

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年1月9日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****（１）【ファンドの名称】**

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（４資産タイプ）  
以下「当ファンド」といいます。

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

5兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC2045」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

**（５）【申込手数料】**

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問い合わせください。

## (7) 【申込期間】

2020年1月10日から2020年7月9日まで

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

## (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

## (9) 【払込期日】

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

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

## (10) 【払込取扱場所】

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

## (11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用  
ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、西暦2045年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

以下、上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

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

##### （ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、円短期金融資産）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2008年3月31日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年1月13日	「スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045」から「三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)」に名称を変更。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

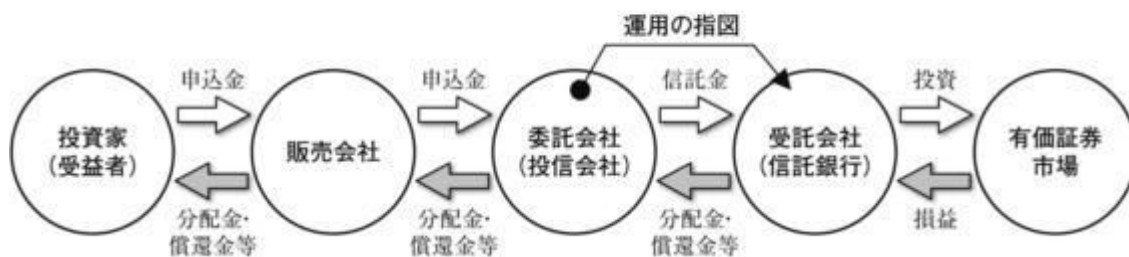
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

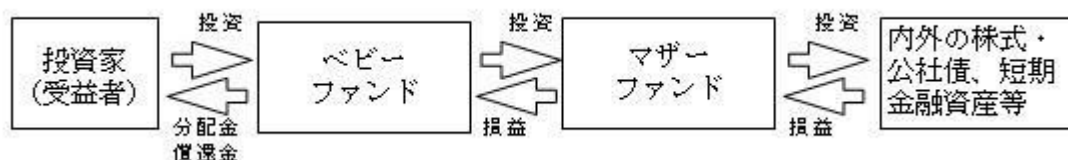
委託会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問いません。)に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



## □ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（2019年10月31日現在）

## (ロ) 会社の沿革

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

## (ハ) 大株主の状況

(2019年10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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

「(1)投資方針」には、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率の異なるファンドの情報を合わせて説明している部分があります。

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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



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

- (ロ) 長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。
- (ハ) 基本資産配分は、西暦2045年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年1回決算時に変更します。
- なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。
- (ニ) 組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要なに応じて調整を行うものとします。

[2019年4月現在の基本資産配分]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
31.0%	23.5%	20.0%	23.5%	2.0%

