスコーポレーション	11,100	1,155.00	12,820,500
ユニゾホールディングス	10,800	4,900.00	52,920,000
日本管理センター	5,800	1,249.00	7,244,200
フージャースホールディングス	16,600	731.00	12,134,600
オープンハウス	20,100	3,185.00	64,018,500
東急不動産ホールディングス	188,200	775.00	145,855,000
飯田グループホールディングス	56,600	1,953.00	110,539,800
ムゲンエステート	8,200	810.00	6,642,000
ビーロッド	2,500	2,019.00	5,047,500
ハウズドゥ	4,800	1,492.00	7,161,600
ジェイ・エス・ビー	1,200	5,260.00	6,312,000
パーク24	37,700	2,563.00	96,625,100
パラカ	3,100	2,074.00	6,429,400
三井不動産	347,300	2,752.00	955,769,600
三菱地所	487,000	2,117.50	1,031,222,500
平和不動産	13,000	2,986.00	38,818,000
東京建物	77,000	1,706.00	131,362,000
ダイビル	18,400	1,224.00	22,521,600
京阪神ビルディング	12,100	1,453.00	17,581,300
住友不動産	156,500	3,882.00	607,533,000
テーオーシー	15,000	912.00	13,680,000
東京楽天地	1,700	6,400.00	10,880,000
スターツコーポレーション	9,200	2,774.00	25,520,800
フジ住宅	11,800	698.00	8,236,400
空港施設	13,300	555.00	7,381,500
ゴールドクレスト	5,900	2,114.00	12,472,600
エスリード	3,800	2,278.00	8,656,400
日神不動産	14,100	554.00	7,811,400
日本エスコン	14,100	999.00	14,085,900
タカラレーベン	33,500	515.00	17,252,500
サンヨーハウジング名古屋	7,000	1,050.00	7,350,000
イオンモール	35,700	1,921.00	68,579,700
ファースト住建	5,200	1,261.00	6,557,200
カチタス	8,800	4,925.00	43,340,000
トーセイ	9,900	1,510.00	14,949,000
サンフロンティア不動産	10,200	1,345.00	13,719,000
エフ・ジェー・ネクスト	7,800	1,140.00	8,892,000
ランドビジネス	7,400	749.00	5,542,600
日本空港ビルデング	22,400	6,140.00	137,536,000
日本工営	4,600	3,800.00	17,480,000

L I F U L L	24,800	555.00	13,764,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,000	2,015.00	10,075,000
日本M & Aセンター	50,900	3,625.00	184,512,500
メンバーズ	2,300	2,281.00	5,246,300
タケエイ	8,100	1,273.00	10,311,300
トラスト・テック	8,100	1,279.00	10,359,900
コシダカホールディングス	16,600	1,550.00	25,730,000
パソナグループ	8,400	1,603.00	13,465,200
リンクアンドモチベーション	16,300	618.00	10,073,400
G C A	9,800	968.00	9,486,400
エス・エム・エス	21,300	2,962.00	63,090,600
パーソルホールディングス	67,300	1,932.00	130,023,600
リニカル	4,700	1,109.00	5,212,300
クックパッド	28,300	361.00	10,216,300
学情	3,400	2,181.00	7,415,400
スタジオアリス	4,300	1,910.00	8,213,000
シミックホールディングス	4,700	1,873.00	8,803,100
総合警備保障	26,700	5,950.00	158,865,000
カカクコム	50,800	2,725.00	138,430,000
アイロムグループ	3,300	1,541.00	5,085,300
ルネサンス	4,900	1,719.00	8,423,100
ディップ	9,500	3,245.00	30,827,500
オプトホールディング	4,200	1,664.00	6,988,800
新日本科学	9,300	637.00	5,924,100
ツクイ	18,400	566.00	10,414,400
ベネフィット・ワン	18,100	2,221.00	40,200,100
エムスリー	148,300	3,150.00	467,145,000
アウトソーシング	38,300	1,198.00	45,883,400
ウェルネット	9,100	758.00	6,897,800
ワールドホールディングス	2,700	2,087.00	5,634,900
ディー・エヌ・エー	33,700	1,765.00	59,480,500
博報堂D Yホールディングス	93,000	1,737.00	161,541,000
ぐるなび	13,500	1,005.00	13,567,500
タカミヤ	9,400	697.00	6,551,800
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	1,114.00	6,238,400
ファンコミュニケーションズ	21,000	501.00	10,521,000
ライク	3,200	1,590.00	5,088,000
エスプール	14,200	752.00	10,678,400
W D Bホールディングス	3,300	2,555.00	8,431,500
バリューコマース	4,300	2,345.00	10,083,500
インフォマート	37,500	1,902.00	71,325,000
J Pホールディングス	27,200	323.00	8,785,600

E P S ホールディングス	10,700	1,460.00	15,622,000
プレステージ・インターナショナル	26,000	987.00	25,662,000
アミューズ	4,100	2,989.00	12,254,900
ドリームインキュベータ	3,100	1,582.00	4,904,200
クイック	4,900	1,668.00	8,173,200
ケネディクス	65,400	584.00	38,193,600
電通	69,200	3,785.00	261,922,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,260.00	4,284,000
ぴあ	2,100	4,860.00	10,206,000
イオンファンタジー	2,800	2,905.00	8,134,000
シーティーエス	9,000	801.00	7,209,000
ネクシィーズグループ	2,800	1,811.00	5,070,800
みらかホールディングス	19,400	2,663.00	51,662,200
アルプス技研	6,300	2,033.00	12,807,900
日本空調サービス	9,600	842.00	8,083,200
オリエンタルランド	71,500	14,875.00	1,063,562,500
ダスキン	17,400	3,035.00	52,809,000
明光ネットワークジャパン	10,100	1,023.00	10,332,300
ファルコホールディングス	5,100	1,791.00	9,134,100
ラウンドワン	19,300	1,070.00	20,651,000
リゾートトラスト	31,700	1,860.00	58,962,000
ビー・エム・エル	8,600	3,095.00	26,617,000
りらいあコミュニケーションズ	12,200	1,418.00	17,299,600
リソー教育	32,300	383.00	12,370,900
ユー・エス・エス	75,400	2,052.00	154,720,800
サイバーエージェント	39,000	3,820.00	148,980,000
楽天	313,900	934.00	293,182,600
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,117.00	5,026,500
テー・オー・ダブリュー	8,300	882.00	7,320,600
山田コンサルティンググループ	3,800	1,625.00	6,175,000
セントラルスポーツ	2,900	3,270.00	9,483,000
フルキャストホールディングス	6,600	2,371.00	15,648,600
エン・ジャパン	11,900	5,040.00	59,976,000
テクノプロ・ホールディングス	13,500	7,780.00	105,030,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	4,800.00	14,880,000
G u n o s y	5,300	1,533.00	8,124,900
イー・ガーディアン	3,600	1,994.00	7,178,400
ジャパンマテリアル	20,600	1,723.00	35,493,800
ベクトル	9,300	1,036.00	9,634,800
チャーム・ケア・コーポレーション	2,500	1,939.00	4,847,500
I B J	5,600	1,086.00	6,081,600
アサンテ	3,700	2,040.00	7,548,000

N・フィールド	7,000	658.00	4,606,000
バリューHR	1,700	3,600.00	6,120,000
M&Aキャピタルパートナーズ	4,800	4,120.00	19,776,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	2,024.00	7,488,800
シグマクシス	5,000	2,234.00	11,170,000
ウィルグループ	5,100	1,189.00	6,063,900
リクルートホールディングス	481,700	4,086.00	1,968,226,200
エラン	4,400	1,606.00	7,066,400
日本郵政	551,600	1,025.50	565,665,800
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,707.00	19,801,200
鎌倉新書	5,400	1,666.00	8,996,400
LITALICO	2,900	2,284.00	6,623,600
エボラブルアジア	3,500	2,064.00	7,224,000
アトラエ	2,000	3,495.00	6,990,000
ストライク	2,600	4,325.00	11,245,000
ソラスト	18,900	1,234.00	23,322,600
インソース	3,500	3,485.00	12,197,500
ベिकाレント・コンサルティング	4,200	5,410.00	22,722,000
グレイステクノロジー	3,300	2,682.00	8,850,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,300	2,661.00	19,425,300
グリーンズ	4,300	1,170.00	5,031,000
日総工産	5,200	1,035.00	5,382,000
キュービーネットホールディングス	4,700	2,367.00	11,124,900
RPAホールディングス	4,400	1,125.00	4,950,000
スプリックス	3,100	1,125.00	3,487,500
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	1,110.00	5,217,000
リログループ	36,800	2,884.00	106,131,200
東祥	4,800	2,509.00	12,043,200
エイチ・アイ・エス	10,600	3,165.00	33,549,000
共立メンテナンス	11,000	5,060.00	55,660,000
イチネンホールディングス	8,300	1,607.00	13,338,100
建設技術研究所	5,600	2,163.00	12,112,800
燦ホールディングス	4,400	1,469.00	6,463,600
東京テアトル	4,700	1,419.00	6,669,300
ナガワ	2,100	8,030.00	16,863,000
よみうりランド	2,100	4,650.00	9,765,000
東京都競馬	4,600	3,440.00	15,824,000
常磐興産	4,900	1,660.00	8,134,000
カナモト	11,100	2,949.00	32,733,900
東京ドーム	28,200	1,056.00	29,779,200
西尾レントオール	6,800	3,140.00	21,352,000
トランス・コスモス	6,400	2,987.00	19,116,800

乃村工藝社	28,800	1,437.00	41,385,600
藤田観光	3,700	2,907.00	10,755,900
KNT-CTホールディングス	4,800	1,490.00	7,152,000
日本管財	6,400	1,969.00	12,601,600
トーカイ	6,600	2,977.00	19,648,200
セコム	71,300	9,822.00	700,308,600
セントラル警備保障	3,300	6,120.00	20,196,000
丹青社	13,100	1,279.00	16,754,900
メイテック	8,500	6,090.00	51,765,000
応用地質	7,900	1,489.00	11,763,100
船井総研ホールディングス	13,700	2,496.00	34,195,200
オオバ	8,200	894.00	7,330,800
ベネッセホールディングス	22,700	2,898.00	65,784,600
イオンディライト	8,100	3,920.00	31,752,000
ナック	6,000	990.00	5,940,000
ニチイ学館	9,900	1,558.00	15,424,200
ダイセキ	11,300	3,185.00	35,990,500
合計	81,710,400		172,541,837,010

(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<適格機関投資家限定>

貸借対照表

（単位：円）

	（平成30年12月19日現在）	（令和1年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	12,115	-
コール・ローン	-	1,031,200
親投資信託受益証券	28,583,031,599	33,021,924,325
未収入金	12,279,998	18,979,999
流動資産合計	28,595,323,712	33,041,935,524
資産合計	28,595,323,712	33,041,935,524
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,279,998	19,999,999
未払受託者報酬	3,929,903	4,330,060
未払委託者報酬	3,929,838	4,329,993
未払利息	-	2

	（平成30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
その他未払費用	486,018	495,000
流動負債合計	20,625,757	29,155,054
負債合計	20,625,757	29,155,054
純資産の部		
元本等		
元本	22,091,971,252	25,096,141,206
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,482,726,703	7,916,639,264
元本等合計	28,574,697,955	33,012,780,470
純資産合計	28,574,697,955	33,012,780,470
負債純資産合計	28,595,323,712	33,041,935,524

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 6月21日 至 令和 1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30年12月19日現在）	（令和 1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	22,091,971,252口	25,096,141,206口
2. 1単位当たり純資産の額	1.2934円 (10,000口当たりの純資産額 12,934円)	1.3155円 (10,000口当たりの純資産額 13,155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 令和 1年 6月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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 令和 1年 6月21日 至 令和 1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30年12月19日現在)	(令和 1年12月19日現在)
期首元本額	24,238,325,216円	23,899,072,188円
期中追加設定元本額	803,281,399円	2,465,467,896円
期中一部解約元本額	2,949,635,363円	1,268,398,878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	23,230,337,197	33,021,924,325	
	合計	23,230,337,197	33,021,924,325	

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30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	932,416,950	-
コール・ローン	-	350,040,541
国債証券	79,792,307,440	94,597,186,170
地方債証券	8,442,696,120	8,120,458,000
特殊債券	10,391,503,954	9,167,183,410
社債券	4,919,717,000	5,629,784,000
未収利息	348,738,695	335,298,356
前払費用	4,674,191	5,495,084
流動資産合計	104,832,054,350	118,205,445,561
資産合計	104,832,054,350	118,205,445,561
負債の部		

	(平成30年12月19日現在)	(令和1年12月19日現在)
流動負債		
未払解約金	171,167,585	66,258,941
未払利息	-	925
その他未払費用	17,333	-
流動負債合計	171,184,918	66,259,866
負債合計	171,184,918	66,259,866
純資産の部		
元本等		
元本	74,925,630,281	83,107,699,652
剰余金		
剰余金又は欠損金()	29,735,239,151	35,031,486,043
元本等合計	104,660,869,432	118,139,185,695
純資産合計	104,660,869,432	118,139,185,695
負債純資産合計	104,832,054,350	118,205,445,561

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年 6月21日 至 令和 1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30年12月19日現在)	(令和1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	74,925,630,281口	83,107,699,652口
2. 1単位当たり純資産の額	1.3969円 (10,000口当たりの純資産額 13,969円)	1.4215円 (10,000口当たりの純資産額 14,215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 令和 1年 6月21日 至 令和 1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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 令和 1年 6月21日 至 令和 1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

(令和 1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	80,135,880,996円
同期中における追加設定元本額	8,123,166,576円
同期中における一部解約元本額	5,151,347,920円
令和 1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	54,207,515,698円
三井住友D S・国内債券インデックス年金ファンド	699,155円
S M A M・国内債券インデックス・ファンド	5,592,977,136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>	76,170,466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>	23,230,337,197円
合計	83,107,699,652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396回利付国債(2年)	20,000,000	20,047,400	
	第400回利付国債(2年)	370,000,000	371,110,000	
	第402回利付国債(2年)	300,000,000	301,008,000	
	第404回利付国債(2年)	200,000,000	200,730,000	
	第405回利付国債(2年)	420,000,000	421,608,600	
	第406回利付国債(2年)	1,690,000,000	1,696,776,900	

第127回利付国債(5年)	1,195,000,000	1,198,429,650	
第128回利付国債(5年)	655,000,000	657,109,100	
第129回利付国債(5年)	405,000,000	406,526,850	
第130回利付国債(5年)	440,000,000	441,848,000	
第131回利付国債(5年)	955,000,000	959,622,200	
第132回利付国債(5年)	275,000,000	276,479,500	
第133回利付国債(5年)	450,000,000	452,794,500	
第134回利付国債(5年)	830,000,000	835,494,600	
第135回利付国債(5年)	750,000,000	755,497,500	
第136回利付国債(5年)	850,000,000	856,715,000	
第137回利付国債(5年)	200,000,000	201,618,000	
第138回利付国債(5年)	750,000,000	756,172,500	
第139回利付国債(5年)	650,000,000	655,538,000	
第140回利付国債(5年)	730,000,000	736,424,000	
第141回利付国債(5年)	1,040,000,000	1,049,672,000	
第2回利付国債(40年)	132,000,000	197,573,640	
第3回利付国債(40年)	150,000,000	226,207,500	
第4回利付国債(40年)	205,000,000	312,260,100	
第5回利付国債(40年)	222,000,000	328,138,200	
第6回利付国債(40年)	215,000,000	313,777,450	
第7回利付国債(40年)	243,000,000	341,752,770	
第8回利付国債(40年)	290,000,000	382,539,000	
第9回利付国債(40年)	406,000,000	402,179,540	
第10回利付国債(40年)	403,000,000	468,318,240	
第11回利付国債(40年)	325,000,000	366,905,500	
第12回利付国債(40年)	210,000,000	214,935,000	
第313回利付国債(10年)	220,000,000	223,927,000	
第315回利付国債(10年)	1,165,000,000	1,188,078,650	
第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,123,441,000	
第319回利付国債(10年)	590,000,000	604,248,500	
第320回利付国債(10年)	575,000,000	587,730,500	
第321回利付国債(10年)	395,000,000	404,871,050	
第322回利付国債(10年)	460,000,000	470,460,400	
第323回利付国債(10年)	295,000,000	302,463,500	
第324回利付国債(10年)	545,000,000	557,426,000	
第325回利付国債(10年)	345,000,000	353,659,500	

第326回利付国債(10年)	620,000,000	635,115,600	
第327回利付国債(10年)	570,000,000	585,612,300	
第328回利付国債(10年)	900,000,000	920,970,000	
第329回利付国債(10年)	850,000,000	877,319,000	
第330回利付国債(10年)	560,000,000	579,079,200	
第332回利付国債(10年)	595,000,000	611,844,450	
第333回利付国債(10年)	330,000,000	339,923,100	
第334回利付国債(10年)	345,000,000	355,912,350	
第335回利付国債(10年)	95,000,000	97,720,800	
第336回利付国債(10年)	115,000,000	118,496,000	
第337回利付国債(10年)	305,000,000	311,206,750	
第338回利付国債(10年)	607,000,000	623,170,480	
第339回利付国債(10年)	615,000,000	632,170,800	
第340回利付国債(10年)	883,000,000	908,527,530	
第341回利付国債(10年)	715,000,000	732,260,100	
第342回利付国債(10年)	960,000,000	972,067,200	
第343回利付国債(10年)	957,000,000	969,201,750	
第344回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,246,285,200	
第345回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,018,808,700	
第346回利付国債(10年)	670,000,000	679,775,300	
第347回利付国債(10年)	945,000,000	958,910,400	
第348回利付国債(10年)	995,000,000	1,009,745,900	
第349回利付国債(10年)	635,000,000	644,461,500	
第350回利付国債(10年)	885,000,000	897,850,200	
第351回利付国債(10年)	930,000,000	943,113,000	
第352回利付国債(10年)	865,000,000	876,781,300	
第353回利付国債(10年)	870,000,000	881,397,000	
第354回利付国債(10年)	920,000,000	931,086,000	
第355回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,173,247,200	
第356回利付国債(10年)	660,000,000	667,081,800	
第2回利付国債(30年)	150,000,000	186,610,500	
第4回利付国債(30年)	160,000,000	209,969,600	
第5回利付国債(30年)	100,000,000	124,400,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	229,257,000	
第10回利付国債(30年)	230,000,000	259,897,700	
第11回利付国債(30年)	150,000,000	181,722,000	