- (ホ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

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

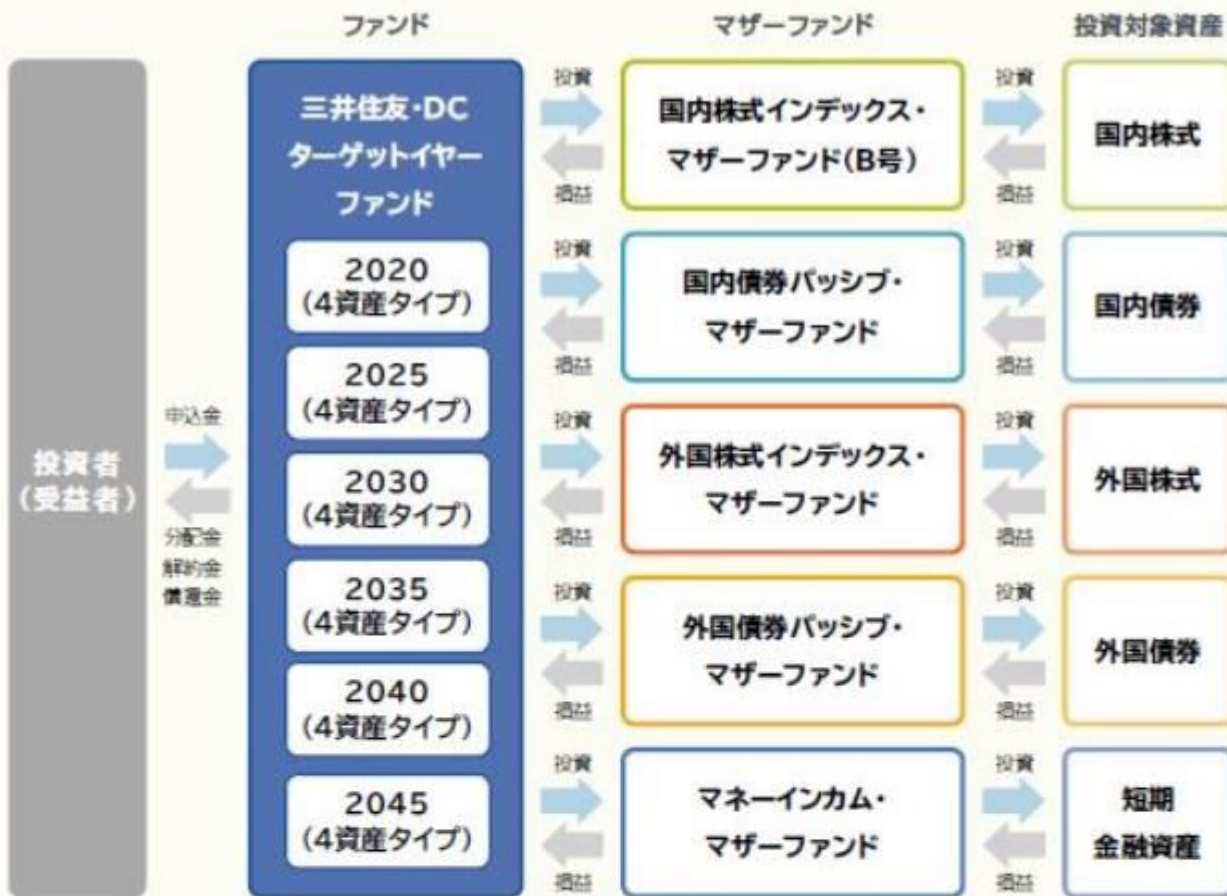
  - 実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います(ファミリーファンド方式)。
  - ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。
- 2** 基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。

基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。
- 3** 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

## ファンドのしくみ

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



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

### ▶ 2019年4月現在の基本資産配分

	<2020>	<2025>	<2030>	<2035>	<2040>	<2045>
国内株式	9.0%	14.0%	19.5%	25.0%	30.0%	31.0%
外国株式	4.0%	7.0%	10.0%	16.0%	21.5%	23.5%
外国債券	8.0%	12.5%	18.5%	20.0%	20.0%	20.0%
国内債券	32.0%	50.0%	50.0%	37.0%	26.5%	23.5%
短期金融資産	47.0%	16.5%	2.0%	2.0%	2.0%	2.0%

<2040><2045>の運用にあたっては、各マザーファンドが運用の対象とする指数から基本資産配分比率に基づき作成した合成指数を参考指数とします。

各マザーファンドは、それぞれの対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行うため、<2040><2045>は結果として参考指数の動きに連動する成果を目指して運用を行います。

### ▶ 基本資産配分のイメージ





※上記は、各決算時点での基本資産配分を表しています。各ターゲットイヤーの前年の決算日から翌年の決算日まで、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。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図であり、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。

## 各マザーファンドの運用プロセス

### ▶国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶国内債券パッシブ・マザーファンド

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

### ▶外国株式インデックス・マザーファンド

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



#### 最適化法とは

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

#### 層化抽出法とは

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

### ▶外国債券パッシブ・マザーファンド

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

### ▶マネーインカム・マザーファンド

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

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

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

## （２）【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．約束手形
- ４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

### ロ 投資対象とする有価証券

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

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券(ただし、投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 八 投資対象とする金融商品

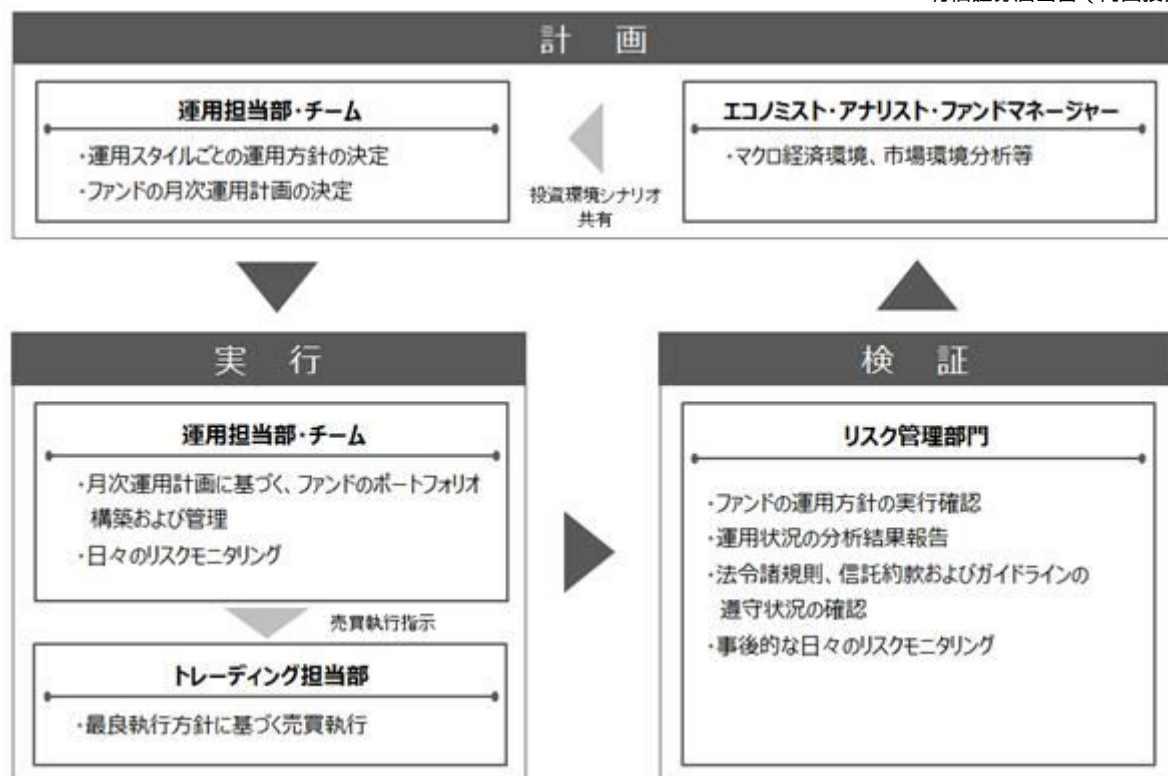
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

### (3) 【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制





リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

- 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制  
 ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

#### （４）【分配方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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

#### （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。  
 実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組

入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

- 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ハ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
- ホ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ヘ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ト デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- チ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

#### ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

##### イ 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

##### ロ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

##### ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)
- (ロ) 委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国

の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

- (八) 委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価



値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

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

#### ト 有価証券の空売りの指図

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

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

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

#### チ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

します。

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

#### ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### 法令に基づく投資制限

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

## (国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

## (1)投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

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

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

## (2)投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3)投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)外貨建資産への投資は行いません。

(ロ)株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## (国内債券パッシブ・マザーファンド)

## (1)投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

(ロ)公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(ハ)資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運

用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

(ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ニ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビー

ファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号に掲げるものに投資します(ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。 )。

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

#### (外国債券パッシブ・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

イ 基本方針

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。

ロ 投資態度

(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。

##### (2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

## 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

### (マネーインカム・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

- (イ) 主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
- (ロ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (2) 投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

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

##### ロ 投資対象とする有価証券

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

##### ハ 投資対象とする金融商品

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

#### (3) 投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (二) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

#### (イ) 株式市場リスク

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

#### (ロ) 債券市場リスク

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

#### (ハ) 信用リスク

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

#### (ニ) 為替変動リスク

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

#### (ホ) カントリーリスク

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

#### (ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(チ) 換金制限等に関する留意点

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。

(リ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、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。

### ＜2045＞



※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.が発行した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が発行した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより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が発行、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬率およびその実質的配分は以下の通りです。

決算期	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
第1期～第37期 （ターゲットイヤーの 決算日まで）	年0.462% （税抜き0.42%）	年0.19%	年0.2%	年0.03%
第38期以降 （ターゲットイヤーの 決算翌日以降）	年0.231% （税抜き0.21%）	年0.08%	年0.1%	年0.03%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用等の対価
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