第12回利付国債(30年)	230,000,000	291,603,200	
第14回利付国債(30年)	220,000,000	289,852,200	
第15回利付国債(30年)	250,000,000	334,075,000	
第16回利付国債(30年)	175,000,000	234,687,250	
第18回利付国債(30年)	160,000,000	211,116,800	
第19回利付国債(30年)	160,000,000	211,782,400	
第21回利付国債(30年)	102,000,000	135,840,540	
第22回利付国債(30年)	149,000,000	203,726,210	
第23回利付国債(30年)	151,000,000	207,129,720	
第24回利付国債(30年)	135,000,000	185,776,200	
第25回利付国債(30年)	185,000,000	249,076,600	
第26回利付国債(30年)	219,000,000	299,322,630	
第27回利付国債(30年)	206,000,000	286,727,280	
第28回利付国債(30年)	271,000,000	379,055,830	
第29回利付国債(30年)	170,000,000	236,097,700	
第30回利付国債(30年)	270,000,000	371,979,000	
第31回利付国債(30年)	277,000,000	378,307,210	
第32回利付国債(30年)	347,000,000	483,617,370	
第33回利付国債(30年)	380,000,000	509,675,000	
第34回利付国債(30年)	379,000,000	526,506,800	
第35回利付国債(30年)	430,000,000	582,826,300	
第36回利付国債(30年)	255,000,000	347,213,100	
第37回利付国債(30年)	405,000,000	545,324,400	
第38回利付国債(30年)	280,000,000	372,078,000	
第39回利付国債(30年)	195,000,000	264,067,050	
第40回利付国債(30年)	210,000,000	280,148,400	
第41回利付国債(30年)	240,000,000	315,223,200	
第42回利付国債(30年)	230,000,000	302,778,900	
第43回利付国債(30年)	250,000,000	329,497,500	
第44回利付国債(30年)	267,000,000	352,715,010	
第45回利付国債(30年)	322,000,000	410,427,640	
第46回利付国債(30年)	365,000,000	466,152,450	
第47回利付国債(30年)	305,000,000	397,503,450	
第48回利付国債(30年)	305,000,000	382,909,200	
第49回利付国債(30年)	305,000,000	383,604,600	
第50回利付国債(30年)	340,000,000	376,777,800	

第5 1 回利付国債(30年)	337,000,000	330,907,040	
第5 2 回利付国債(30年)	407,000,000	419,877,480	
第5 3 回利付国債(30年)	262,000,000	277,130,500	
第5 4 回利付国債(30年)	140,000,000	155,283,800	
第5 5 回利付国債(30年)	280,000,000	310,825,200	
第5 6 回利付国債(30年)	325,000,000	360,623,250	
第5 7 回利付国債(30年)	295,000,000	327,181,550	
第5 8 回利付国債(30年)	530,000,000	587,526,200	
第5 9 回利付国債(30年)	280,000,000	303,038,400	
第6 0 回利付国債(30年)	330,000,000	374,962,500	
第6 1 回利付国債(30年)	320,000,000	346,294,400	
第6 2 回利付国債(30年)	185,000,000	190,091,200	
第6 3 回利付国債(30年)	355,000,000	354,531,400	
第6 4 回利付国債(30年)	255,000,000	254,321,700	
第5 0 回利付国債(20年)	223,000,000	228,675,350	
第5 2 回利付国債(20年)	210,000,000	218,171,100	
第5 4 回利付国債(20年)	275,000,000	287,732,500	
第5 6 回利付国債(20年)	320,000,000	336,915,200	
第5 8 回利付国債(20年)	300,000,000	316,635,000	
第5 9 回利付国債(20年)	280,000,000	295,251,600	
第6 1 回利付国債(20年)	140,000,000	145,086,200	
第6 3 回利付国債(20年)	156,000,000	166,464,480	
第6 4 回利付国債(20年)	210,000,000	225,852,900	
第6 5 回利付国債(20年)	370,000,000	399,796,100	
第6 9 回利付国債(20年)	200,000,000	218,764,000	
第7 0 回利付国債(20年)	380,000,000	422,833,600	
第7 2 回利付国債(20年)	300,000,000	331,425,000	
第7 4 回利付国債(20年)	278,000,000	308,732,900	
第7 5 回利付国債(20年)	230,000,000	256,686,900	
第7 8 回利付国債(20年)	340,000,000	377,597,200	
第8 2 回利付国債(20年)	288,000,000	324,552,960	
第8 4 回利付国債(20年)	424,000,000	477,602,080	
第8 5 回利付国債(20年)	332,000,000	377,792,760	
第8 8 回利付国債(20年)	329,000,000	380,399,670	
第9 0 回利付国債(20年)	418,000,000	483,011,540	
第9 2 回利付国債(20年)	295,000,000	340,509,650	

第93回利付国債(20年)	242,000,000	278,992,120	
第95回利付国債(20年)	186,000,000	219,559,980	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	471,308,000	
第99回利付国債(20年)	337,000,000	396,150,240	
第100回利付国債(20年)	310,000,000	368,366,800	
第102回利付国債(20年)	285,000,000	344,887,050	
第105回利付国債(20年)	337,000,000	400,679,520	
第107回利付国債(20年)	418,000,000	498,795,220	
第109回利付国債(20年)	315,000,000	371,369,250	
第111回利付国債(20年)	393,000,000	476,029,110	
第113回利付国債(20年)	395,000,000	476,575,400	
第114回利付国債(20年)	323,000,000	391,023,800	
第116回利付国債(20年)	320,000,000	391,932,800	
第118回利付国債(20年)	245,000,000	295,977,150	
第119回利付国債(20年)	260,000,000	308,646,000	
第121回利付国債(20年)	200,000,000	240,206,000	
第122回利付国債(20年)	225,000,000	267,819,750	
第123回利付国債(20年)	205,000,000	251,385,350	
第124回利付国債(20年)	230,000,000	279,523,600	
第125回利付国債(20年)	155,000,000	192,376,700	
第126回利付国債(20年)	185,000,000	225,470,600	
第127回利付国債(20年)	190,000,000	229,438,300	
第128回利付国債(20年)	220,000,000	266,378,200	
第129回利付国債(20年)	210,000,000	251,871,900	
第130回利付国債(20年)	340,000,000	409,030,200	
第131回利付国債(20年)	225,000,000	268,056,000	
第132回利付国債(20年)	270,000,000	322,371,900	
第133回利付国債(20年)	205,000,000	247,203,350	
第134回利付国債(20年)	163,000,000	197,120,790	
第135回利付国債(20年)	325,000,000	389,086,750	
第136回利付国債(20年)	205,000,000	242,937,300	
第137回利付国債(20年)	210,000,000	252,098,700	
第138回利付国債(20年)	150,000,000	176,358,000	
第139回利付国債(20年)	160,000,000	190,094,400	
第140回利付国債(20年)	540,000,000	649,593,000	
第141回利付国債(20年)	190,000,000	229,159,000	

	第142回利付国債(20年)	180,000,000	219,409,200	
	第143回利付国債(20年)	200,000,000	239,062,000	
	第144回利付国債(20年)	295,000,000	348,763,750	
	第145回利付国債(20年)	332,000,000	402,211,360	
	第146回利付国債(20年)	330,000,000	400,530,900	
	第147回利付国債(20年)	530,000,000	637,123,600	
	第148回利付国債(20年)	382,000,000	454,881,780	
	第149回利付国債(20年)	377,000,000	449,538,570	
	第150回利付国債(20年)	485,000,000	572,489,150	
	第151回利付国債(20年)	595,000,000	685,642,300	
	第152回利付国債(20年)	530,000,000	611,577,600	
	第153回利付国債(20年)	432,000,000	505,712,160	
	第154回利付国債(20年)	515,000,000	595,911,650	
	第155回利付国債(20年)	310,000,000	349,261,500	
	第156回利付国債(20年)	590,000,000	608,567,300	
	第157回利付国債(20年)	443,000,000	442,291,200	
	第158回利付国債(20年)	455,000,000	476,348,600	
	第159回利付国債(20年)	363,000,000	385,919,820	
	第160回利付国債(20年)	460,000,000	496,685,000	
	第161回利付国債(20年)	475,000,000	504,559,250	
	第162回利付国債(20年)	415,000,000	440,435,350	
	第163回利付国債(20年)	495,000,000	525,294,000	
	第164回利付国債(20年)	455,000,000	474,433,050	
	第165回利付国債(20年)	500,000,000	521,175,000	
	第166回利付国債(20年)	390,000,000	420,303,000	
	第167回利付国債(20年)	525,000,000	546,325,500	
	第168回利付国債(20年)	295,000,000	301,463,450	
	第169回利付国債(20年)	460,000,000	461,274,200	
	第170回利付国債(20年)	390,000,000	390,725,400	
	国債証券合計	85,940,000,000	94,597,186,170	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	210,632,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,265,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	134,623,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	263,588,000	
	平成26年度第13回北海道公募公債	100,000,000	102,109,000	
	平成29年度第5回北海道公募公債	100,000,000	100,937,000	

平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	200,000,000	199,944,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	231,436,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	99,950,000	
第192回神奈川県公募公債	200,000,000	204,338,000	
第147回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	99,936,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,279,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,332,000	
第397回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,955,000	
平成27年度第11回京都府公募公債	200,000,000	205,196,000	
平成30年度第6回京都府公募公債	200,000,000	200,066,000	
平成30年度第12回京都府公募公債	300,000,000	299,985,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,817,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	110,480,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	120,977,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	134,110,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	112,379,000	
平成26年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,461,000	
平成26年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,563,000	
平成26年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,184,000	
平成29年度第16回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,706,000	
平成26年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,893,000	
平成30年度第2回広島県公募公債	200,000,000	201,966,000	
第13回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,117,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	102,565,000	
平成26年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,881,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,968,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,817,000	
平成26年度第5回福岡県公募公債	200,000,000	204,942,000	
平成26年度第3回千葉県公募公債	300,000,000	308,202,000	
平成26年度第5回千葉県公募公債	200,000,000	204,520,000	
令和元年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	99,966,000	
第11回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,411,000	
第9回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,265,000	
第115回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,678,000	

	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,571,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,411,000	
	第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,696,000	
	第154回共同発行市場公募地方債	150,000,000	153,330,000	
	第175回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,502,000	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	102,110,000	
	平成28年度第2回神戸市公募公債(5年)	100,000,000	99,983,000	
	第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,850,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	205,078,000	
	平成27年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,639,000	
	平成27年度第7回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,090,000	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,183,000	
	平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,576,000	
地方債証券合計		7,750,000,000	8,120,458,000	
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	101,799,920	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,024,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,792,000	
	第29回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	301,017,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	500,000,000	500,195,000	
	第42回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,279,000	
	第66回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,157,000	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,185,000	
	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	204,666,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	308,146,000	
	第27回道路債券	100,000,000	110,147,000	
	第32回道路債券	100,000,000	111,470,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,614,000	
	第42回道路債券	100,000,000	111,283,000	
	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	119,038,000	
	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	119,858,000	
	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	121,100,000	

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	100,838,000	
第122回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,718,000	
第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,948,000	
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	205,662,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,097,000	
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	308,808,000	
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,450,000	
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	307,875,000	
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,974,000	
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	101,285,000	
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	101,589,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	200,000,000	202,246,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	215,452,000	
第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,597,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,282,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	233,660,000	
第39回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,117,000	
第48回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	112,385,000	
第59回地方公共団体金融機構債券(10年)	100,000,000	103,025,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,005,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,355,000	
F281回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	109,657,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	110,754,000	
第208回政府保証預金保険機構債	400,000,000	400,540,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,865,000	12,058,518	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,117,000	14,684,503	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,047,000	12,278,181	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	12,445,000	12,722,274	

第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,528,000	14,073,990	
第 1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,097,000	10,126,281	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	13,959,000	14,526,433	
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,844,000	10,959,813	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,718,000	13,932,137	
第 1 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,687,000	10,814,709	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,858,000	31,066,214	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,417,000	12,706,440	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,780,000	15,281,189	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,119,000	30,023,781	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,424,000	16,060,394	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,584,000	15,150,296	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,909,000	32,732,631	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,884,000	16,678,994	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,732,000	14,407,614	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,801,000	14,463,586	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,220,000	33,169,064	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,457,000	36,524,420	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,249,000	47,864,392	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,084,000	45,603,121	
第 5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,981,000	46,549,490	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,264,000	52,490,695	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,032,000	53,797,934	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,804,000	47,042,407	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,502,000	53,276,074	
第 8 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,331,000	56,360,262	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,590,000	87,317,356	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,519,000	91,754,584	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,422,000	91,403,982	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,839,000	91,822,786	
第 1 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,834,000	
第 1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,904,000	93,814,459	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,967,000	97,593,640	
第 1 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,585,000	97,929,409	
第 1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,655,000	

	第190回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,032,000	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,951,000	15,626,486	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,827,000	15,533,951	
	い第776号商工債	100,000,000	100,037,000	
	第304回信金中金債(5年)	200,000,000	200,108,000	
	第350回信金中金債(5年)	100,000,000	100,205,000	
特殊債券合計		8,637,343,000	9,167,183,410	
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	100,484,000	
	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	100,078,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,095,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,703,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,795,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,629,000	
	第47回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,008,000	
	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	100,546,000	
	第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	200,764,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,984,000	
	第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,428,000	
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,079,000	
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,916,000	
	第35回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	99,364,000	
	第1回明治安田生命2019基金特定目的会社 特定社債	200,000,000	199,738,000	
	第51回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,050,000	
	第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,763,000	
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社 債	100,000,000	101,068,000	
	第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	106,103,000	
	株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保 社債	100,000,000	101,901,000	
	第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,124,000	
	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	102,201,000	
	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	198,442,000	

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	99,823,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	119,401,000	
第73回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,313,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,259,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,433,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,906,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,696,000	
第126回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	200,874,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,136,000	
第13回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,174,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,042,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,487,000	
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,012,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,762,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,663,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,223,000	
第527回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,144,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,662,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,804,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,878,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,678,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,241,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,753,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,445,000	
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	100,729,000	
社債券合計	5,500,000,000	5,629,784,000	
合計		117,514,611,580	

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30年12月20日現在）	（令和 1年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	7,633,446	-
コール・ローン	-	5,357,053
親投資信託受益証券	6,626,914,656	5,374,883,196
未収入金	4,709,996	105,999,993
流動資産合計	6,639,258,098	5,486,240,242
資産合計	6,639,258,098	5,486,240,242
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,000,000	105,999,993
未払受託者報酬	229,894	161,234
未払委託者報酬	83,591	58,623
未払利息	-	11
その他未払費用	37,589	34,344
流動負債合計	7,351,074	106,254,205
負債合計	7,351,074	106,254,205
純資産の部		
元本等		
元本	2,681,112,051	1,756,426,596
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,950,794,973	3,623,559,441
元本等合計	6,631,907,024	5,379,986,037
純資産合計	6,631,907,024	5,379,986,037
負債純資産合計	6,639,258,098	5,486,240,242

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年12月 3日 至 令和 1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30年12月20日現在)	(令和1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	2,681,112,051口	1,756,426,596口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.4736円 (10,000口当たりの純資産額 24,736円)	1口当たり純資産額 3.0630円 (10,000口当たりの純資産額 30,630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 令和1年12月3日 至 令和1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</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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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30年12月20日現在）	（令和 1年12月20日現在）
期首元本額	2,743,356,764円	1,823,431,400円
期中追加設定元本額	1,181,763円	7,521,185円
期中一部解約元本額	63,426,476円	74,525,989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	1,357,945,276	5,374,883,196	
合計		1,357,945,276	5,374,883,196	

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30年12月20日現在）	（令和 1年12月20日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	4,869,179,041	2,214,806,030
金銭信託	362,014,577	-
コール・ローン	-	490,877,806
株式	150,004,951,721	223,120,935,311
投資証券	3,808,307,309	5,985,657,908
派生商品評価勘定	13,500	20,155,782
未収入金	294,572	25,237,760
未収配当金	226,067,457	266,462,672
前払金	190,471,766	-
差入委託証拠金	1,305,643,097	1,785,383,172
流動資産合計	160,766,943,040	233,909,516,441
資産合計	160,766,943,040	233,909,516,441
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	190,543,766	1,866,137
前受金	-	16,273,452
未払解約金	256,367,437	1,218,003,446
未払利息	-	1,075
その他未払費用	4,849	-
流動負債合計	446,916,052	1,236,144,110
負債合計	446,916,052	1,236,144,110
純資産の部		
元本等		
元本	50,208,278,643	58,783,501,160
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	110,111,748,345	173,889,871,171
元本等合計	160,320,026,988	232,673,372,331
純資産合計	160,320,026,988	232,673,372,331
負債純資産合計	160,766,943,040	233,909,516,441

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 令和 1年12月 3日 至 令和 1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	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年12月20日現在）	（令和 1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	50,208,278,643口	58,783,501,160口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1931円 (10,000口当たりの純資産額 31,931円)	1口当たり純資産額 3.9581円 (10,000口当たりの純資産額 39,581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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	(令和 1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（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,844,002,855	-	6,653,531,089	190,471,766
	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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	182,990,700	-	182,927,300	63,400
	米ドル	151,958,700	-	151,888,500	70,200
	ユーロ	28,190,800	-	28,197,400	6,600
	英ポンド	2,841,200	-	2,841,400	200
	売建	33,656,400	-	33,651,500	4,900
	カナダドル	9,181,700	-	9,179,500	2,200
	スイスフラン	10,179,900	-	10,181,700	1,800
	スウェーデンクローナ	2,599,800	-	2,599,800	-
	ノルウェークローネ	774,600	-	774,000	600

	デンマーククローネ	1,887,600	-	1,887,600	-
	オーストラリアドル	4,007,000	-	4,006,000	1,000
	香港ドル	3,307,400	-	3,305,100	2,300
	シンガポールドル	820,200	-	820,200	-
	イスラエルシケル	898,200	-	897,600	600
	合計	7,060,649,955	-	6,870,109,889	190,530,266

(令和 1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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,098,888,130	-	3,115,161,582	16,273,452
	SPMINI 2003	2,233,643,029	-	2,249,320,518	15,677,489
	DJ EUR 2003	531,658,858	-	530,454,225	1,204,633
	FTSE 2003	179,766,328	-	182,102,619	2,336,291
	SPI200 2003	153,819,915	-	153,284,220	535,695
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,246,338,093	-	1,244,321,900	2,016,193
	米ドル	885,296,700	-	883,925,000	1,371,700
	カナダドル	43,418,000	-	43,342,000	76,000
	ユーロ	144,971,400	-	144,799,200	172,200
	英ポンド	72,960,600	-	72,598,500	362,100
	スイスフラン	41,362,300	-	41,377,100	14,800
	スウェーデンクローナ	12,214,260	-	12,201,000	13,260
	ノルウェークローネ	2,800,852	-	2,803,700	2,848
	デンマーククローネ	8,312,711	-	8,302,800	9,911
	オーストラリアドル	10,557,400	-	10,560,200	2,800
	ニュージーランドドル	1,445,100	-	1,446,200	1,100