## (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0055%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な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ついては、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

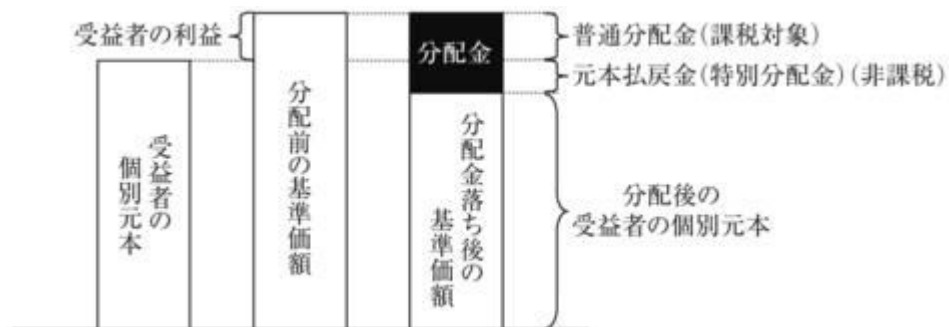
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、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。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたて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およびつみたて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。

つみたてNISA（ニーサ）、NISA（ニーサ）およびジュニアNISA（ニーサ）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。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	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	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	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20年間 (投資期間は2037年まで)	最長5年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	40万円/年 (最大800万円)	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)
留意事項	 つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。		

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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、2019年10月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

2019年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,348,405,491	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,242,418	0.53
合計(純資産総額)		1,355,647,909	100.00

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

##### イ 主要投資銘柄

2019年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	158,042,001	2.5469	402,520,484	2.6600	420,391,722	31.01
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	84,858,784	3.6553	310,185,377	3.7532	318,491,988	23.49
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	243,656,385	1.2847	313,032,596	1.2984	316,363,450	23.34
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	147,362,077	1.7821	262,625,679	1.8192	268,081,090	19.78
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	24,833,870	1.0100	25,083,809	1.0098	25,077,241	1.85

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

##### ロ 種類別の投資比率

2019年10月31日現在



種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.47
合計	99.47

## 【投資不動産物件】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

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ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

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ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2期 (2010年 4月13日)	3,447,652	3,447,652	9,032	9,032
第3期 (2011年 4月13日)	7,894,797	7,894,797	8,652	8,652
第4期 (2012年 4月13日)	14,008,624	14,008,624	8,556	8,556
第5期 (2013年 4月15日)	29,460,407	29,460,407	11,057	11,057
第6期 (2014年 4月14日)	43,599,805	43,599,805	11,849	11,849
第7期 (2015年 4月13日)	172,574,309	172,574,309	14,615	14,615
第8期 (2016年 4月13日)	376,483,121	376,483,121	13,389	13,389
第9期 (2017年 4月13日)	572,298,104	572,298,104	14,221	14,221
第10期 (2018年 4月13日)	867,000,774	867,000,774	15,749	15,749
第11期 (2019年 4月15日)	1,166,722,425	1,166,722,425	16,081	16,081
2018年10月末日	1,043,882,585		15,606	
11月末日	1,082,019,797		15,791	
12月末日	1,031,388,798		14,891	
2019年 1月末日	1,092,283,136		15,328	
2月末日	1,131,483,028		15,714	
3月末日	1,150,821,408		15,804	
4月末日	1,149,712,700		16,026	
5月末日	1,173,809,438		15,460	

6月末日	1,221,139,548		15,775
7月末日	1,254,816,946		15,928
8月末日	1,250,761,591		15,644
9月末日	1,300,130,473		16,030
10月末日	1,355,647,909		16,435

## 【分配の推移】

## 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期	2009年 4月14日～2010年 4月13日	0
第3期	2010年 4月14日～2011年 4月13日	0
第4期	2011年 4月14日～2012年 4月13日	0
第5期	2012年 4月14日～2013年 4月15日	0
第6期	2013年 4月16日～2014年 4月14日	0
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	0
第11期	2018年 4月14日～2019年 4月15日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)

	収益率(%)
第2期	16.6
第3期	4.2
第4期	1.1
第5期	29.2
第6期	7.2
第7期	23.3
第8期	8.4
第9期	6.2
第10期	10.7
第11期	2.1
第12期(中間期)	0.5