香港ドル	15,324,170	-	15,292,700	31,470
シンガポールドル	4,849,800	-	4,844,800	5,000
イスラエルシケル	2,824,800	-	2,828,700	3,900
合計	4,345,226,223	-	4,359,483,482	18,289,645

(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 令和 1年12月 3日 至 令和 1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

(令和 1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	59,882,488,969円
同期中における追加設定元本額	287,252,005円
同期中における一部解約元本額	1,386,239,814円
令和 1年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	24,336,953,896円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	301,137,243円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	1,213,946,084円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	826,837,007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)	91,731,306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)	2,007,875円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	8,293,096円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	22,516,922円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	47,391,289円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	35,288,406円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	82,537,664円
外国株式指数ファンド	496,161,522円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	4,829,045,214円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	423,391,950円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	433,567,863円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	333,900,241円
イオン・バランス戦略ファンド	26,094,693円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	6,927,966円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	40,326,412円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,791,359円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	104,402,937円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	55,110,441円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	68,014,502円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	18,551,710円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	279,841円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	26,000円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	40,491円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	55,524円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,357,945,276円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,952,192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>	72,668,568円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,323,228,465円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,353,616,607円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,735,982,578円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	18,941,206円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	95,650,142円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	399,172円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	702,415,493円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	57,718,254円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	158,440,162円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	721,136,946円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	578,126,789円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,393,327,351円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	756,356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)	302,316,725円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	119,615,749円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	15,120,829円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,963,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,417,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	38,957,048円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	98,587,084円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	126,441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>	754,366,214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>	122,846,414円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,417,838,642円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	238,115,684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>	3,893,763,433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>	9,954,579円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	48,073,673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>	30,843,765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>	255,958,869円
合計	58,783,501,160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	APACHE CORPORATION	19,062	22.71	432,898.02	
	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	24.97	798,390.78	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	17.01	333,940.32	
	CHENIERE ENERGY INC	11,747	61.48	722,205.56	
	CHEVRON CORPORATION	97,751	118.13	11,547,325.63	
	CONCHO RESOURCES INC	10,172	82.45	838,681.40	
	CONOCOPHILLIPS	57,162	63.19	3,612,066.78	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	33.92	153,827.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,054	25.11	528,665.94	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	87.48	693,978.84	
	EOG RESOURCES INC	29,883	81.25	2,427,993.75	
	EXXON MOBIL CORPORATION	217,863	69.39	15,117,513.57	
	HALLIBURTON CO	44,317	24.48	1,084,880.16	
	HESS CORPORATION	14,506	63.69	923,887.14	
	HOLLYFRONTIER CORP	9,418	50.95	479,847.10	
	KINDER MORGAN INC	104,909	20.84	2,186,303.56	
	MARATHON OIL CORP	47,030	13.18	619,855.40	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	33,599	61.13	2,053,906.87	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,156	24.34	539,277.04	
	NOBLE ENERGY INC	26,757	23.35	624,775.95	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	45,362	38.70	1,755,509.40	
	ONEOK INC	20,930	73.98	1,548,401.40	
	PHILLIPS 66	23,021	112.81	2,596,999.01	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,540	147.21	1,257,173.40	
	SCHLUMBERGER LTD	70,022	39.61	2,773,571.42	
	TARGA RESOURCES CORP	11,788	39.17	461,735.96	
	TECHNIPFMC PLC	21,584	20.48	442,040.32	
	VALERO ENERGY CORP	21,157	94.59	2,001,240.63	
	WILLIAMS COS INC	61,445	23.50	1,443,957.50	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,470	233.06	2,673,198.20	
	ALBEMARLE CORPORATION	6,316	69.45	438,646.20	
	AMCOR PLC	82,302	10.80	888,861.60	
	AVERY DENNISON CORP	4,859	131.95	641,145.05	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	30.20	380,218.00		
BALL CORPORATION	16,125	63.72	1,027,485.00		
CELANESE CORPORATION	6,420	122.48	786,321.60		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	46.38	556,652.76		
CORTEVA INC	38,111	27.71	1,056,055.81		
CROWN HOLDINGS INC	6,863	70.69	485,145.47		

DOW INC	37,971	54.52	2,070,178.92
DUPONT DE NEMOURS INC	38,111	63.95	2,437,198.45
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	79.91	561,527.57
ECOLAB INC	13,335	191.78	2,557,386.30
FMC CORPORATION	6,676	98.37	656,718.12
FREEMONT-MCMORAN INC	69,858	13.00	908,154.00
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	45.97	879,865.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	123.34	600,789.14
LINDE PLC	27,913	209.40	5,844,982.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,240	95.33	1,357,499.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,381	272.96	922,877.76
MOSAIC CO/THE	18,584	20.60	382,830.40
NEWMONT GOLD CORP CORPORATION	41,561	40.88	1,699,013.68
NUCOR CORP	15,455	56.53	873,671.15
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,339	111.67	596,206.13
PPG INDUSTRIES INC	11,972	132.42	1,585,332.24
RPM INTERNATIONAL INC	7,603	74.68	567,792.04
SEALED AIR CORP	7,895	39.85	314,615.75
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,196	577.85	2,424,658.60
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	34.59	352,506.69
VULCAN MATERIALS CO	6,698	141.71	949,173.58
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	69.38	102,335.50
WESTROCK CO	13,034	42.24	550,556.16
3M COMPANY	30,005	172.15	5,165,360.75
ACUITY BRANDS INC	1,884	136.48	257,128.32
AERCAP HOLDINGS NV	5,726	61.46	351,919.96
ALLEGION PLC	4,764	123.68	589,211.52
AMETEK INC	12,190	99.56	1,213,636.40
ARCONIC INC	19,024	31.00	589,744.00
BOEING CO	27,343	333.50	9,118,890.50
CATERPILLAR INC	28,968	145.02	4,200,939.36
CUMMINS INC	7,944	179.30	1,424,359.20
DEERE & CO	15,270	172.76	2,638,045.20
DOVER CORP	7,949	113.47	901,973.03
EATON CORP PLC	21,454	94.24	2,021,824.96
EMERSON ELECTRIC CO	30,851	76.09	2,347,452.59
FASTENAL COMPANY	29,021	36.79	1,067,827.69
FLUOR CORP	6,650	49.06	326,249.00
FORTIVE CORP	16,143	76.65	1,237,360.95
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	65.26	420,927.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,293	178.65	2,196,144.45
GENERAL ELECTRIC CO	455,110	11.04	5,024,414.40

HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	40.01	311,557.87
HEICO CORP	1,888	115.62	218,290.56
HEICO CORP-CLASS A	4,435	89.62	397,464.70
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,695	176.50	6,476,667.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	254.24	535,683.68
IDEX CORP	3,839	168.00	644,952.00
ILLINOIS TOOL WORKS	16,656	178.46	2,972,429.76
INGERSOLL-RAND PLC	12,228	133.55	1,633,049.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	88.54	613,316.58
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	55.05	633,075.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	13,100	30.56	400,336.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,358	40.76	1,644,992.08
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,862	197.41	2,341,677.42
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,030	238.36	483,870.80
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,031	383.15	4,992,827.65
MASCO CORP	14,885	47.17	702,125.45
MIDDLEBY CORP	2,823	111.36	314,369.28
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,277	342.21	2,832,472.17
OWENS CORNING	6,518	65.47	426,733.46
PACCAR INC	17,567	79.69	1,399,914.23
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,505	206.27	1,341,786.35
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	45.45	373,599.00
RAYTHEON COMPANY	14,342	216.11	3,099,449.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,002	202.84	1,217,445.68
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,265	351.98	1,853,174.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,506	53.59	509,426.54
SMITH(A.O.) CORP	7,157	47.35	338,883.95
SNAP-ON INC	3,221	167.75	540,322.75
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	75.32	386,918.84
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,684	165.87	1,274,545.08
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,070	339.89	703,572.30
TEXTRON INC	11,803	44.67	527,240.01
TRANSDIGM GROUP INC	2,427	574.96	1,395,427.92
UNITED RENTALS INC	4,233	165.69	701,365.77
UNITED TECHNOLOGIES CORP	42,561	148.71	6,329,246.31
WABCO HOLDINGS INC	2,598	135.30	351,509.40
WABTEC CORP	9,231	76.10	702,479.10
WW GRAINGER INC	2,390	334.84	800,267.60
XYLEM INC	9,124	77.59	707,931.16
CINTAS CORP	4,507	268.01	1,207,921.07
COPART INC	10,456	89.40	934,766.40
COSTAR GROUP INC	1,853	591.53	1,096,105.09

EQUIFAX INC	6,127	137.78	844,178.06
IHS MARKIT LTD	19,257	74.73	1,439,075.61
MANPOWERGROUP	3,264	95.88	312,952.32
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	20.09	362,142.34
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	88.81	1,013,766.15
ROBERT HALF INTL INC	7,058	61.95	437,243.10
ROLLINS INC	6,451	32.75	211,270.25
TRANSUNION	9,497	85.32	810,284.04
VERISK ANALYTICS INC	7,884	148.19	1,168,329.96
WASTE CONNECTIONS INC	13,371	90.02	1,203,657.42
WASTE MANAGEMENT INC	21,844	112.48	2,457,013.12
AMERCO	390	371.12	144,736.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	28.55	162,049.80
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	76.73	531,355.25
CSX CORPORATION	38,979	72.59	2,829,485.61
DELTA AIR LINES INC	8,299	59.14	490,802.86
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,513	76.56	728,315.28
FEDEX CORP	12,944	147.02	1,903,026.88
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	115.52	509,558.72
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	153.04	780,504.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	8,325	35.77	297,785.25
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,486	191.92	2,588,233.12
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,284	185.85	610,331.40
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	54.08	341,569.28
UBER TECHNOLOGIES INC	9,385	29.99	281,456.15
UNION PACIFIC CORP	35,924	177.47	6,375,432.28
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	89.22	256,953.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,377	118.56	4,312,857.12
XPO LOGISTICS INC	4,716	78.21	368,838.36
APTIV PLC	13,074	97.85	1,279,290.90
AUTOLIV INC	4,001	86.46	345,926.46
BORGWARNER INC	12,075	44.90	542,167.50
FORD MOTOR COMPANY	198,706	9.41	1,869,823.46
GENERAL MOTORS CO	66,284	37.26	2,469,741.84
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	37.36	274,483.92
LEAR CORP	3,525	141.58	499,069.50
TESLA INC	6,743	404.04	2,724,441.72
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	38.41	239,255.89
D.R.HORTON INC	19,074	52.35	998,523.90
GARMIN LTD	6,739	97.64	657,995.96
HANESBRANDS INC	22,204	14.51	322,180.04
HASBRO INC	7,338	104.38	765,940.44

LEGETT & PLATT INC	6,656	51.26	341,186.56
LENNAR CORP-CL A	15,664	55.24	865,279.36
LULULEMON ATHLETICA INC	5,615	224.13	1,258,489.95
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	136.02	389,425.26
NEWELL BRANDS INC	18,477	18.95	350,139.15
NIKE INC -CL B	65,251	101.15	6,600,138.65
NVR INC	173	3,705.49	641,049.77
POLARIS INC	2,467	98.97	244,158.99
PULTE GROUP INC	13,065	38.60	504,309.00
PVH CORP	3,303	104.66	345,691.98
RALPH LAUREN CORPORATION	3,315	117.53	389,611.95
TAPESTRY INC	14,712	26.39	388,249.68
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	21.16	182,695.44
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	19.01	157,611.91
VF CORP	17,117	96.90	1,658,637.30
WHIRLPOOL CORP	3,212	143.90	462,206.80
ARAMARK	13,242	43.70	578,675.40
CARNIVAL CORP	21,372	46.65	997,003.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,405	833.92	1,171,657.60
DARDEN RESTAURANTS INC	6,722	109.03	732,899.66
DOMINO'S PIZZA INC	2,219	292.00	647,948.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,021	110.34	1,547,077.14
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	69.18	1,219,920.12
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,352	150.04	2,153,374.08
MCDONALD'S CORPORATION	39,104	197.06	7,705,834.24
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	9,858	24.33	239,845.14
MGM MIRAGE	25,878	33.26	860,702.28
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,922	55.34	604,423.48
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	126.85	1,146,216.60
STARBUCKS CORP	60,931	88.52	5,393,612.12
VAIL RESORTS INC	2,038	245.05	499,411.90
WYNN RESORTS LTD	4,913	139.84	687,033.92
YUM! BRANDS INC	15,515	99.82	1,548,707.30
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,495	59.13	2,335,339.35
ALPHABET INC-CL A	15,423	1,356.44	20,920,374.12
ALPHABET INC-CL C	16,143	1,356.04	21,890,553.72
ALTICE USA INC-A	6,300	26.95	169,785.00
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,985	475.67	3,798,224.95
COMCAST CORP-CLASS A	233,539	43.64	10,191,641.96
DISCOVERY INC-A	7,075	32.76	231,777.00
DISCOVERY INC-C	18,283	30.39	555,620.37
DISH NETWORK CORP.	12,937	35.80	463,144.60

ELECTRONIC ARTS INC	15,073	107.34	1,617,935.82
FACEBOOK INC-A	124,174	206.06	25,587,294.44
FOX CORPORATION-CLASS A	19,769	37.00	731,453.00
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	36.05	316,266.65
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	238.41	947,441.34
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	22.79	447,276.54
LIBERTY BROADBAND-C	5,418	122.59	664,192.62
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	22.77	191,996.64
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	21.79	459,311.41
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	46.17	474,996.96
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	47.30	361,750.40
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	47.69	197,484.29
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	69.83	524,562.96
MATCH GROUP INC	3,732	77.35	288,670.20
NETFLIX INC	22,692	332.22	7,538,736.24
NEWS CORP-CLASS A	16,662	13.92	231,935.04
OMNICOM GROUP	11,898	79.61	947,199.78
PINTEREST INC- CLASS A	10,948	19.09	208,997.32
ROKU INC	4,624	137.73	636,863.52
SIRIUS XM HOLDINGS INC	81,768	7.08	578,917.44
SNAP INC-A	35,102	15.46	542,676.92
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	121.82	695,226.74
THE WALT DISNEY CO.	92,755	146.15	13,556,143.25
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	30.34	122,907.34
TWITTER INC	37,026	32.03	1,185,942.78
VIACOMCBS INC	30,377	41.95	1,274,315.15
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	44.94	239,080.80
ADVANCE AUTO PARTS	4,057	156.48	634,839.36
AMAZON.COM INC	21,650	1,792.28	38,802,862.00
AUTOZONE INC	1,248	1,219.08	1,521,411.84
BEST BUY COMPANY INC	13,082	88.64	1,159,588.48
BOOKING HOLDINGS INC	2,157	2,003.12	4,320,729.84
BURLINGTON STORES INC	3,749	227.49	852,860.01
CARMAX INC	8,427	98.79	832,503.33
DOLLAR GENERAL CORP	13,099	157.00	2,056,543.00
DOLLAR TREE INC	12,047	92.10	1,109,528.70
EBAY INC	41,983	36.04	1,513,067.32
EXPEDIA GROUP INC	7,538	109.10	822,395.80
GAP INC/THE	9,218	17.80	164,080.40
GENUINE PARTS CO	7,406	105.19	779,037.14
GRUBHUB INC	4,403	48.50	213,545.50
HOME DEPOT INC	56,390	220.22	12,418,205.80

KOHL'S CORP	8,274	50.48	417,671.52
LKQ CORPORATION	15,922	35.75	569,211.50
LOWE'S COMPANIES INC	39,957	120.21	4,803,230.97
MERCADOLIBRE INC	2,251	582.55	1,311,320.05
NORDSTROM INC	4,756	40.74	193,759.44
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,969	442.65	1,756,877.85
ROSS STORES INC	18,632	115.16	2,145,661.12
TARGET CORP	26,308	128.70	3,385,839.60
TIFFANY & CO	5,541	133.45	739,446.45
TJX COMPANIES INC	62,529	60.25	3,767,372.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	91.81	561,601.77
ULTA BEAUTY INC	3,061	250.69	767,362.09
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	85.81	247,733.47
COSTCO WHOLESALE CORP	22,816	293.71	6,701,287.36
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	5.74	77,490.00
KROGER CO	40,905	28.76	1,176,427.80
SYSCO CORP	25,103	84.49	2,120,952.47
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,407	57.75	2,275,754.25
WALMART INC	73,496	120.08	8,825,399.68
ALTRIA GROUP INC	97,572	50.79	4,955,681.88
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	45.64	1,296,358.56
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	65.36	1,020,923.20
BUNGE LIMITED	7,174	55.98	401,600.52
CAMPBELL SOUP CO	7,879	48.22	379,925.38
COCA-COLA CO/THE	208,020	54.32	11,299,646.40
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	10,663	50.01	533,256.63
CONAGRA BRANDS INC	24,639	33.66	829,348.74
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,611	185.82	1,600,096.02
GENERAL MILLS INC	31,074	53.20	1,653,136.80
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	44.70	667,773.30
INGREDION INC	3,320	90.65	300,958.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	104.51	602,813.68
KELLOGG CO	12,949	66.78	864,734.22
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	31.90	1,084,887.10
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	84.20	624,511.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,209	168.31	1,045,036.79
MOLSON COORS BREWING COMPANY	9,629	53.25	512,744.25
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	75,167	55.15	4,145,460.05
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	20,672	63.47	1,312,051.84
PEPSICO INC	72,524	136.47	9,897,350.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	80,763	85.99	6,944,810.37
THE HERSHEY COMPANY	7,514	146.67	1,102,078.38

TYSON FOODS INC-CL A	14,949	89.74	1,341,523.26
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	69.49	867,582.65
CLOROX COMPANY	6,458	151.48	978,257.84
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	41,705	68.34	2,850,119.70
COTY INC-CL A	16,985	11.47	194,817.95
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,391	204.29	2,327,067.39
KIMBERLY-CLARK CORP	17,723	136.74	2,423,443.02
PROCTER & GAMBLE CO	128,862	124.92	16,097,441.04
ABBOTT LABORATORIES	91,005	87.35	7,949,286.75
ABIOMED INC	2,288	169.43	387,655.84
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	273.75	1,055,032.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	83.80	669,813.40
ANTHEM INC	13,172	298.22	3,928,153.84
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,576	82.22	2,020,638.72
BECTON DICKINSON & CO	14,104	267.87	3,778,038.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,882	44.83	3,222,470.06
CARDINAL HEALTH INC	15,114	50.61	764,919.54
CENTENE CORP	20,961	61.87	1,296,857.07
CERNER CORP	16,501	71.96	1,187,411.96
CIGNA CORPORATION	19,443	198.72	3,863,712.96
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,509	319.67	802,052.03
CVS HEALTH CORPORATION	67,717	74.10	5,017,829.70
DANAHER CORP	32,183	150.44	4,841,610.52
DAVITA INC	5,115	73.75	377,231.25
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	57.47	681,824.08
DEXCOM INC	4,617	216.33	998,795.61
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,573	233.22	2,465,835.06
HCA HEALTHCARE INC	13,886	145.39	2,018,885.54
HENRY SCHEIN INC	7,559	69.06	522,024.54
HOLOGIC INC	13,592	52.23	709,910.16
HUMANA INC.	6,956	365.60	2,543,113.60
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	256.19	1,117,244.59
INSULET CORP	3,486	170.53	594,467.58
INTUITIVE SURGICAL INC	5,934	588.71	3,493,405.14
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	169.10	844,654.50
MCKESSON CORP	9,632	135.61	1,306,195.52
MEDTRONIC PLC	68,636	113.49	7,789,499.64
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	107.99	735,843.86
RESMED INC	7,271	156.04	1,134,566.84
STERIS PLC	4,287	148.39	636,147.93
STRYKER CORP	17,576	208.08	3,657,214.08
TELEFLEX INC	2,340	373.41	873,779.40

UNITEDHEALTH GROUP INC	48,797	294.62	14,376,572.14
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	144.03	605,358.09
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,195	141.86	736,962.70
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,481	139.77	905,849.37
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,551	326.93	833,998.43
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,260	149.44	636,614.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,385	148.80	1,545,288.00
ABBVIE INC	76,817	88.77	6,819,045.09
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,023	84.51	1,354,103.73
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,370	111.24	1,264,798.80
ALLERGAN PLC	16,559	189.61	3,139,751.99
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	117.85	661,492.05
AMGEN INC	30,615	241.84	7,403,931.60
BEIGENE LTD-ADR	1,977	168.47	333,065.19
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,328	360.02	478,106.56
BIOGEN INC	9,497	297.58	2,826,117.26
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	84.99	771,709.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,721	62.85	7,587,314.85
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,964	28.95	520,057.80
ELI LILLY & CO	44,740	130.85	5,854,229.00
EXACT SCIENCES CORP	8,404	95.92	806,111.68
GILEAD SCIENCES INC	66,294	65.29	4,328,335.26
ILLUMINA INC	7,454	325.20	2,424,040.80
INCYTE CORP	9,243	91.14	842,407.02
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	61.58	416,280.80
IQVIA HOLDINGS INC	8,501	149.69	1,272,514.69
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	152.27	396,511.08
JOHNSON & JOHNSON	135,893	145.35	19,752,047.55
MERCK & CO. INC.	131,835	89.99	11,863,831.65
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	786.59	989,530.22
MYLAN NV	26,138	19.38	506,554.44
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,068	106.25	538,475.00
PERKINELMER INC	5,624	95.70	538,216.80
PERRIGO CO PLC	7,737	54.46	421,357.02
PFIZER INC	283,170	38.97	11,035,134.90
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,097	372.55	1,526,337.35
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	125.31	479,686.68
SEATTLE GENETICS INC	5,726	114.84	657,573.84
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	56,969	9.97	567,980.93
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,776	323.25	6,715,842.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,196	217.78	2,873,824.88
WATERS CORP	3,523	231.87	816,878.01

ZOETIS INC	24,590	128.74	3,165,716.60
BANK OF AMERICA CORP	453,515	34.95	15,850,349.25
CITIGROUP INC	115,504	78.20	9,032,412.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,242	40.31	936,885.02
COMERICA INC	7,691	71.56	550,367.96
EAST WEST BANCORP INC	8,825	48.85	431,101.25
FIFTH THIRD BANCORP	37,239	31.00	1,154,409.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,184	117.43	1,078,477.12
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	15.16	804,419.92
JPMORGAN CHASE & CO	164,641	137.35	22,613,441.35
KEYCORP	51,128	20.22	1,033,808.16
M & T BANK CORP	6,581	168.40	1,108,240.40
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	16.90	341,380.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,533	159.53	3,594,689.49
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	55,875	17.30	966,637.50
SIGNATURE BANK	2,508	135.15	338,956.20
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	250.12	660,316.80
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	67,981	56.14	3,816,453.34
US BANCORP	77,084	60.01	4,625,810.84
WELLS FARGO & COMPANY	214,370	53.63	11,496,663.10
ZIONS BANCORPORATION	8,874	51.49	456,922.26
ALLY FINANCIAL INC	20,139	31.36	631,559.04
AMERICAN EXPRESS COMPANY	36,312	124.83	4,532,826.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,790	167.28	1,135,831.20
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	24.97	569,815.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	43,698	50.85	2,222,043.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	67,536	225.21	15,209,782.56
BLACKROCK INC	5,969	502.34	2,998,467.46
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,057	55.75	1,898,677.75
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,172	103.38	2,498,901.36
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	117.56	665,507.16
CME GROUP INC.	18,686	204.72	3,825,397.92
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,415	86.32	1,416,942.80
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	12,407	45.93	569,853.51
EATON VANCE CORP	5,530	47.20	261,016.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	269.82	523,180.98
FRANKLIN RESOURCES INC	17,818	26.14	465,762.52
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,970	229.94	3,902,081.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,592	93.49	2,673,066.08
INVESCO LIMITED	18,328	18.43	337,785.04
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	21.28	274,192.80
KKR & CO INC -A	24,824	29.78	739,258.72

MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	377.57	721,913.84
MOODY'S CORP	8,653	238.20	2,061,144.60
MORGAN STANLEY	63,976	50.86	3,253,819.36
MSCI INC-A	4,294	259.78	1,115,495.32
NASDAQ INC	6,566	107.02	702,693.32
NORTHERN TRUST CORP	10,486	107.17	1,123,784.62
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	91.05	585,087.30
S&P GLOBAL INC	12,894	272.48	3,513,357.12
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,925	48.20	2,936,585.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,655	66.97	512,655.35
STATE STREET CORP	18,922	79.64	1,506,948.08
SYNCHRONY FINANCIAL	31,458	36.44	1,146,329.52
T ROWE PRICE GROUP INC	11,991	122.52	1,469,137.32
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	50.08	702,522.24
VOYA FINANCIAL INC	7,308	61.54	449,734.32
AFLAC INC	37,801	52.99	2,003,074.99
ALLEGHANY CORPORATION	805	801.48	645,191.40
ALLSTATE CORP	16,891	111.21	1,878,448.11
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	110.70	391,767.30
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,792	51.93	2,326,048.56
AON PLC	12,196	209.73	2,557,867.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	42.43	868,796.68
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	95.31	895,342.14
ASSURANT INC	3,114	131.60	409,802.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	47.31	387,894.69
BROWN & BROWN INC	14,075	39.52	556,244.00
CHUBB LTD	23,926	154.50	3,696,567.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	103.29	811,652.82
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	168.79	217,401.52
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	275.55	569,010.75
FNF GROUP	13,937	45.53	634,551.61
GLOBE LIFE INC	5,900	105.76	623,984.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	60.78	1,114,158.18
LINCOLN NATIONAL CORP	11,217	60.13	674,478.21
LOEWS CORPORATION	13,914	51.17	711,979.38
MARKEL CORP	702	1,141.68	801,459.36
MARSH & MCLENNAN COS	25,929	112.21	2,909,493.09
METLIFE INC	40,962	50.80	2,080,869.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	55.10	778,232.40
PROGRESSIVE CORP	29,612	71.11	2,105,709.32
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,587	94.24	1,940,118.88
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	164.18	496,151.96

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	197.79	442,851.81
TRAVELERS COS INC(THE)	13,281	136.47	1,812,458.07
UNUM GROUP	9,769	29.34	286,622.46
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	68.74	510,600.72
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,553	203.85	1,335,829.05
CBRE GROUP INC-A	16,199	59.82	969,024.18
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,818	139.92	3,052,774.56
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.61	293,403.00
JONES LANG LASALLE INC	2,618	170.62	446,683.16
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,743	238.15	1,367,695.45
ACCENTURE PLC-CL A	33,117	208.30	6,898,271.10
ADOBE INC	24,996	327.63	8,189,439.48
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	84.51	703,207.71
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	110.08	244,597.76
ANSYS INC	4,256	255.75	1,088,472.00
AUTODESK INC	11,164	183.78	2,051,719.92
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,344	168.74	3,770,326.56
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	8,792	63.08	554,599.36
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,163	70.86	578,430.18
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	122.54	721,638.06
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	69.68	992,940.00
CDK GLOBAL INC	7,488	54.94	411,390.72
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,244	112.68	703,573.92
CITRIX SYSTEMS INC	6,676	111.82	746,510.32
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,867	62.71	1,810,249.57
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,311	121.29	280,301.19
DOCUSIGN INC	5,401	73.38	396,325.38
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	18.16	191,860.40
DXC TECHNOLOGY CO	11,825	37.76	446,512.00
EPAM SYSTEMS INC	3,084	211.17	651,248.28
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	32,001	138.08	4,418,698.08
FISERV INC	29,748	116.50	3,465,642.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	288.87	1,262,650.77
FORTINET INC	7,360	109.53	806,140.80
GARTNER INC	4,568	154.23	704,522.64
GLOBAL PAYMENTS INC	15,100	183.39	2,769,189.00
GODADDY INC - CLASS A	8,905	68.48	609,814.40
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,792	106.77	511,641.84
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,010	134.56	6,191,105.60
INTUIT INC	13,151	264.05	3,472,521.55
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	146.09	571,942.35
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	96.28	668,857.16

MASTERCARD INC-CL A	46,275	297.53	13,768,200.75
MICROSOFT CORP	373,418	155.71	58,144,916.78
MONGODB INC	1,890	130.96	247,514.40
NORTONLIFELOCK INC	31,347	26.02	815,648.94
OKTA INC	5,270	115.75	610,002.50
ORACLE CORPORATION	120,235	53.24	6,401,311.40
PALO ALTO NETWORKS INC	4,867	229.10	1,115,029.70
PAYCHEX INC	16,401	85.00	1,394,085.00
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	261.76	660,158.72
PAYPAL HOLDINGS INC	57,971	108.88	6,311,882.48
PTC INC	5,462	74.48	406,809.76
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,101	167.49	686,876.49
SABRE CORP	13,930	22.71	316,350.30
SALESFORCE.COM, INC.	43,147	163.33	7,047,199.51
SERVICENOW INC	9,653	278.48	2,688,167.44
SPLUNK INC	7,614	150.14	1,143,165.96
SQUARE INC-A	17,051	64.55	1,100,642.05
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	60.97	703,959.62
SYNOPSYS INC	7,601	139.50	1,060,339.50
TWILIO INC-A	5,649	99.88	564,222.12
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,223	296.43	658,963.89
VERISIGN INC	5,439	190.20	1,034,497.80
VISA INC	88,923	186.54	16,587,696.42
VMWARE INC	4,194	148.68	623,563.92
WESTERN UNION COMPANY	21,840	27.17	593,392.80
WIX.COM LTD	2,419	121.16	293,086.04
WORKDAY INC-CLASS A	8,894	161.57	1,437,003.58
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,148	107.05	1,621,593.40
APPLE INC	232,469	280.02	65,095,969.38
ARISTA NETWORKS INC	2,720	203.75	554,200.00
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	84.43	348,695.90
CDW CORP/DE	7,404	142.25	1,053,219.00
CISCO SYSTEMS INC	220,418	47.88	10,553,613.84
COGNEX CORP	8,698	56.14	488,305.72
CORNING INC	39,793	28.92	1,150,813.56
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,900	49.89	394,131.00
F5 NETWORKS INC	3,504	143.69	503,489.76
FLEX LTD	23,204	12.80	297,011.20
FLIR SYSTEMS INC	6,867	52.42	360,002.47
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	67,905	15.74	1,068,824.70
HP INC	76,380	20.30	1,550,514.00
IPG PHOTONICS CORP	1,776	146.29	259,811.04

JUNIPER NETWORKS INC	17,460	24.43	426,547.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	103.86	991,032.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,356	161.11	1,346,235.16
NETAPP INC	12,523	63.23	791,829.29
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	58.45	738,457.30
TE CONNECTIVITY LTD	17,082	95.41	1,629,793.62
TRIMBLE INC	12,759	40.94	522,353.46
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	58.77	873,145.89
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	37.03	359,079.91
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	253.13	692,816.81
AT&T INC	376,243	38.93	14,647,139.99
CENTURYLINK INC	49,758	13.33	663,274.14
SPRINT CORP	36,740	5.29	194,354.60
T-MOBILE US INC	17,328	77.22	1,338,068.16
VERIZON COMMUNICATIONS INC	212,966	60.80	12,948,332.80
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,946	34.56	412,853.76
AES CORPORATION	33,656	19.55	657,974.80
ALLIANT ENERGY CORP	13,283	54.22	720,204.26
AMEREN CORPORATION	12,454	75.45	939,654.30
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,748	93.97	2,325,569.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	121.66	1,113,675.64
AQUA AMERICA INC	12,653	46.12	583,556.36
ATMOS ENERGY CORP	6,436	110.81	713,173.16
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	26.78	681,925.92
CMS ENERGY CORPORATION	15,038	62.40	938,371.20
CONSOLIDATED EDISON INC	16,392	89.70	1,470,362.40
DOMINION ENERGY INC	42,205	81.80	3,452,369.00
DTE ENERGY COMPANY	9,290	129.66	1,204,541.40
DUKE ENERGY CORP	37,518	89.95	3,374,744.10
EDISON INTERNATIONAL	17,941	73.42	1,317,228.22
ENERGY CORP	10,703	119.51	1,279,115.53
EVERGY INC	12,378	63.70	788,478.60
EVERSOURCE ENERGY	17,595	83.78	1,474,109.10
EXELON CORP	49,234	44.98	2,214,545.32
FIRSTENERGY CORP	26,948	48.71	1,312,637.08
NEXTERA ENERGY INC	24,938	240.65	6,001,329.70
NISOURCE INC	18,919	27.61	522,353.59
NRG ENERGY INC	13,547	40.31	546,079.57
OGE ENERGY CORP	11,680	44.17	515,905.60
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	89.25	535,143.00
PPL CORPORATION	36,597	35.72	1,307,244.84
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25,629	58.65	1,503,140.85

	SEMPRA ENERGY	13,913	152.03	2,115,193.39
	SOUTHERN CO	54,470	63.07	3,435,422.90
	UGI CORPORATION	10,588	45.20	478,577.60
	VISTRA ENERGY CORP	18,354	24.23	444,717.42
	WEC ENERGY GROUP INC	15,995	92.18	1,474,419.10
	XCEL ENERGY INC	26,098	63.85	1,666,357.30
	ADVANCED MICRO DEVICES	53,101	42.83	2,274,315.83
	ANALOG DEVICES INC	18,750	118.70	2,225,625.00
	APPLIED MATERIALS INC	47,467	60.67	2,879,822.89
	BROADCOM INC	20,560	324.10	6,663,496.00
	INTEL CORP	228,104	57.96	13,220,907.84
	KLA CORPORATION	8,195	175.46	1,437,894.70
	LAM RESEARCH CORP	7,602	293.29	2,229,590.58
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,750	26.05	827,087.50
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	61.29	846,660.06
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,065	102.37	1,235,094.05
	MICRON TECHNOLOGY INC	55,617	54.53	3,032,795.01
	NVIDIA CORP	30,053	235.46	7,076,279.38
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,208	125.95	1,789,497.60
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	23.88	499,378.56
	QORVO INC	6,042	117.28	708,605.76
	QUALCOMM INC	63,277	88.49	5,599,381.73
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	117.85	1,032,012.45
	TERADYNE INC	9,842	68.56	674,767.52
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,073	126.40	6,076,427.20
	XILINX INC	12,876	96.29	1,239,830.04
	米ドル 小計	15,450,436		1,409,572,333.60 (154,249,500,465)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	11.55	189,235.20
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	62,867	41.56	2,612,752.52
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	13.00	702,234.00
	ENBRIDGE INC	104,247	51.35	5,353,083.45
	ENCANA CORP	66,377	5.89	390,960.53
	HUSKY ENERGY INC	14,553	10.22	148,731.66
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	34.14	443,785.86
	INTER PIPELINE LTD	19,394	22.46	435,589.24
	KEYERA CORP	11,374	33.86	385,123.64
	PARKLAND FUEL CORP	7,666	47.75	366,051.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	48.37	1,325,870.07
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	15.33	138,552.54
	SUNCOR ENERGY INC	81,480	42.80	3,487,344.00
	TC ENERGY CORP	48,116	68.98	3,319,041.68

AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	77.10	917,875.50
BARRICK GOLD CORP	93,270	23.24	2,167,594.80
CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	56.11	368,249.93
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	13.38	423,771.36
FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,493	128.04	1,215,483.72
KINROSS GOLD CORP	63,501	5.64	358,145.64
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	11,329	54.56	618,110.24
LUNDIN MINING CORP	28,209	7.78	219,466.02
METHANEX CORPORATION	2,452	51.60	126,523.20
NUTRIEN LTD	30,042	63.42	1,905,263.64
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	22.44	556,826.16
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	57.32	164,680.36
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,695	36.83	909,516.85
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	1.95	147,911.40
CAE INC	12,891	34.13	439,969.83
WSP GLOBAL INC	6,393	89.98	575,242.14
THOMSON REUTERS CORP	11,002	94.24	1,036,828.48
AIR CANADA	5,737	49.35	283,120.95
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,223	118.33	4,404,597.59
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,090	330.47	2,343,032.30
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	73.33	1,053,312.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	38.00	344,508.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	13,035	85.28	1,111,624.80
STARS GROUP INC/THE	14,575	33.04	481,558.00
QUEBECOR INC -CL B	9,953	33.40	332,430.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,532	26.45	701,771.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,540	142.26	503,600.40
DOLLARAMA INC	14,542	44.28	643,919.76
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	46,234	42.09	1,945,989.06
EMPIRE CO LTD A	7,235	30.72	222,259.20
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	67.66	577,748.74
METRO INC	13,109	54.60	715,751.40
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	103.90	444,795.90
SAPUTO INC	13,425	39.77	533,912.25
AURORA CANNABIS INC	28,563	2.97	84,832.11
BAUSCH HEALTH COS INC	15,027	39.27	590,110.29
CANOPY GROWTH CORP	11,251	26.35	296,463.85
CRONOS GROUP INC	8,026	9.08	72,876.08
BANK OF MONTREAL	33,657	101.71	3,423,253.47
BANK OF NOVA SCOTIA	62,983	73.31	4,617,283.73
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22,547	110.15	2,483,552.05
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	72.55	1,232,842.15