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## 三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（４資産タイプ）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第2期	2,663,553	1,488
第3期	5,714,228	406,170
第4期	15,496,167	8,248,257
第5期	12,771,148	2,501,161
第6期	18,436,404	8,282,363
第7期	91,471,180	10,189,758
第8期	204,066,027	40,952,813
第9期	154,166,030	32,935,688
第10期	189,774,670	41,690,432
第11期	217,772,319	42,761,022
第12期（中間期）	126,721,643	39,921,216

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## （参考）

## （１）投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年10月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	167,598,094,030	97.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,127,812,432	2.97
合計（純資産総額）		172,725,906,462	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	4,905,390,000	2.83
合計	買建		4,905,390,000	2.83



## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2019年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	104,556,811,440	76.50
地方債証券	日本	8,805,809,620	6.44
特殊債券	日本	15,800,893,741	11.56
社債券	日本	6,452,478,000	4.72
	フランス	200,974,000	0.15
	オーストラリア	200,452,000	0.15
	小計	6,853,904,000	5.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		657,129,929	0.49
合計(純資産総額)		136,674,548,730	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2019年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	138,467,046,194	61.63
	イギリス	12,778,091,838	5.69
	フランス	8,183,235,324	3.64
	カナダ	8,120,325,310	3.61
	スイス	8,089,069,215	3.60
	ドイツ	6,944,741,206	3.09
	オーストラリア	4,803,519,148	2.14
	オランダ	4,161,538,703	1.85
	アイルランド	3,999,081,506	1.78
	スペイン	2,302,260,190	1.02
	スウェーデン	1,974,368,965	0.88
	香港	1,931,293,132	0.86
	イタリア	1,550,311,491	0.69
	デンマーク	1,419,203,829	0.63
	シンガポール	952,435,207	0.42
	フィンランド	907,212,089	0.40
バミューダ	874,522,057	0.39	

	ジャージー	768,920,776	0.34
	ベルギー	751,277,576	0.33
	ケイマン諸島	526,958,311	0.23
	ノルウェー	503,272,353	0.22
	イスラエル	454,798,595	0.20
	キュラソー	253,121,883	0.11
	ルクセンブルグ	223,035,957	0.10
	ニュージーランド	188,604,208	0.08
	オーストリア	185,747,526	0.08
	ポルトガル	125,580,167	0.06
	リベリア	107,651,738	0.05
	パプアニューギニア	38,145,440	0.02
	マン島	29,311,956	0.01
	英ヴァージン諸島	21,465,458	0.01
	モーリシャス	5,941,223	0.00
	小計	211,642,088,571	94.19
投資証券	アメリカ	4,529,688,093	2.02
	オーストラリア	684,557,554	0.30
	フランス	253,577,525	0.11
	香港	163,227,987	0.07
	イギリス	156,118,540	0.07
	シンガポール	93,804,924	0.04
	カナダ	44,788,089	0.02
	小計	5,925,762,712	2.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,119,173,711	3.17
合計(純資産総額)		224,687,024,994	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,044,035,852	2.24
	買建	ドイツ	1,210,178,856	0.53
	買建	イギリス	421,273,530	0.18
	買建	オーストラリア	313,823,500	0.13
合計	買建		6,989,311,738	3.08

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		1,799,767,500	0.80
	売建		230,993,600	0.10

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	アメリカ	80,103,086,755	46.95
	フランス	17,236,705,013	10.10
	イタリア	15,379,192,861	9.01
	イギリス	10,624,385,254	6.23
	ドイツ	9,433,208,149	5.53
	スペイン	9,312,234,533	5.46
	ベルギー	4,240,971,996	2.49
	オーストラリア	3,367,057,412	1.97
	オランダ	3,126,975,189	1.83
	カナダ	3,065,977,250	1.80
	オーストリア	2,431,974,875	1.43
	メキシコ	1,401,589,131	0.82
	アイルランド	1,246,738,680	0.73
	フィンランド	1,234,638,107	0.72
	ポーランド	1,011,620,314	0.59
	南アフリカ	933,544,625	0.55
	デンマーク	883,272,650	0.52
	マレーシア	784,092,496	0.46
	シンガポール	685,441,456	0.40
	スウェーデン	565,617,845	0.33
ノルウェー	382,949,354	0.22	
	小計	167,451,273,945	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,156,634,470	1.85
合計(純資産総額)		170,607,908,415	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