	ROYAL BANK OF CANADA	73,835	103.83	7,666,288.05	
	TORONTO-DOMINION BANK	93,672	73.59	6,893,322.48	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	46,422	76.60	3,555,925.20	
	CI FINANCIAL CORP	11,041	21.77	240,362.57	
	IGM FINANCIAL INC	6,433	38.22	245,869.26	
	ONEX CORPORATION	4,217	83.01	350,053.17	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	604.82	842,514.26	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	33.64	477,688.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	70.44	341,704.44	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	139.20	982,473.60	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,811	26.02	2,597,082.22	
	POWER CORP OF CANADA	14,595	33.65	491,121.75	
	POWER FINANCIAL CORP	16,201	35.23	570,761.23	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	30,089	59.31	1,784,578.59	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.05	137,793.30	
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	7.63	198,326.59	
	CGI INC-CL A	12,438	110.27	1,371,538.26	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,106	1,289.25	1,425,910.50	
	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	57.28	782,731.20	
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,177	516.06	2,671,642.62	
	BCE INC	8,379	60.87	510,029.73	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,323	64.84	1,188,063.32	
	TELUS CORPORATION	7,611	50.26	382,528.86	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	22,613	18.47	417,662.11	
	ALTAGAS LTD	17,347	19.66	341,042.02	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	49.59	150,257.70	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	38.81	285,020.64	
	EMERA INC	13,403	54.53	730,865.59	
	FORTIS INC	21,905	54.00	1,182,870.00	
	HYDRO ONE LTD	15,052	25.27	380,364.04	
	カナダドル 小計	2,054,157		100,091,352.26 (8,344,616,037)	
ユーロ	ENI SPA	130,479	13.84	1,806,612.23	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	24,155	15.04	363,411.97	
	NESTE OYJ	22,758	29.88	680,009.04	
	OMV AG	7,781	50.58	393,562.98	
	REPSOL SA	73,682	13.98	1,030,074.36	
	REPSOL SA-RTS	73,682	0.42	31,167.48	
	TENARIS S.A.	25,963	10.11	262,485.93	
	TOTAL SA	122,417	49.00	5,998,433.00	
	VOPAK	3,130	48.36	151,366.80	
	AIR LIQUIDE SA	24,407	125.10	3,053,315.70	

AKZO NOBEL	12,200	89.73	1,094,706.00
ARCELORMITTAL	35,989	16.51	594,394.32
ARKEMA	3,250	94.40	306,800.00
BASF SE	48,160	67.29	3,240,686.40
COVESTRO AG	8,053	41.85	337,018.05
CRH PLC	40,685	35.53	1,445,538.05
EVONIK INDUSTRIES AG	7,539	26.82	202,195.98
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.30	145,921.00
HEIDELBERGCEMENT AG	8,350	65.26	544,921.00
KONINKLIJKE DSM NV	9,200	115.30	1,060,760.00
LANXESS	4,409	59.84	263,834.56
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	33.80	386,705.80
SOLVAY SA	3,758	104.30	391,959.40
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	12.49	308,615.41
SYMRISE AG	6,524	91.28	595,510.72
THYSSENKRUPP AG	19,367	12.11	234,534.37
UMICORE	11,350	43.03	488,390.50
UPM-KYMMENE OYJ	29,092	30.64	891,378.88
VOESTALPINE AG	5,079	25.02	127,076.58
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,575	34.79	507,064.25
AIRBUS SE	30,025	130.82	3,927,870.50
ALSTOM RGPT	9,668	42.07	406,732.76
ANDRITZ AG	3,728	38.40	143,155.20
BOUYGUES SA	11,049	38.02	420,082.98
BRENTAG AG	9,172	48.85	448,052.20
CNH INDUSTRIAL NV	57,033	9.76	556,984.27
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	37.20	951,687.60
DASSAULT AVIATION SA	172	1,160.00	199,520.00
EIFFAGE SA	3,488	101.60	354,380.80
FERROVIAL SA	23,480	26.80	629,264.00
GEA GROUP AG	8,178	29.33	239,860.74
HOCHTIEF AG	825	114.80	94,710.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	52.05	397,245.60
KION GROUP AG	3,179	62.46	198,560.34
KNORR-BREMSE AG	2,138	91.00	194,558.00
KONE OYJ-B	18,260	58.32	1,064,923.20
LEGRAND SA	14,350	73.70	1,057,595.00
LEONARDO SPA	18,310	10.63	194,635.30
METSO OYJ	5,880	35.65	209,622.00
MTU AERO ENGINES AG	2,856	252.60	721,425.60
PRYSMIAN SPA	11,926	21.77	259,629.02
SAFRAN SA	17,196	139.85	2,404,860.60

SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,565	91.60	2,616,554.00
SIEMENS AG-REG	39,075	117.44	4,588,968.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	15.72	180,554.45
THALES SA	5,403	91.82	496,103.46
VINCI S.A.	26,415	97.38	2,572,292.70
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	9.93	187,820.20
BUREAU VERITAS SA	17,235	23.59	406,573.65
ELENRED	12,139	45.77	555,602.03
RANDSTAD NV	5,121	54.88	281,040.48
TELEPERFORMANCE	2,970	215.80	640,926.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,924	64.00	955,136.00
AENA SME SA	3,741	171.25	640,646.25
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	173.70	233,800.20
ATLANTIA SPA	26,501	22.14	586,732.14
BOLLORE	39,433	3.86	152,526.84
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	16.64	154,086.40
DEUTSCHE POST AG-REG	51,919	34.24	1,777,706.56
FRAPORT AG	1,856	75.00	139,200.00
GETLINK	22,311	15.62	348,497.82
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,789	74.10	1,244,064.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	55.95	140,322.60
CONTINENTAL AG	5,578	116.64	650,617.92
DAIMLER AG	46,555	49.91	2,323,560.05
FAURECIA	3,127	49.65	155,255.55
FERRARI NV	6,579	149.85	985,863.15
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,491	13.60	809,196.58
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	111.05	971,243.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	25.83	142,245.81
PIRELLI & C SPA	17,484	5.13	89,762.85
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	67.62	525,069.30
PSA PEUGEOT CITROEN	32,147	22.30	716,878.10
RENAULT SA	8,830	43.43	383,486.90
VALEO SA	14,048	32.47	456,138.56
VOLKSWAGEN AG	1,984	175.10	347,398.40
VOLKSWAGEN AG PFD	9,410	177.10	1,666,511.00
ADIDAS AG	9,463	288.35	2,728,656.05
ESSILORLUXOTTICA	14,780	138.40	2,045,552.00
HERMES INTERNATIONAL	1,690	664.80	1,123,512.00
KERING	3,987	577.80	2,303,688.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,207	402.25	5,714,765.75
MONCLER SPA	7,711	40.32	310,907.52
PUMA SE	3,830	66.85	256,035.50

SEB SA	1,032	136.00	140,352.00
ACCOR SA	10,680	41.35	441,618.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,221	106.55	449,747.55
SODEXO	3,900	105.30	410,670.00
ALTICE NV -A W/I	37,625	5.71	214,838.75
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	14.80	129,144.80
JC DECAUX SA	2,828	27.22	76,978.16
PUBLICIS GROUPE	10,736	40.26	432,231.36
SES	17,687	12.68	224,271.16
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	39.36	85,844.16
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,215	60.44	315,194.60
VIVENDI SA	43,144	25.40	1,095,857.60
DELIVERY HERO SE	5,334	68.04	362,925.36
INDITEX	55,694	31.27	1,741,551.38
PROSUS NV	25,486	65.50	1,669,333.00
ZALANDO SE	8,284	44.58	369,300.72
CARREFOUR SA	35,128	15.07	529,378.96
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	42.44	77,792.52
COLRUYT NV	2,472	47.34	117,024.48
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	14.58	180,456.66
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	60,023	22.72	1,363,722.56
METRO AG	8,344	14.00	116,816.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,222	72.17	2,830,651.74
DANONE	31,976	73.98	2,365,584.48
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	28,021	8.14	228,090.94
HEINEKEN HOLDING NV	6,520	85.95	560,394.00
HEINEKEN NV	13,143	94.52	1,242,276.36
KERRY GROUP PLC-A	8,352	112.40	938,764.80
PERNOD-RICARD SA	11,091	159.00	1,763,469.00
REMY COINTREAU	1,273	108.00	137,484.00
BEIERSDORF AG	5,600	105.05	588,280.00
HENKEL AG & CO KGAA	5,742	83.60	480,031.20
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	91.04	823,274.72
L'OREAL	12,957	258.90	3,354,567.30
UNILEVER NV	76,386	51.18	3,909,435.48
BIOMERIEUX	1,779	80.15	142,586.85
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	115.60	262,296.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,928	64.94	709,664.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,162	49.52	1,047,942.24
KONINKLIJKE PHILIPS NV	46,965	43.31	2,034,054.15
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	191.60	345,646.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,711	42.22	367,821.97

BAYER AG	48,080	71.01	3,414,160.80
EUROFINS SCIENTIFIC	701	497.20	348,537.20
GALAPAGOS NV	2,318	186.50	432,307.00
GRIFOLS S.A.	17,072	31.42	536,402.24
IPSEN	1,498	80.10	119,989.80
MERCK KGAA	6,553	104.10	682,167.30
ORION OYJ	4,259	42.06	179,133.54
QIAGEN N.V.	10,191	36.86	375,640.26
RECORDATI SPA	4,578	37.58	172,041.24
SANOFI	57,535	90.09	5,183,328.15
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	145.30	225,941.50
UCB SA	6,070	72.84	442,138.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	16.26	307,574.16
AIB GROUP PLC	36,918	3.19	117,916.09
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	343,002	5.15	1,767,832.30
BANCO DE SABADELL SA	238,475	1.10	263,157.16
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	852,250	3.79	3,235,141.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,159	4.87	254,327.28
BANKIA SA	82,022	1.93	158,630.54
BANKINTER,S.A.	36,405	6.68	243,185.40
BNP PARIBAS	57,737	53.51	3,089,506.87
CAIXABANK	181,981	2.86	520,647.64
COMMERZBANK AG	46,644	5.63	262,652.36
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	13.15	764,541.00
ERSTE GROUP BANK AG	16,973	34.14	579,458.22
FINECOBANK SPA	32,034	10.92	349,971.45
ING GROEP NV-CVA	203,129	10.89	2,212,887.32
INTESA SANPAOLO	779,261	2.38	1,854,641.18
KBC GROUPE SA	12,946	67.88	878,774.48
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.98	267,445.05
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,505	22.83	125,679.15
SOCIETE GENERALE	41,025	31.07	1,274,851.87
UNICREDIT SPA	106,885	13.49	1,442,306.19
AMUNDI SA	3,955	69.40	274,477.00
DEUTSCHE BANK AG -REG	99,560	7.12	708,867.20
DEUTSCHE BOERSE AG	9,634	137.75	1,327,083.50
EURAZEO	1,792	62.00	111,104.00
EXOR NV	4,846	70.22	340,286.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,728	93.66	442,824.48
NATIXIS	45,362	3.97	180,177.86
WENDEL	1,082	118.90	128,649.80

AEGON NV	91,609	4.19	384,024.92
AGEAS	8,765	53.46	468,576.90
ALLIANZ SE-REG	22,062	218.95	4,830,474.90
ASSICURAZIONI GENERALI	58,634	18.49	1,084,435.83
AXA SA	97,245	25.04	2,435,014.80
CNP ASSURANCES	8,978	17.39	156,127.42
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	173.50	530,563.00
MAPFRE SA	46,367	2.35	109,379.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,693	265.90	2,045,568.70
NN GROUP NV	15,922	34.20	544,532.40
POSTE ITALIANE SPA	26,562	10.29	273,455.79
SAMPO OYJ-A SHS	23,650	38.99	922,113.50
SCOR SE	9,581	37.40	358,329.40
AROUNDTOWN SA	45,883	7.91	363,209.82
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	35.94	652,095.36
VONOVIA SE	26,280	47.13	1,238,576.40
ADYEN NV	622	734.80	457,045.60
AMADEUS IT GROUP SA	22,251	72.48	1,612,752.48
ATOS SE	4,547	75.82	344,753.54
CAPGEMINI SA	8,059	111.00	894,549.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,666	146.50	976,569.00
SAP SE	50,158	119.56	5,996,890.48
WIRECARD AG	5,952	105.00	624,960.00
WORLDLINE SA	6,228	62.40	388,627.20
INGENICO S.A.	2,691	97.48	262,318.68
NOKIA OYJ	285,784	3.25	928,798.00
CELLNEX TELECOM SA	13,722	37.05	508,400.10
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	173,491	14.73	2,556,216.39
ELISA OYJ	8,333	49.24	410,316.92
ILIAD SA	1,016	115.45	117,297.20
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.67	463,520.01
ORANGE S.A.	104,864	13.25	1,389,972.32
PROXIMUS SA	6,313	25.99	164,074.87
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.55	275,263.92
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.54	136,749.63
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.62	106,195.82
TELEFONICA S.A.	240,639	6.47	1,558,859.44
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,861	29.27	200,821.47
E.ON SE	115,877	9.57	1,109,058.76
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	136,343	3.83	523,011.74
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	9.85	282,141.57
ENAGAS	10,471	22.47	235,283.37

	ENDESA S.A.	18,336	24.50	449,232.00
	ENEL SPA	420,215	7.00	2,941,925.21
	ENGIE	96,233	14.50	1,395,378.50
	FORTUM OYJ	21,280	22.27	473,905.60
	IBERDROLA SA	307,089	9.12	2,800,651.68
	NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	22.74	351,082.86
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	17.83	369,205.81
	RWE AG	29,609	26.62	788,191.58
	SNAM SPA	89,624	4.62	414,062.88
	SUEZ	14,536	13.77	200,233.40
	TERNA SPA	80,482	5.89	474,521.87
	UNIPER SE	12,358	29.93	369,874.94
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,081	23.82	692,709.42
	VERBUND AG	3,692	47.02	173,597.84
	ASML HOLDING NV	21,891	261.10	5,715,740.10
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	65,563	20.60	1,350,597.80
	STMICROELECTRONICS NV	37,627	24.08	906,058.16
	ユーロ 小計	10,185,933		214,682,831.78 (26,122,606,970)
英ポンド	BP PLC	1,055,848	4.83	5,106,608.85
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	218,167	22.69	4,950,209.23
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	194,456	22.72	4,419,012.60
	ANGLO AMERICAN PLC	51,260	21.73	1,114,136.10
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.28	180,393.92
	BHP GROUP PLC	107,097	17.99	1,927,103.41
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,482	48.66	364,074.12
	EVRAZ PLC	28,275	4.00	113,354.47
	GLENCORE PLC	556,703	2.39	1,334,138.73
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	30.45	306,753.30
	MONDI PLC	25,128	17.36	436,222.08
	RIO TINTO PLC	58,681	44.96	2,638,591.16
	ASHTED GROUP PLC	23,686	24.10	570,832.60
	BAE SYSTEMS PLC	170,608	5.69	971,441.95
	BUNZL PLC	17,064	20.42	348,446.88
	DCC PLC	4,734	65.56	310,361.04
	FERGUSON PLC	12,237	68.80	841,905.60
	MEGGITT PLC	36,960	6.38	235,804.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	2.34	576,703.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	86,917	6.95	604,768.48
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENTITLEMENT	3,998,182	0.00	3,998.18
	SMITHS GROUP PLC	23,530	17.06	401,421.80
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	90.00	331,650.00

WEIR GROUP PLC/THE	16,710	15.49	258,921.45
EXPERIAN PLC	47,988	25.35	1,216,495.80
G4S PLC	74,291	2.12	158,016.95
INTERTEK GROUP PLC	8,184	57.80	473,035.20
RELX PLC	97,576	19.02	1,856,383.40
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	4.52	410,110.00
EASYJET PLC	7,630	14.30	109,109.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	58,735	7.36	432,642.01
BURBERRY GROUP PLC	23,066	21.51	496,149.66
PERSIMMON PLC	16,916	26.64	450,642.24
TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.91	282,989.36
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	49.60	264,665.60
CARNIVAL PLC	8,091	33.58	271,695.78
COMPASS GROUP PLC	82,693	18.69	1,545,532.17
GVC HOLDINGS PLC	23,842	8.66	206,614.77
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,704	51.24	497,232.96
TUI AG-DI	17,636	9.48	167,224.55
WHITBREAD PLC	6,801	48.92	332,704.92
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	6.01	253,074.95
INFORMA PLC	69,099	8.37	578,358.63
ITV PLC	215,062	1.50	323,883.37
PEARSON PLC	39,623	6.15	243,681.45
WPP PLC	63,987	10.48	670,903.69
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	8.16	235,555.32
KINGFISHER PLC	109,678	2.19	241,181.92
MARKS & SPENCER GROUP PLC	84,084	2.19	184,143.96
NEXT PLC	6,860	71.32	489,255.20
OCADO GROUP PLC	22,177	12.37	274,329.49
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.33	263,420.69
TESCO PLC	516,090	2.52	1,301,062.89
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	2.02	295,540.93
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	26.04	436,716.84
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	117,896	32.55	3,838,104.28
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.39	220,994.56
DIAGEO PLC	121,902	31.56	3,847,227.12
IMPERIAL BRANDS PLC	49,659	18.25	906,674.02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,620	59.69	2,185,847.80
UNILEVER PLC	56,134	43.36	2,433,970.24
NMC HEALTH PLC	3,940	15.36	60,538.10
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	18.37	815,023.12
ASTRAZENECA PLC	68,127	76.34	5,200,815.18
GLAXOSMITHKLINE PLC	258,953	18.06	4,677,726.99

	BARCLAYS PLC	863,463	1.83	1,583,418.44
	HSBC HOLDINGS PLC	1,048,514	6.00	6,291,084.00
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,684,159	0.63	2,354,914.43
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	245,244	2.47	606,733.65
	STANDARD CHARTERED PLC	141,577	7.38	1,045,687.72
	3I GROUP PLC	49,338	11.25	555,052.50
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,431	19.58	282,631.13
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,953	74.60	1,190,093.80
	M&G PLC	133,064	2.36	315,095.55
	SCHRODERS PLC	6,213	33.87	210,434.31
	ST JAMES' S PLACE PLC	23,417	11.76	275,383.92
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	3.29	406,151.58
	ADMIRAL GROUP PLC	12,109	22.62	273,905.58
	AVIVA PLC	198,601	4.21	836,706.01
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.11	197,018.65
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	3.08	931,574.56
	PRUDENTIAL PLC	133,064	14.40	1,916,786.92
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	5.56	290,760.20
	AVEVA GROUP PLC	3,527	46.42	163,723.34
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	10.64	160,901.92
	SAGE GROUP PLC/THE	49,814	7.45	371,213.92
	HALMA PLC	21,166	21.25	449,777.50
	BT GROUP PLC	419,350	2.04	857,780.42
	VODAFONE GROUP PLC	1,367,398	1.51	2,067,505.77
	CENTRICA PLC	254,915	0.89	228,148.92
	NATIONAL GRID PLC	178,374	9.52	1,699,369.09
	SEVERN TRENT PLC	14,466	25.16	363,964.56
	SSE PLC	54,852	14.55	798,370.86
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	9.40	312,212.21
	英ポンド 小計	19,462,131		94,532,530.32 (13,458,596,341)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	21.34	215,555.34
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	339	629.50	213,400.50
	GIVAUDAN-REG	472	3,007.00	1,419,304.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	25,793	53.16	1,371,155.88
	SIKA AG	6,470	178.95	1,157,806.50
	ABB LTD	96,431	23.60	2,275,771.60
	GEBERIT AG-REG	1,999	542.80	1,085,057.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	236.40	222,452.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,322	245.90	570,979.80
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	61.58	432,230.02
	SGS SA	256	2,627.00	672,512.00

	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	162.25	383,234.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	27,260	75.34	2,053,768.40	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	270.20	359,366.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	51.45	129,448.20	
	DUFREY AG-REG	2,262	96.06	217,287.72	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	188	2,120.00	398,560.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	49	7,285.00	356,965.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	83,600.00	418,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	152,702	104.12	15,899,332.24	
	ALCON INC	21,063	55.80	1,175,315.40	
	SONOVA HOLDING AG	2,643	220.00	581,460.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	599	939.60	562,820.40	
	LONZA GROUP AG-REG	3,776	350.70	1,324,243.20	
	NOVARTIS AG-REG SHS	110,429	92.15	10,176,032.35	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,331	307.30	11,164,516.30	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	178.50	470,883.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	129,608	13.32	1,727,026.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,666	49.77	630,386.82	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	80.30	149,920.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	870.60	847,093.80	
	UBS GROUP AG	193,660	12.23	2,368,461.80	
	BALOISE HOLDING AG	2,475	174.90	432,877.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	490.90	851,711.50	
	SWISS RE AG	15,453	109.00	1,684,377.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,768	398.40	3,094,771.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	111.30	434,737.80	
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,650	151.10	551,515.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,431	520.00	744,120.00	
	スイスフラン 小計	893,488		68,824,457.07 (7,696,639,034)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,380	314.10	3,574,458.00	
	BOLIDEN AB	16,246	249.00	4,045,254.00	
	ALFA LAVAL AB	13,939	240.80	3,356,511.20	
	ASSA ABLOY AB-B	53,447	222.30	11,881,268.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,909	381.80	13,710,056.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	333.00	6,589,071.00	
	EPIROC AB-A	30,249	116.40	3,520,983.60	
	EPIROC AB-B	16,107	113.40	1,826,533.80	
	SANDVIK AB	60,999	184.95	11,281,765.05	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	210.50	3,307,165.50	
	SKF AB-B SHARES	20,607	193.45	3,986,424.15	
	VOLVO AB-B SHS	79,515	156.00	12,404,340.00	

	SECURITAS AB-B SHS	16,123	161.90	2,610,313.70	
	ELECTROLUX AB-SER B	9,165	233.60	2,140,944.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	75.60	1,405,630.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	43,722	192.70	8,425,229.40	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	429.50	1,524,725.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,559	481.20	3,637,390.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,725	300.60	9,837,135.00	
	NORDEA BANK ABP	170,474	75.55	12,879,310.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,798	87.42	7,762,721.16	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	100.80	7,828,934.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	136.00	6,245,256.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	225.10	1,410,476.60	
	INVESTOR AB-B SHS	24,294	515.00	12,511,410.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	227.00	2,555,339.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	403.00	1,263,002.00	
	ERICSSON LM-B SHS	159,401	83.00	13,230,283.00	
	HEXAGON AB-B SHS	13,203	531.20	7,013,433.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,238	453.00	1,919,814.00	
	TELE2 AB-B SHS	29,159	137.15	3,999,156.85	
	TELIA CO AB	126,963	40.72	5,169,933.36	
	スウェーデンクローナ 小計	1,266,109		192,854,269.97 (2,240,966,617)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,392	280.30	1,511,377.60	
	EQUINOR ASA	50,788	173.50	8,811,718.00	
	NORSK HYDRO ASA	79,046	32.53	2,571,366.38	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	361.50	3,255,307.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,930	247.80	973,854.00	
	MOWI ASA	22,242	227.20	5,053,382.40	
	ORKLA ASA	33,915	89.18	3,024,539.70	
	DNB ASA	47,557	161.30	7,670,944.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	182.50	2,019,545.00	
	TELENOR ASA	39,602	158.70	6,284,837.40	
	ノルウェークローネ 小計	302,543		41,176,872.08 (502,357,839)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	6,029	527.00	3,177,283.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	319.10	3,257,053.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,581	678.00	6,495,918.00	
	ISS A/S	8,523	158.25	1,348,764.75	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	9,070.00	1,523,760.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	370	9,622.00	3,560,140.00	
	DSV PANALPINA A S	10,998	756.00	8,314,488.00	
	PANDORA A/S	4,763	281.50	1,340,784.50	

	CARLSBERG AS-B	5,817	984.00	5,723,928.00
	COLOPLAST-B	6,052	813.60	4,923,907.20
	DEMANT A/S	4,455	211.40	941,787.00
	GENMAB A/S	3,294	1,466.50	4,830,651.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	257.60	746,009.60
	NOVO NORDISK A/S-B	91,583	384.95	35,254,875.85
	DANSKE BANK A/S	32,789	105.75	3,467,436.75
	TRYG A/S	8,215	194.80	1,600,282.00
	ORSTED A/S	9,592	665.80	6,386,353.60
	デンマーククローネ 小計	215,332		92,893,422.95 (1,512,304,925)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	34.30	459,139.80
	OIL SEARCH LTD	70,573	7.44	525,063.12
	ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	8.78	784,106.68
	SANTOS LTD	91,657	8.41	770,835.37
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,659	22.30	170,795.70
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	47,870	35.27	1,688,374.90
	WORLEY LIMITED	13,384	15.52	207,719.68
	ALUMINA LTD	106,977	2.36	252,465.72
	BHP GROUP LTD	151,689	39.79	6,035,705.31
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	15.33	353,954.37
	BORAL LIMITED	75,397	4.50	339,286.50
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	10.95	767,605.95
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.27	200,630.85
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	25,865	28.58	739,221.70
	NEWCREST MINING LIMITED	41,293	28.21	1,164,875.53
	ORICA LIMITED	17,981	23.48	422,193.88
	RIO TINTO LIMITED	19,754	102.26	2,020,044.04
	SOUTH32 LTD	235,718	2.86	674,153.48
	CIMIC GROUP LTD	4,062	33.54	136,239.48
	BRAMBLES LIMITED	88,389	12.22	1,080,113.58
	SEEK LIMITED	18,186	23.49	427,189.14
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	5.44	472,648.96
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	7.40	339,149.40
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,141	34.83	1,014,981.03
	CROWN RESORTS LTD	21,863	12.31	269,133.53
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	44.30	117,395.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	4.78	497,311.20
REA GROUP LTD	2,871	108.19	310,613.49	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	4.14	85,048.02	
WESFARMERS LIMITED	58,571	41.90	2,454,124.90	
COLES GROUP LIMITED	57,494	15.37	883,682.78	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	64,250	37.84	2,431,220.00
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	11.38	266,769.96
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	16.80	612,595.20
	COCHLEAR LIMITED	2,927	233.61	683,776.47
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,513	73.74	701,488.62
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	29.41	619,992.21
	CSL LIMITED	23,460	282.56	6,628,857.60
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	146,659	24.89	3,650,342.51
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	9.98	198,013.18
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	92,044	81.73	7,522,756.12
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	148,449	25.02	3,714,193.98
	WESTPAC BANKING CORPORATION	177,786	24.39	4,336,200.54
	AMP LIMITED	223,504	1.91	426,892.64
	ASX LTD	9,287	81.26	754,661.62
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	8.42	193,845.24
	MACQUARIE GROUP LTD	16,904	140.01	2,366,729.04
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8,094	57.79	467,752.26
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	7.84	918,746.08
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.30	424,789.20
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	67,004	13.15	881,102.60
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	13.24	846,472.92
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,039	17.30	519,674.70
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	24.75	195,747.75
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.69	800,519.67
	TPG TELECOM LTD	17,758	6.98	123,950.84
	AGL ENERGY LIMITED	34,137	21.06	718,925.22
	AUSNET SERVICES	85,220	1.76	150,413.30
	オーストラリアドル 小計	3,519,160		66,820,232.56 (5,041,586,546)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,669	5.27	214,325.63
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	55,278	8.99	496,949.22
	A2 MILK CO LTD	34,910	15.49	540,755.90
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,600	23.15	708,390.00
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,962	16.00	255,392.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.40	386,746.80
	MERCURY NZ LTD	30,223	4.91	148,394.93
	MERIDIAN ENERGY LTD	81,829	4.83	395,234.07
	ニュージーランドドル 小計	377,368		3,146,188.55 (227,563,817)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	143,424	73.60	10,556,006.40
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	11.24	781,180.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	62.60	4,413,300.00

	MTR CORPORATION	67,000	46.20	3,095,400.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	23.10	623,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	56.70	6,690,600.00	
	SANDS CHINA LTD	135,600	40.05	5,430,780.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	8.74	699,200.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	18.66	1,321,128.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	65,000	28.00	1,820,000.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	28.70	1,205,400.00	
	WH GROUP LIMITED	517,000	7.73	3,996,410.00	
	BANK OF EAST ASIA	87,220	17.84	1,556,004.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	27.35	5,128,125.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	160.80	6,239,040.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	60,600	255.00	15,453,000.00	
	AIA GROUP LTD	623,800	80.15	49,997,570.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	139,424	54.00	7,528,896.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.62	1,628,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	63,384	37.85	2,399,084.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	24.80	682,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	356,333	10.40	3,705,863.20	
	SINO LAND CO	124,200	11.30	1,403,460.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	85,000	117.00	9,945,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	71.40	1,927,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	25.15	1,332,950.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	44.70	3,218,400.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	37,000	50.75	1,877,750.00	
	PCCW LIMITED	269,000	4.66	1,253,540.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	55.50	1,665,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	82.60	7,029,260.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.80	865,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	545,014	15.08	8,218,811.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	56.55	4,043,325.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	108.00	1,328,400.00	
	香港ドル 小計	4,610,499		179,060,943.92 (2,514,015,652)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	6.75	471,825.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.26	98,807.20	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	3.90	386,490.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.08	97,200.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.38	277,746.00	
	SATS LTD	26,800	5.05	135,340.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.05	226,847.30	
	GENTING SINGAPORE LTD	370,200	0.93	346,137.00	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	2.19	151,219.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	30.61	143,867.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	117,000	4.09	478,530.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	25.94	2,443,548.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	163,900	10.95	1,794,705.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,900	26.60	1,699,740.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	9.04	321,824.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	3.72	508,152.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	10.86	280,188.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.12	176,204.00	
	VENTURE CORP LTD	11,900	16.00	190,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,115	3.28	1,440,297.20	
	シンガポールドル 小計	2,024,951		11,669,067.20	(942,510,557)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	16.06	461,098.66	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	555.30	771,311.70	
	BANK HAPOALIM BM	65,020	27.75	1,804,305.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	83,960	24.54	2,060,378.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	15.96	872,597.04	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	90.55	492,773.10	
	AZRIELI GROUP	2,140	256.30	548,482.00	
	NICE LTD	2,768	542.90	1,502,747.20	
	イスラエルシュケル 小計	244,104		8,513,693.10	(267,670,511)
	合 計	60,606,211		223,120,935,311	(223,120,935,311)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 611銘柄	66.3%	69.1%
カナダドル	株式 86銘柄	3.6%	3.7%
ユーロ	株式 237銘柄	11.2%	11.7%
英ポンド	株式 94銘柄	5.8%	6.0%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.3%	3.4%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
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%	2.3%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 35銘柄	1.1%	1.1%
シンガポールドル	株式 20銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシュケル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	449,892.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	5,727	915,289.14	
		AMERICAN TOWER CORP	22,501	5,044,724.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	80,296	765,220.88	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,069	1,468,514.06	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835	1,063,131.15	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	516,768.84	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,561	1,256,759.00	
		DUKE REALTY CORP	20,240	693,827.20	
		EQUINIX INC	4,426	2,549,021.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	594,783.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,789	1,509,884.04	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	995,201.76	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	671,182.55	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,227	540,506.49	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,237	797,154.93	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	700,286.16	
		INVITATION HOMES INC	25,902	757,115.46	
		IRON MOUNTAIN INC	16,395	523,164.45	
		KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	433,188.60	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	9,193	543,765.95	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,675	603,589.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	747,469.60	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	430,762.78	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	12,872	532,385.92	
		PROLOGIS INC	33,100	2,889,961.00	
		PUBLIC STORAGE	7,965	1,673,605.80	
		REALTY INCOME CORPORATION	16,047	1,161,000.45	
		REGENCY CENTERS CORP	9,451	591,065.54	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,428	2,242,459.80	
		SL GREEN REALTY CORP	3,945	357,140.85	
		SUN COMMUNITIES INC	4,598	681,469.58	
		UDR INC	14,289	659,866.02	
VENTAS INC	19,185	1,086,254.70			
VEREIT INC	54,273	499,854.33			
VICI PROPERTIES INC	26,533	671,815.56			

	VORNADO REALTY TRUST	8,706	585,652.62
	WELLTOWER INC	20,533	1,623,133.65
	WEYERHAEUSER CO	37,766	1,133,357.66
	WP CAREY INC	8,640	672,883.20
	米ドル 小計	701,885	41,633,111.02 (4,555,911,338)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP	4,697	252,322.84
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,391	217,899.27
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	200,386.13
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	112,604.85
	カナダドル 小計	26,114	783,213.09 (65,296,475)
ユーロ	COVIVIO	2,388	240,232.80
	GECINA SA	2,689	423,517.50
	ICADE	1,265	119,163.00
	KLEPIERRE	9,305	305,855.35
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,311	1,021,712.25
	ユーロ 小計	22,958	2,110,480.90 (256,803,315)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	275,796.90
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	314,864.48
	SEGRO PLC	61,311	541,253.50
	英ポンド 小計	138,976	1,131,914.88 (161,150,721)
オーストラリアドル	APA GROUP	55,097	638,023.26
	DEXUS	62,385	741,133.80
	GOODMAN GROUP	86,301	1,198,720.89
	GPT GROUP	97,296	565,289.76
	LENDLEASE GROUP	25,262	476,946.56
	MIRVAC GROUP	226,368	728,904.96
	SCENTRE GROUP	290,995	1,129,060.60
	STOCKLAND	103,417	498,469.94
	SYDNEY AIRPORT	49,760	441,371.20
	TRANSURBAN GROUP	141,455	2,201,039.80
	VICINITY CENTRES	146,656	378,372.48
	オーストラリアドル 小計	1,284,992	8,997,333.25 (678,848,793)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	170,000	1,873,400.00
	LINK REIT	112,500	8,876,250.00
	香港ドル 小計	282,500	10,749,650.00

				(150,925,086)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	150,400	437,664.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	256,888.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	160,800	387,528.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	104,900	245,466.00	
	SUNTEC REIT	64,600	117,572.00	
シンガポールドル 小計		611,100	1,445,118.00	(116,722,180)
合計			5,985,657,908	(5,985,657,908)

(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 40銘柄	2.0%	76.1%
カナダドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.1%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	4.3%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.7%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.3%	11.3%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券 5銘柄	0.1%	2.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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)

	(平成30年12月20日現在)	(令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,971	-
コール・ローン	-	9,963
親投資信託受益証券	3,724,748,321	4,827,130,309
未収入金	-	1,999,998
流動資産合計	3,724,758,292	4,829,140,270
資産合計	3,724,758,292	4,829,140,270
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,999,998
未払受託者報酬	13,208	17,489
未払委託者報酬	6,603	8,742
その他未払費用	1,650	2,185
流動負債合計	21,461	2,028,414

	(平成30年12月20日現在)	(令和1年12月20日現在)
負債合計	21,461	2,028,414
純資産の部		
元本等		
元本	2,143,614,966	2,685,671,164
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,581,121,865	2,141,440,692
元本等合計	3,724,736,831	4,827,111,856
純資産合計	3,724,736,831	4,827,111,856
負債純資産合計	3,724,758,292	4,829,140,270

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和1年12月18日 至 令和1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30年12月20日現在)	(令和1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	2,143,614,966口	2,685,671,164口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.7974円 (10,000口当たりの純資産額 17,974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 令和1年12月18日 至 令和1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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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 令和 1年12月18日 至 令和 1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30年12月20日現在)	(令和 1年12月20日現在)
期首元本額	2,147,006,651円	2,686,779,565円
期中追加設定元本額	-円	-円
期中一部解約元本額	3,391,685円	1,108,401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	2,657,672,361	4,827,130,309	
合計		2,657,672,361	4,827,130,309	

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30年12月20日現在)	(令和1年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	314,785,633	-
金銭信託	577,683,890	-
コール・ローン	-	758,723,849
国債証券	165,564,143,521	167,008,530,957
派生商品評価勘定	381,586	1,469,419
未収入金	1,123,373,963	1,597,973,735
未収利息	1,266,170,787	1,123,057,529
前払費用	28,823,626	64,113,469
流動資産合計	168,875,363,006	170,553,868,958
資産合計	168,875,363,006	170,553,868,958
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,568,184	1,838
未払金	-	827,007

未払解約金	1,235,583,895	471,222,803
未払利息	-	1,662
その他未払費用	8,691	-
流動負債合計	1,237,160,770	472,053,310
負債合計	1,237,160,770	472,053,310
純資産の部		
元本等		
元本	95,540,909,854	93,641,248,529
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	72,097,292,382	76,440,567,119
元本等合計	167,638,202,236	170,081,815,648
純資産合計	167,638,202,236	170,081,815,648
負債純資産合計	168,875,363,006	170,553,868,958

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 令和 1年12月18日 至 令和 1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30年12月20日現在)	(令和 1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	95,540,909,854口	93,641,248,529口
2. 1単位当たり純資産の1口当たり純資産額	1.7546円	1.8163円

額	(10,000口当たりの純資産額	17,546円)	(10,000口当たりの純資産額	18,163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 令和 1年12月18日 至 令和 1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、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（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	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	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

（令和 1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	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	861,739	-	859,901	1,838
	米ドル	419,800	-	419,096	704
	ユーロ	417,842	-	416,943	899
	英ポンド	24,097	-	23,862	235
	売建	600,073,827	-	598,604,408	1,469,419
	米ドル	310,687,385	-	310,019,026	668,359
	ユーロ	246,626,715	-	246,152,556	474,159
	英ポンド	42,759,727	-	42,432,826	326,901
	合計		600,935,566	-	599,464,309

（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 令和 1年12月18日 至 令和 1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・DC外国債券インデックスファンドS	10,552,181,053円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	554,981,860円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,516,082,759円
三井住友・DC年金バランス70(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・DCターゲットイヤーファンド2020(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
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>	3,953,188,104円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,777,524,029円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,196,835,258円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	731,917,710円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	28,771,508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>	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2016-04 <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2016-05 <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