2019年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
特殊債券	日本	1,818,141,640	69.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		789,192,832	30.27
合計(純資産総額)		2,607,334,472	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	793,100	6,802.22	5,394,847,068	7,542.00	5,981,560,200	3.46
日本	株式	ソニー	電気機器	449,900	5,908.12	2,658,063,188	6,625.00	2,980,587,500	1.73
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,832,600	620.93	3,000,717,530	569.80	2,753,615,480	1.59
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	466,800	4,674.36	2,181,991,248	5,376.00	2,509,516,800	1.45
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	592,000	4,375.58	2,590,343,360	3,928.00	2,325,376,000	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	554,400	4,732.97	2,623,962,455	4,190.00	2,322,936,000	1.34
日本	株式	キーエンス	電気機器	32,200	61,470.28	1,979,343,016	68,820.00	2,216,004,000	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	485,800	4,165.83	2,023,760,214	3,880.00	1,884,904,000	1.09
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	487,200	3,116.98	1,518,592,680	3,611.00	1,759,279,200	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	43,600	34,682.81	1,512,170,592	38,620.00	1,683,832,000	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	560,200	3,191.16	1,787,687,832	2,942.00	1,648,108,400	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,539,600	187.38	1,787,582,012	168.80	1,610,284,480	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	520,600	2,661.02	1,385,327,012	2,999.00	1,561,279,400	0.90
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	515,700	2,668.06	1,375,919,475	2,975.00	1,534,207,500	0.89
日本	株式	信越化学工業	化学	122,800	10,107.12	1,241,155,315	12,160.00	1,493,248,000	0.86
日本	株式	花王	化学	170,500	8,356.43	1,424,771,344	8,744.00	1,490,852,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	251,100	5,593.56	1,404,543,856	5,868.00	1,473,454,800	0.85
日本	株式	ファナック	電気機器	67,600	19,318.26	1,305,914,928	21,600.00	1,460,160,000	0.85
日本	株式	第一三共	医薬品	203,600	4,188.68	852,817,070	7,140.00	1,453,704,000	0.84
日本	株式	日立製作所	電気機器	342,000	3,353.76	1,146,988,458	4,069.00	1,391,598,000	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	90,700	12,578.07	1,140,830,949	15,230.00	1,381,361,000	0.80
日本	株式	HOYA	精密機器	143,400	6,929.43	993,680,954	9,603.00	1,377,070,200	0.80
日本	株式	日本電産	電気機器	85,600	15,034.80	1,286,979,000	16,085.00	1,376,876,000	0.80

日本	株式	三菱商事	卸売業	491,700	3,058.86	1,504,044,756	2,764.00	1,359,058,800	0.79
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	59,200	23,330.78	1,381,182,176	22,295.00	1,319,864,000	0.76
日本	株式	資生堂	化学	141,400	7,239.07	1,023,605,704	8,968.00	1,268,075,200	0.73
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	125,200	10,303.61	1,290,012,724	9,849.00	1,233,094,800	0.71
日本	株式	村田製作所	電気機器	209,100	5,745.85	1,201,457,235	5,863.00	1,225,953,300	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	626,100	1,735.78	1,086,776,886	1,858.50	1,163,606,850	0.67
日本	株式	三井物産	卸売業	615,900	1,775.70	1,093,654,450	1,867.50	1,150,193,250	0.67

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年10月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.26
		建設業	2.80
		食料品	3.86
		繊維製品	0.59
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.19
		医薬品	5.64
		石油・石炭製品	0.52
		ゴム製品	0.77
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.59
		機械	5.01
		電気機器	13.55
		輸送用機器	7.75
		精密機器	2.17
		その他製品	2.18
		電気・ガス業	1.57
		陸運業	4.38
		海運業	0.17
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	8.17		
卸売業	4.83		
小売業	4.55		
銀行業	5.69		
証券、商品先物取引業	0.76		
保険業	2.23		