(令和1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	94,197,787,250円
同期中における追加設定元本額	1,278,842円
同期中における一部解約元本額	557,817,563円
令和1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	21,337,751,153円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	647,853,140円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,771,536,835円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	890,673,798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)	134,218,214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)	8,807,362円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,937,213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)	90,257,895円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	129,206,353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)	71,166,457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)	151,244,659円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	21,493,351円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	166,915,227円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,044,026円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	157,511,112円
イオン・バランス戦略ファンド	53,824,408円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,018,684円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,085,507円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,164,018円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	102,132,606円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	39,686,496円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,161,322円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	40,226,176円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,255円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	57,459円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	59,106円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド <適格機関投資家限定>	2,657,672,361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>	68,956,145円
S M A M ・ バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	10,394,650,012円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,453,787,775円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,335,047,113円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	40,728,526円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,019,541円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,555円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,096,890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>	123,648,852円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,881,440,773円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,113,447,423円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,620,816円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,187,665,851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)	414,889,668円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,764,970円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	103,804,041円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	39,453,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	130,916,754円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	511,180,891円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	173,507円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	160,832,984円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,536,577円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,254,694,348円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,731,208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>	2,676,673,533円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,398,160,556円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,716,314,439円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	610,297,468円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	75,515,586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>	49,676,039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>	193,332,563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>	124,745,649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>	862,645,245円
合計	93,641,248,529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 1.125	3,800,000.00	3,775,359.39	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,975,390.64	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,460,625.00	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,675,531.25	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,080,148.44	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,579,468.76	
		US TREASURY N/B 1.25	4,500,000.00	4,466,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,953,828.14	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,990,390.64	
		US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,390,250.00	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,984,062.52	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,968,750.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,462,812.50	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,471,875.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,964,843.75	
		US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,524,843.75	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,991,093.75	
		US TREASURY N/B 1.5	5,800,000.00	5,777,796.90	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,984,062.50	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,983,593.75	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,468,476.57	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,498,359.37	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,999,218.76	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,397,343.75	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,496,445.33	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,994,375.00	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,994,843.75	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,992,031.25	
		US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,373,375.00	
		US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	5,977,210.93	
		US TREASURY N/B 1.625	5,500,000.00	5,424,804.71	
		US TREASURY N/B 1.625	8,450,000.00	8,236,109.37	
		US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	2,002,031.26	
		US TREASURY N/B 1.75	10,500,000.00	10,513,945.36	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,005,390.64	
		US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,006,562.50	
		US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,803,937.50	
		US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,405,625.00	

US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,110,250.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,007,265.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,008,203.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,007,031.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,007,031.25
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,712,468.75
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	11,812,906.25
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	850,796.87
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,410,500.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,009,843.76
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,015,234.39
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,016,406.25
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,709,429.69
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,827,750.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,017,812.50
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,811,390.63
US TREASURY N/B 1.875	3,500,000.00	3,510,937.50
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,208,750.01
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,317,390.62
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,010,546.89
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,011,250.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,014,531.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,016,875.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,018,750.00
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,329,562.50
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,523,515.62
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,122,523.45
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,026,953.14
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,533,359.37
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,029,062.50
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,555,429.71
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,023,281.26
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,339,187.50
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,529,296.87
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,542,656.25
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,349,046.87
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,071,640.66
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,713,289.07
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,711,820.32
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,030,000.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,023,671.89
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,027,890.64

US TREASURY N/B 2.125	4,500,000.00	4,549,570.33
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,034,921.89
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,054,687.52
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,149,406.25
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,032,656.26
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,608,164.09
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,560,976.58
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,071,250.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,832,484.38
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	4,988,812.50
US TREASURY N/B 2.125	3,900,000.00	3,972,210.95
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,025,625.00
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,021,796.89
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,534,804.71
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,825,812.50
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,357,109.37
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,063,046.89
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,310,500.00
US TREASURY N/B 2.25	4,800,000.00	4,905,749.99
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,535,859.37
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,450,117.21
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,175,320.32
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,100,000.00
US TREASURY N/B 2.25	7,200,000.00	7,384,500.00
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,519,281.27
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,344,218.77
US TREASURY N/B 2.25	5,600,000.00	5,756,625.00
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,789,882.81
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,409,648.45
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,014,843.76
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	5,042,968.75
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,017,968.76
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,657,937.50
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,225,593.75
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,798,281.25
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,759,250.00
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,078,390.62
US TREASURY N/B 2.375	6,200,000.00	6,448,968.75
US TREASURY N/B 2.375	700,000.00	704,539.06
US TREASURY N/B 2.5	8,900,000.00	8,984,828.12
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,932,210.94
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,562,070.33
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,142,578.15

US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,886,140.62	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,525,109.39	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,456,109.38	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,215,953.12	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	2,982,015.62	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,216,914.08	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	504,335.94	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	506,640.62	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,055,937.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,059,687.52	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,056,953.14	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,118,125.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,487,789.08	
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	6,070,968.75	
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	6,680,953.12	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,070,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,425,812.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,900,000.00	5,070,734.37	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,073,906.26	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,188,281.25	
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,444,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,309,578.12	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,099,062.50	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,255,468.75	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	631,171.87	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,116,500.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,150,781.26	
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,010,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,107,265.64	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,622,109.37	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,090,937.52	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,174,375.00	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,088,906.26	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,324,953.13	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,162,648.44	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,650,976.57	
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,845,937.50	
US TREASURY N/B 2.875	7,000,000.00	7,548,515.65	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,292,500.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,403,437.52	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,979,125.00	
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,001,390.62	

US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,265,625.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,307,070.32
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	2,015,015.63
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	3,931,757.83
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,500,625.00
US TREASURY N/B 3	4,200,000.00	4,733,203.14
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,829,687.50
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,490,125.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,515,109.37
US TREASURY N/B 3	7,400,000.00	8,407,671.91
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,324,875.00
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,060,468.75
US TREASURY N/B 3.125	6,700,000.00	7,372,093.75
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,256,062.50
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,281,718.76
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,626,671.87
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	4,356,937.50
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,786,812.51
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,770,937.52
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,773,281.25
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	963,625.00
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,111,718.75
US TREASURY N/B 3.625	3,400,000.00	4,198,734.39
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,456,125.00
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,873,007.82
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	5,036,562.52
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,900,312.50
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,323,046.88
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	798,656.25
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	668,203.12
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	942,265.62
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,891,312.50
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,438,437.50
US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	998,437.50
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	271,500.00
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,365,390.63
US TREASURY N/B 4.625	3,800,000.00	5,284,375.00
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,128,007.82
US TREASURY N/B 5	500,000.00	710,937.50
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	637,734.37
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	430,125.00
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	644,296.87
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,243,359.38

	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,314,531.25
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	928,312.50
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	651,406.25
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,453,664.06
	米ドル 小計	704,070,000.00	732,944,040.12 (80,206,066,310)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,948,660.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,800,000.00	1,785,258.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,975,902.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,965,160.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	2,945,370.00
	CANADA-GOV'T 1	1,600,000.00	1,524,672.00
	CANADA-GOV'T 1.25	600,000.00	576,300.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,987,600.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	992,300.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	987,450.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,102,024.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	923,022.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,022,950.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,442,252.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,472,800.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,174,172.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,843,380.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,360,700.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	665,915.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,021,430.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,055,840.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,106,585.00
	CANADA-GOV'T 5	1,750,000.00	2,610,475.00
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	338,015.00
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	742,325.00
	CANADA-GOV'T 8	700,000.00	1,006,922.00
	カナダドル 小計	35,500,000.00	38,577,479.00 (3,216,204,424)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	36,442,560.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	18,979,200.00
	MEXICAN BONOS 6.5	52,000,000.00	51,812,800.00
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	25,987,250.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,386,100.00
	MEXICAN BONOS 7.75	11,000,000.00	11,731,610.00
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	28,202,310.00
	MEXICAN BONOS 8.5	28,000,000.00	31,150,560.00

	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	45,503,200.00
	メキシコペソ 小計	241,000,000.00	256,195,590.00 (1,480,810,510)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,024,107.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,379,859.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	748,874.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	535,975.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,931,400.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,697,120.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	773,878.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,580,840.00
	BELGIAN 0321 4.25	4,300,000.00	4,674,272.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,299,990.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,930,435.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,647,930.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	568,420.00
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	966,035.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,042,190.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	701,750.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	462,996.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,512,364.00
	BELGIAN 1	1,300,000.00	1,423,422.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	451,828.00
	BELGIAN 1.6	1,150,000.00	1,386,865.50
	BELGIAN 1.9	500,000.00	619,810.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	703,715.00
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,366,008.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	1,002,950.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,512,060.00
	BTPS 0.45	1,500,000.00	1,513,545.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	2,026,800.00
	BTPS 0.9	2,250,000.00	2,295,675.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,044,600.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,046,820.00
	BTPS 1	2,300,000.00	2,352,969.00
	BTPS 1.2	1,000,000.00	1,026,130.00
	BTPS 1.25	1,600,000.00	1,636,096.00
	BTPS 1.35	2,000,000.00	2,058,720.00
	BTPS 1.45	2,000,000.00	2,071,400.00
	BTPS 1.45	1,800,000.00	1,875,726.00
	BTPS 1.45	1,000,000.00	1,038,740.00
	BTPS 1.5	2,700,000.00	2,811,240.00
	BTPS 1.6	1,200,000.00	1,256,808.00

BTPS 1.65	2,400,000.00	2,434,320.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,059,470.00	
BTPS 2	2,300,000.00	2,461,782.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,713,648.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,608,780.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,075,600.00	
BTPS 2.15	500,000.00	521,645.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,083,550.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,263,432.00	
BTPS 2.3	600,000.00	625,650.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,201,244.00	
BTPS 2.5	600,000.00	654,786.00	
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,206,579.00	
BTPS 2.7	2,050,000.00	2,225,726.00	
BTPS 2.8	300,000.00	340,485.00	
BTPS 2.8	900,000.00	946,692.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,137,740.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,043,935.00	
BTPS 3.1	1,700,000.00	1,957,125.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,785,075.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,019,107.50	
BTPS 3.45	1,600,000.00	1,963,136.00	
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,285,149.00	
BTPS 3.75	1,400,000.00	1,467,116.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,106,900.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,399,136.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,293,840.00	
BTPS 3.85	400,000.00	521,572.00	
BTPS 4	2,100,000.00	2,711,415.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,623,127.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,501,720.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,199,924.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,812,862.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,898,225.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,236,225.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,332,864.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,218,500.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,221,340.00	
BTPS 5	2,070,000.00	2,918,886.30	
BTPS 5	1,800,000.00	2,630,268.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,486,216.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,373,208.00	

BTPS 5.5	2,000,000.00	2,304,340.00
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,514,232.00
BTPS 6	2,700,000.00	3,976,182.00
BTPS 6.5	3,700,000.00	5,204,568.00
BTPS 7.25	400,000.00	567,340.00
BTPS 9	300,000.00	399,222.00
BUNDESÖBL-173 0	2,500,000.00	2,521,650.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,034,710.00
BUNDESÖBL-176 0	1,000,000.00	1,017,920.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,400,000.00	3,499,960.00
DEUTSCHLAND REP 0	500,000.00	511,565.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,885,806.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,044,101.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,400,000.00	2,517,336.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,632,175.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,400,000.00	1,484,168.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,602,630.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,140,800.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,394,393.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,224,742.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,450,000.00	1,849,504.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	500,000.00	533,835.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,394,289.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,183,140.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,334,024.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	4,000,000.00	4,388,360.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,644,090.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,469,384.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	517,015.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,422,848.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,337,467.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,030,784.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,024,828.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,723,737.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,302,208.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	4,100,000.00	7,003,497.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,150,000.00	2,245,651.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,474,659.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,487,840.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,535,004.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	831,220.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,526,610.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	405,600.00

FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	419,908.00	
FINNISH GOV'T 0.5	1,400,000.00	1,469,020.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	537,055.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	225,020.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,068,510.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,060,860.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,106,750.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	743,080.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	745,908.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,054,680.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,244,510.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,021,990.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,237,338.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,027,220.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,232,758.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,037,480.00	
FRANCE O.A.T. 0	5,000,000.00	5,100,350.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,239,776.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	2,981,400.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,475,216.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,033,748.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,500,000.00	3,668,420.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,300,000.00	3,448,962.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,528,459.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,817,521.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,208,301.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,715,675.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,921,153.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,708,928.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,208,158.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,319,080.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,300,000.00	2,545,295.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,900,000.00	3,549,948.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,022,056.00	
FRANCE O.A.T. 2	3,000,000.00	3,916,980.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,055,382.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,811,944.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,379,410.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,050,000.00	4,975,506.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,428,500.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,680,500.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,496,812.00	

FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,101,925.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,600,872.00
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,264,640.00
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	2,267,939.70
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,836,638.00
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,556,200.00
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,182,242.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,649,030.00
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,172,190.00
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,775,792.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,113,990.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	784,062.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	405,188.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	720,083.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	753,914.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,073,830.00
IRISH GOVT 1.1	1,100,000.00	1,205,292.00
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	465,020.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	357,819.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,290,980.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	739,386.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,160,640.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	570,810.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,945,185.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,822,896.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,041,680.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,760,911.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	300,000.00	310,374.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,582,650.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	600,000.00	630,120.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,506,722.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,200,000.00	1,297,356.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,733,904.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,114,150.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,611,900.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,322,790.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	1,971,108.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	848,928.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	794,640.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,292,602.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,818,047.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,025,423.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,120,537.00

REP OF AUSTRIA 0.5	1,300,000.00	1,365,000.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	890,715.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	961,101.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	213,972.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	2,000,000.00	2,178,020.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	257,966.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	1,000,000.00	1,235,160.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,209,956.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,087,070.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	783,270.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	970,536.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,228,491.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,071,610.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,099,940.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	1,060,435.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,135,042.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,322,630.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,488,800.00	
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,106,160.00	
SPANISH GOV'T 0.25	2,500,000.00	2,537,550.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,036,440.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	511,090.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,038,360.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,909,628.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,179,640.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,743,856.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	655,242.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,176,573.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,312,320.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,387,484.00	
SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	458,908.00	
SPANISH GOV'T 1.95	400,000.00	446,348.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,952,569.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,244,620.00	
SPANISH GOV'T 2.35	2,200,000.00	2,668,226.00	
SPANISH GOV'T 2.7	1,750,000.00	2,335,287.50	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,387,154.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,921,150.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,754,775.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,222,316.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,525,737.50	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,353,320.00	

	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,263,662.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	3,058,974.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,405,840.00
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,580,585.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,126,250.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,224,908.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,647,732.50
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,917,701.00
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,438,580.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,490,532.00
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	688,610.00
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,309,416.00
	ユーロ 小計	431,140,000.00	516,359,028.50 (62,830,566,587)
英ポンド	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,799,244.00
	UK TSY GILT 0.625	1,000,000.00	999,990.00
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	754,845.00
	UK TSY GILT 0.875	700,000.00	704,879.00
	UK TSY GILT 1	1,000,000.00	1,017,440.00
	UK TSY GILT 1.25	1,500,000.00	1,565,970.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,058,300.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,781,634.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	533,686.50
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,155,620.00
	UK TSY GILT 1.625	100,000.00	110,995.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,099,030.00
	UK TSY GILT 1.75	2,600,000.00	2,828,826.00
	UK TSY GILT 1.75	1,650,000.00	1,831,681.50
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,189,089.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,867,670.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,344,448.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,870,833.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,246,896.00
	UK TSY GILT 3.5	2,350,000.00	3,459,012.00
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,692,070.00
	UK TSY GILT 3.75	1,500,000.00	1,581,975.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,674,720.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,614,975.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,226,991.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,407,076.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,943,046.00
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,537,683.00
	UK TSY GILT 4.25	1,350,000.00	2,070,049.50

	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,020,447.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,510,115.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,433,718.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,205,248.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,617,055.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,219,278.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,622,627.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,930,224.00	
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,961,328.00	
	UK TSY GILT 6	950,000.00	1,386,382.50	
	UK TSY GILT 8	1,320,000.00	1,463,048.40	
英債券 小計		57,520,000.00	75,338,145.90	(10,725,891,831)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,255,400.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	7,400,000.00	7,963,806.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,483,630.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,728,900.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,751,680.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,145,456.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	7,800,000.00	8,189,220.00	
スウェーデンクローナ 小計		43,800,000.00	49,518,092.00	(575,400,229)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,521,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,097,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,753,460.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,124,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,162,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,270,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,205,200.00	
ノルウェークローネ 小計		31,200,000.00	32,134,860.00	(392,045,292)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	8,100,000.00	8,628,120.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,403,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,783,000.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,491,400.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	11,500,000.00	21,606,200.00	
デンマーククローネ 小計		37,600,000.00	49,911,720.00	(812,562,801)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,014,400.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,021,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,647,600.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,091,500.00	

	POLAND GOVT BOND 3.25	8,900,000.00	9,612,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,918,700.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,302,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,666,544.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,852,200.00
ポーランドズロチ 小計		31,900,000.00	34,125,944.00 (973,954,441)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1,400,000.00	1,423,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	300,000.00	302,268.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,020,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	2,081,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,240,900.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,505,655.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,698,570.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,454,980.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,028,913.20
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,474,850.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	933,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,364,458.70
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,123,820.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,460,780.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,150,000.00	1,438,650.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,589,928.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,150,000.00	2,566,455.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,924,440.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,893,860.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,303,800.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	2,989,000.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,811,375.00	
オーストラリアドル 小計		38,250,000.00	43,631,542.90 (3,291,999,911)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,110,340.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,247,640.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	454,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	797,786.50
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	444,800.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	745,073.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	832,800.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	950,000.00	1,127,735.50
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,800,000.00	2,024,460.00
シンガポールドル 小計		8,050,000.00	8,785,035.00 (709,567,276)
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,059,507.00

	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	7,960,665.68	
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,487,290.87	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,388,156.50	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,268,398.30	
	マレーシアリングット 小計	28,200,000.00	29,164,018.35	(770,805,004)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	60,000,000.00	41,598,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	15,988,320.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	59,000,000.00	49,801,900.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	27,500,000.00	25,597,000.00	
	南アフリカランド 小計	162,500,000.00	132,985,220.00	(1,022,656,341)
	合計		167,008,530,957	(167,008,530,957)

(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 212銘柄	47.2%	48.0%
カナダドル	国債証券 26銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 264銘柄	36.9%	37.6%
英ポンド	国債証券 40銘柄	6.3%	6.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	1.9%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 9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30年12月19日現在)

(令和 1年12月19日現在)

資産の部

流動資産

	(平成30年12月19日現在)	(令和 1年12月19日現在)
金銭信託	970	-
コール・ローン	-	970
親投資信託受益証券	592,271,290	684,977,189
流動資産合計	592,272,260	684,978,159
資産合計	592,272,260	684,978,159
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	588,251,581	680,731,236
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,020,679	4,246,923
元本等合計	592,272,260	684,978,159
純資産合計	592,272,260	684,978,159
負債純資産合計	592,272,260	684,978,159

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30年12月19日現在)	(令和 1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	588,251,581口	680,731,236口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0062円 (10,000口当たりの純資産額 10,062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31年 4月16日 至 令和 1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 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1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31年 4月16日 至 令和 1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30年12月19日現在)	(令和 1年12月19日現在)
期首元本額	594,837,530円	702,357,104円
期中追加設定元本額	11,796,587円	17,607,297円
期中一部解約元本額	18,382,536円	39,233,165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	678,396,741	684,977,189	
合計		678,396,741	684,977,189	

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30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	647,966,752	-
コール・ローン	-	710,322,860
特殊債券	2,247,468,200	1,717,971,434
未収利息	6,476,831	2,931,119

	（平成30年12月19日現在）	（令和 1年12月19日現在）
前払費用	1,752,051	1,196,438
流動資産合計	2,903,663,834	2,432,421,851
資産合計	2,903,663,834	2,432,421,851
負債の部		
流動負債		
未払金	101,452,000	-
未払利息	-	1,877
その他未払費用	17,287	-
流動負債合計	101,469,287	1,877
負債合計	101,469,287	1,877
純資産の部		
元本等		
元本	2,773,612,622	2,409,127,633
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,581,925	23,292,341
元本等合計	2,802,194,547	2,432,419,974
純資産合計	2,802,194,547	2,432,419,974
負債純資産合計	2,903,663,834	2,432,421,851

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30年12月19日現在）	（令和 1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	2,773,612,622口	2,409,127,633口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.0097円 (10,000口当たりの純資産額 10,097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31年 4月16日 至 令和 1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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	(令和 1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(特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成31年 4月16日 至 令和 1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

(令和1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	2,470,784,621円
同期中における追加設定元本額	681,638,378円
同期中における一部解約元本額	743,295,366円
令和1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)	95,402,827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)	76,150,577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)	16,292,956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)	21,583,619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)	11,954,828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)	25,517,242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>	678,396,741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>	488,680,750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>	994,751,581円
合計	2,409,127,633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25回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,200,000	
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,906,000	
	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,034,000	
	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,184,000	
	第112回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,163,000	
	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	244,000,000	245,832,440	
	第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,140,000	
	第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,324,000	
	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	100,000,000	100,134,000	
	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,815,000	
	第5回政府保証阪神高速道路株式会社債券	64,600,000	64,818,994	
	第57回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	101,252,000	
	第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,033,000	
	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,135,000	
	合計	1,708,600,000	1,717,971,434	

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20期中間計算期間(2019年12月21日から2020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20期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	790,983
コール・ローン	3,559,973
投資信託受益証券	450,279,203
流動資産合計	454,630,159
資産合計	
454,630,159	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,300,000
未払解約金	4,861,885
未払受託者報酬	99,731
未払委託者報酬	897,516
未払利息	16
その他未払費用	7,500
流動負債合計	7,166,648
負債合計	
7,166,648	
純資産の部	
元本等	
元本	352,767,770
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	94,695,741
元本等合計	447,463,511
純資産合計	
447,463,511	
負債純資産合計	
454,630,159	

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,408,458
営業収益合計	1,408,458
営業費用	
支払利息	702
受託者報酬	99,731
委託者報酬	897,516
その他費用	8,456
営業費用合計	1,006,405
営業利益又は営業損失()	2,414,863
経常利益又は経常損失()	2,414,863
中間純利益又は中間純損失()	2,414,863
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()	230,313
期首剰余金又は期首欠損金()	100,146,270
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,458,964
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	4,458,964
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,724,943
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,724,943
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()	94,695,741

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020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20期中間計算期間 (2020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	352,767,770口
2. 1単位当たり純資産の額	1.2684円
	(10,000口当たりの純資産額 12,684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20期中間計算期間 (2020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20期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
期首元本額	363,521,029円
期中追加設定元本額	17,330,398円
期中一部解約元本額	28,083,657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20期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,782,352
コール・ローン	8,782,968
投資信託受益証券	1,229,778,894
流動資産合計	1,241,344,214
資産合計	1,241,344,214
負債の部	
流動負債	
未払金	3,500,000
未払解約金	1,717,569
未払受託者報酬	274,795
未払委託者報酬	3,091,372
未払利息	40
その他未払費用	20,708
流動負債合計	8,604,484
負債合計	8,604,484
純資産の部	
元本等	
元本	816,502,576
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	416,237,154
元本等合計	1,232,739,730
純資産合計	1,232,739,730
負債純資産合計	1,241,344,214

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	6,661,119
営業収益合計	6,661,119
営業費用	
支払利息	1,638
受託者報酬	274,795
委託者報酬	3,091,372
その他費用	22,495
営業費用合計	3,390,300
営業利益又は営業損失（ ）	10,051,419
経常利益又は経常損失（ ）	10,051,419
中間純利益又は中間純損失（ ）	10,051,419
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（ ）	955,102
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	447,986,774
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,630,243
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	16,630,243
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,283,546
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	39,283,546
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（ ）	416,237,154

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020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20期中間計算期間 (2020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		816,502,576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)	1.5098円 15,098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20期中間計算期間 (2020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20期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
期首元本額	859,233,953円
期中追加設定元本額	32,626,618円
期中一部解約元本額	75,357,995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20期中間計算期間 (2020年6月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,262,680
コール・ローン	14,684,318
投資信託受益証券	1,789,987,937
流動資産合計	1,807,934,935
資産合計	1,807,934,935
負債の部	
流動負債	
未払金	2,320,000
未払解約金	942,376
未払受託者報酬	392,586
未払委託者報酬	4,416,592
未払利息	68
その他未払費用	29,606
流動負債合計	8,101,228
負債合計	8,101,228
純資産の部	
元本等	
元本	1,083,897,867
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	715,935,840
元本等合計	1,799,833,707
純資産合計	1,799,833,707
負債純資産合計	1,807,934,935

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	26,047,549
営業収益合計	26,047,549
営業費用	
支払利息	2,645
受託者報酬	392,586
委託者報酬	4,416,592
その他費用	32,715
営業費用合計	4,844,538
営業利益又は営業損失（ ）	30,892,087
経常利益又は経常損失（ ）	30,892,087
中間純利益又は中間純損失（ ）	30,892,087
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（ ）	3,206,489
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	753,081,536
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,130,996
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	37,130,996
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,591,094
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,591,094
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（ ）	715,935,840

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020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20期中間計算期間 (2020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		1,083,897,867口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6605円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,605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20期中間計算期間 (2020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20期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
期首元本額	1,093,736,304円
期中追加設定元本額	57,878,357円
期中一部解約元本額	67,716,794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20期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,748,564
コール・ローン	20,538,722
投資信託受益証券	2,741,830,918
流動資産合計	2,770,118,204
資産合計	
2,770,118,204	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,790,000
未払解約金	1,749,463
未払受託者報酬	598,263
未払委託者報酬	6,730,305
未払利息	96
その他未払費用	45,323
流動負債合計	10,913,450
負債合計	
10,913,450	
純資産の部	
元本等	
元本	1,555,974,896
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,203,229,858
元本等合計	2,759,204,754
純資産合計	
2,759,204,754	
負債純資産合計	
2,770,118,204	

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020年 6月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	80,789,695
営業収益合計	80,789,695
営業費用	
支払利息	4,240
受託者報酬	598,263
委託者報酬	6,730,305
その他費用	50,934
営業費用合計	7,383,742
営業利益又は営業損失()	88,173,437
経常利益又は経常損失()	88,173,437
中間純利益又は中間純損失()	88,173,437
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()	13,313,472
期首剰余金又は期首欠損金()	1,309,471,872
剰余金増加額又は欠損金減少額	101,941,115
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	101,941,115
剰余金減少額又は欠損金増加額	133,323,164
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	133,323,164
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()	1,203,229,858

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第20期中間計算期間 自 2019年12月21日 至 2020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20期中間計算期間 (2020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		1,555,974,896口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7733円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,733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20期中間計算期間 (2020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20期中間計算期間 (2020年 6月20日現在)
期首元本額	1,577,910,109円
期中追加設定元本額	139,177,828円
期中一部解約元本額	161,113,041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

2020年 7月31日現在

資産総額	447,009,625円
負債総額	549,856円
純資産総額（ - ）	446,459,769円
発行済口数	351,695,214口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2695円
（1万口当たり純資産額）	（12,695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

2020年 7月31日現在

資産総額	1,205,260,576円
負債総額	2,719,653円
純資産総額（ - ）	1,202,540,923円
発行済口数	795,743,307口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5112円
（1万口当たり純資産額）	（15,112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

2020年 7月31日現在

資産総額	1,811,845,175円
負債総額	3,107,129円
純資産総額（ - ）	1,808,738,046円
発行済口数	1,088,359,180口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6619円
（1万口当たり純資産額）	（16,619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

2020年 7月31日現在

資産総額	2,782,828,720円
負債総額	7,189,445円

純資産総額（ - ）	2,775,639,275円
発行済口数	1,569,389,331口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7686円
（1万口当たり純資産額）	（17,686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

	2020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。

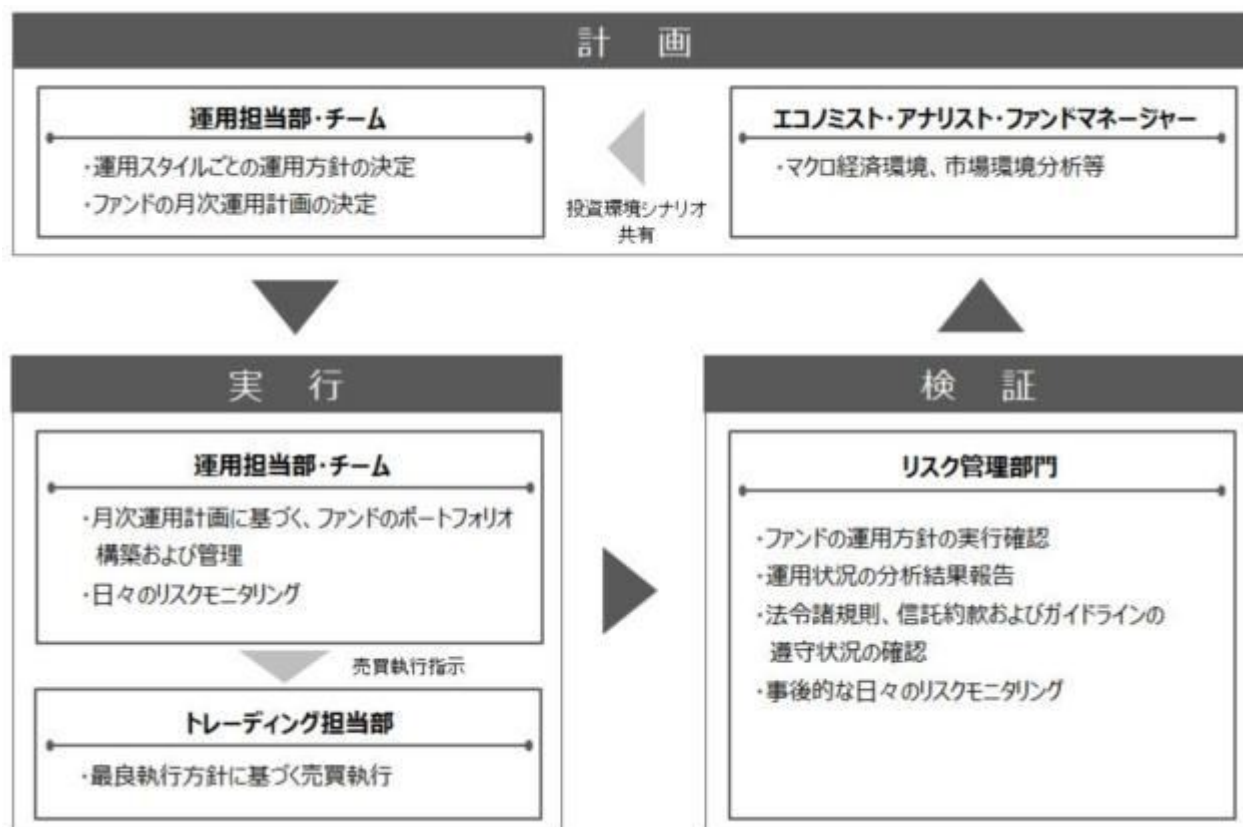
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2020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	753	7,524,986
単体型株式投資信託	125	588,189
追加型公社債投資信託	1	28,462
単体型公社債投資信託	183	454,138
合計	1,062	8,595,777

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（2019年4月1日から2020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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785
未収投資助言報酬	285,668	299,826
未収収益	44,150	37,702
その他の流動資産	31,771	40,119
流動資産合計	22,771,504	45,664,712
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	173,517	101,609
器具備品	751,471	783,224

土地	-	710
リース資産	-	968
建設仮勘定	-	66,498
有形固定資産合計	924,988	953,010
無形固定資産		
ソフトウェア	479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定	183,528	508,733
のれん	-	34,397,824
顧客関連資産	-	17,785,166
電話加入権	44	12,739
商標権	60	54
無形固定資産合計	663,501	53,613,651
投資その他の資産		
投資有価証券	10,829,628	19,436,480
関係会社株式	10,252,067	11,246,398
長期差入保証金	2,004,451	2,523,637
長期前払費用	97,107	113,852
会員権	7,819	90,479
繰延税金資産	1,426,381	-
貸倒引当金	-	20,750
投資その他の資産合計	24,617,457	33,390,098
固定資産合計	26,205,946	87,956,760
資産合計	48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		

資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支援手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691
一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022

事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	-	778,113
受取利息	623	947
時効成立分配金・償還金	72	1,041
原稿・講演料	1,951	2,061
投資有価証券償還益	289,451	6,398
投資有価証券売却益	7,247	24,206
雑収入	36,408	53,484
営業外収益合計	335,754	866,254
営業外費用		
為替差損	15,760	72,457
投資有価証券償還損	13,668	129,006
投資有価証券売却損	14,605	12,906
雑損失	7,027	8,334
営業外費用合計	51,061	222,704
経常利益	6,292,738	2,166,469
特別利益		
過去勤務費用償却益	79,850	-
特別利益合計	79,850	
特別損失		
固定資産除却損	1 1,462	110,668
関係会社株式評価損	160,455	-
合併関連費用	2 187,140	42,800
本社移転費用	3 -	133,168
減損損失	4 -	46,417
特別損失合計	349,058	333,054
税引前当期純利益	6,023,530	1,833,414
法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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		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	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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等	
	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	純資産合計
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

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（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

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)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「営業外費用」として、表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当事業年度から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別利益」の「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」に表示していた7,247千円及び289,451千円は「営業外収益」として、「特別損失」の「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」に表示していた14,605千円及び13,668千円は「営業外費用」として組み替えております。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	350,176千円	466,875千円
器具備品	922,553千円	1,225,261千円
リース資産	-千円	1,452千円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

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

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	174,854千円	132,559千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	当事業年度 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	-千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	-千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	102,695千円

2 合併関連費用

前事業年度の合併関連費用は、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。

当事業年度の合併関連費用は、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等及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

3 本社移転費用

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

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	17,622,360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2018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2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019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
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019年 3月22日

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

2019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
2019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	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

2020年6月29日開催の第35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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(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、次の通りです。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（2019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	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

その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)その他有価証券」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(2019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	-	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(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(2019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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がなく、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(2019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。

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がなく、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 2018年4月1日 至 2019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
---------	-------	--------

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,578,762	289,451	13,668

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,319,830	3,418,601
勤務費用	267,362	523,396
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	3,658	195
退職給付の支払額	85,082	349,050
過去勤務費用の発生額	79,850	-
合併による発生額	-	1,707,062
退職給付債務の期末残高	3,418,601	5,299,814

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
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	3,418,601	5,299,814

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842

確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158
-----------------	---------	---------

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020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156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(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原因別の内訳

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,046,775	1,622,803
賞与引当金	400,242	530,059
調査費	80,983	178,573
未払金	57,192	162,557
未払事業税	54,797	46,423
ソフトウェア償却	17,501	91,937
子会社株式評価損	50,580	114,876
その他有価証券評価差額金	-	150,771
その他	32,218	88,250
繰延税金資産小計	1,740,292	2,986,254
評価性引当額(注)	51,729	193,485
繰延税金資産合計	1,688,563	2,792,768
繰延税金負債		
無形固定資産	-	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産(負債)の純額	1,426,381	2,963,538

(注) 評価性引当額が141,756千円増加しております。この増加の内容は、主として大和住銀投信投資顧問株式会社との合併によるものであります。

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 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1

その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	2,499,836	未払 手数料	399,447
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	5,789,062	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)

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09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いません。
 2. 当社は、2018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。
 1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、
 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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
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)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018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、2019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) 企業結合を行った主な理由

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

2019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 2019年1月16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 2019年1月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	企業結合日に交付した当社の普通株式の時価	81,927,000千円
取得原価		81,927,000千円

4. 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株を割当交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はE Y 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P w C 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

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1)発生したのれん

37,043,811千円

(2)発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3)償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	24,546,329千円
固定資産	34,001,531千円
資産合計	58,547,860千円
流動負債	5,406,939千円
固定負債	8,257,731千円
負債合計	13,664,671千円

(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。

- 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。
- 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。
- 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 榮 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） XBRLデータ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
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	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	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	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		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	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	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	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 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。 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。 建物 2～30年 器具備品 4～15年 （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>
<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>

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。

(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

(単位：千円)

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) その他有価証券 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) その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 その他有価証券の 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 その他有価証券の 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. その他有価証券

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	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(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	第47期
	(平成30年3月31日)	(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	第47期
	(平成30年3月31日)	(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 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 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 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 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

2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

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(2020年3月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行*
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2020年7月27日現在）
- ・ 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。

* 株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社が合併して発足しました。

□ 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、2020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

2020年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

令和2年1月28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の令和1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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. 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

令和2年1月28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の令和1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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. 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

令和2年1月28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の令和1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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. 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

令和2年1月28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の令和1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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2020年8月4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	菅野 雅子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志 印

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2019年12月21日から2020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2020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（2019年12月21日から2020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

2020年8月4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	菅野 雅子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志 印

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2019年12月21日から2020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2020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（2019年12月21日から2020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

2020年8月4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	菅野 雅子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志 印

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2019年12月21日から2020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2020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（2019年12月21日から2020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

2020年8月4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	菅野 雅子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志 印

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2019年12月21日から2020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2020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（2019年12月21日から2020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。