	その他金融業	1.11
	不動産業	2.41
	サービス業	4.93
合計		97.03

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年10月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	103.98	2,110,976,700	103.86	2,108,520,400	0.800	2023/6/20	1.54
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	106.72	1,552,848,750	106.17	1,544,860,800	1.700	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.23	1,339,471,150	104.13	1,338,186,150	0.800	2023/9/20	0.98
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	103.25	1,306,112,500	103.05	1,303,595,150	0.800	2022/9/20	0.95
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	104.50	1,269,760,050	104.27	1,266,989,850	1.000	2023/3/20	0.93
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	111.01	1,132,302,000	110.43	1,126,416,600	2.100	2024/3/20	0.82
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	109.52	1,117,124,400	108.98	1,111,606,200	1.900	2023/12/20	0.81
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	108.99	1,117,229,500	108.43	1,111,448,500	1.900	2023/9/20	0.81
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	103.02	1,097,184,300	102.74	1,094,202,300	0.900	2022/3/20	0.80
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	1,000,000,000	102.57	1,025,750,000	102.13	1,021,310,000	1.200	2021/6/30	0.75
日本	国債証券	第54回利付国債(20年)	965,000,000	106.09	1,023,768,500	105.23	1,015,508,100	2.200	2021/12/20	0.74
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	980,000,000	101.95	999,161,300	102.90	1,008,488,600	0.100	2028/3/20	0.74
日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	980,000,000	103.25	1,011,918,600	102.87	1,008,165,200	1.100	2021/12/20	0.74
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	133.08	987,468,440	133.64	991,675,580	2.400	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	960,000,000	103.30	991,718,400	102.98	988,617,600	1.000	2022/3/20	0.72
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	960,000,000	103.00	988,800,000	102.66	985,536,000	1.000	2021/12/20	0.72
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	114.36	972,119,500	114.12	970,045,500	2.000	2025/12/20	0.71
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	940,000,000	101.90	957,860,000	102.94	967,711,200	0.100	2027/12/20	0.71
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	910,000,000	103.53	942,146,200	102.59	933,596,300	0.100	2029/6/20	0.68
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	910,000,000	101.89	927,211,000	102.49	932,731,800	0.100	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	895,000,000	102.69	919,120,250	102.33	915,925,100	1.000	2021/9/20	0.67
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	900,000,000	102.04	918,428,000	101.71	915,408,000	0.100	2024/6/20	0.67

日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	890,000,000	101.86	906,554,000	102.40	911,377,800	0.100	2026/3/20	0.67
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	870,000,000	101.82	885,834,000	102.86	894,890,700	0.100	2028/6/20	0.65
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	857,000,000	103.12	883,738,400	103.58	887,740,590	0.300	2025/12/20	0.65
日本	国債証券	第70回利付国債（20年）	780,000,000	113.12	882,367,200	112.44	877,086,600	2.400	2024/6/20	0.64
日本	国債証券	第88回利付国債（20年）	742,000,000	117.53	872,080,020	117.23	869,905,960	2.300	2026/6/20	0.64
日本	国債証券	第56回利付国債（20年）	818,000,000	106.68	872,650,580	105.94	866,662,820	2.000	2022/6/20	0.63
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	840,000,000	102.20	858,490,200	102.78	863,402,400	0.100	2027/3/20	0.63
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	838,000,000	101.95	854,341,000	102.69	860,550,580	0.100	2026/12/20	0.63

## ロ 種類別の投資比率

2019年10月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.50
地方債証券	6.44
特殊債券	11.56
社債券	5.01
合計	99.52

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	236,875	20,298.20	4,808,136,388	26,486.14	6,273,906,497	2.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	374,796	12,619.00	4,729,550,901	15,745.13	5,901,214,292	2.63
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	21,555	184,733.66	3,981,934,090	193,805.31	4,177,473,483	1.86
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	123,870	16,230.47	2,010,468,756	20,496.65	2,538,921,274	1.13
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	167,322	12,074.83	2,020,385,130	13,689.48	2,290,551,574	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,120	121,410.80	1,957,142,197	137,329.25	2,213,747,594	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,447	122,055.22	1,885,387,090	137,265.01	2,120,332,702	0.94
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	136,545	15,472.28	2,112,663,791	14,463.61	1,974,934,884	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	158,071	9,899.87	1,564,882,469	11,663.65	1,843,685,578	0.82

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	129,501	10,811.97	1,400,161,363	13,603.46	1,761,662,606	0.78
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	89,446	15,986.33	1,429,913,505	19,516.73	1,745,694,326	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	218,360	8,389.88	1,832,015,972	7,373.35	1,610,045,492	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	466,518	3,071.18	1,432,764,127	3,442.78	1,606,121,453	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	375,323	3,469.18	1,302,063,881	4,159.21	1,561,049,427	0.69
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	67,129	23,329.13	1,566,061,545	23,218.65	1,558,645,427	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	56,586	20,335.63	1,150,712,044	25,721.81	1,455,494,409	0.65
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	231,361	5,263.98	1,217,880,735	6,162.60	1,425,787,149	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	46,953	23,267.25	1,092,467,560	30,176.09	1,416,858,048	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	213,663	6,465.22	1,381,378,564	6,622.08	1,414,893,821	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	49,121	29,253.75	1,436,973,817	27,742.62	1,362,745,434	0.61
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	93,009	12,934.02	1,202,980,642	14,110.84	1,312,435,862	0.58
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	220,662	5,724.77	1,263,239,930	5,665.02	1,250,056,055	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	98,472	12,947.48	1,274,964,459	12,669.27	1,247,569,025	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,835	8,607.90	1,143,431,014	9,387.63	1,247,006,309	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	209,338	5,442.31	1,139,283,210	5,872.98	1,229,439,394	0.55
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	287,130	4,743.50	1,362,001,179	4,189.70	1,202,989,250	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,331	28,754.42	1,044,676,838	32,684.89	1,187,474,993	0.53
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	221,419	5,200.87	1,151,573,350	5,178.33	1,146,581,270	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	234,224	4,406.35	1,032,073,727	4,865.84	1,139,698,195	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	72,524	13,240.93	960,285,832	14,905.67	1,081,018,956	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年10月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.22
		素材	4.16
		資本財	6.90



	商業・専門サービス	1.21
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	1.11
	耐久消費財・アパレル	1.87
	消費者サービス	1.77
	メディア・娯楽	5.72
	小売	4.73
	食品・生活必需品小売り	1.50
	食品・飲料・タバコ	4.72
	家庭用品・パーソナル用品	2.09
	ヘルスケア機器・サービス	4.66
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.93
	銀行	7.72
	各種金融	4.18
	保険	3.73
	不動産	0.71
	ソフトウェア・サービス	9.14
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.35
	電気通信サービス	2.40
	公益事業	3.49
	半導体・半導体製造装置	3.11
投資証券		2.64
合計		96.83

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年10月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	11,800,000	10,969.66	1,294,419,880	10,936.48	1,290,505,310	1.750	2024/6/30	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	10,500,000	10,897.90	1,144,280,348	10,900.75	1,144,579,740	1.750	2021/7/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	8,900,000	10,996.88	978,722,320	11,002.83	979,252,264	2.500	2021/2/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	7,400,000	12,362.14	914,798,600	12,554.37	929,023,708	3.000	2048/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	7,000,000	11,430.25	800,117,745	11,860.26	830,218,509	2.875	2028/8/15	0.49
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	3,900,000	20,857.56	813,445,070	21,142.29	824,549,672	4.750	2034/7/4	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,200,000	10,911.95	785,660,659	11,248.66	809,903,880	2.250	2026/3/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,062.20	696,919,104	11,668.02	735,085,459	2.625	2029/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,200,000	11,241.94	697,000,546	11,440.05	709,283,451	2.375	2029/5/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,564.76	665,580,038	11,193.37	705,182,589	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	10,891.40	675,266,955	11,354.99	704,009,576	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	11,241.87	640,786,681	12,106.09	690,047,415	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,800,000	10,929.41	633,905,995	11,476.63	665,644,685	2.625	2025/12/31	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,512.30	675,615,177	13,248.00	662,400,329	3.000	2022/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,393.68	628,818,202	10,835.26	655,533,305	1.625	2026/5/15	0.38
イタリア	国債証券	BTPS 6.5	3,700,000	17,113.00	633,181,305	17,498.13	647,430,992	6.500	2027/11/1	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.625	4,200,000	15,122.96	635,164,545	15,386.95	646,252,137	4.625	2040/2/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	19,414.16	563,010,825	22,206.16	643,978,855	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,738.29	612,082,530	11,292.04	643,646,674	2.500	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,950,000	10,871.80	646,872,647	10,718.72	637,764,175	1.625	2029/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	5,700,000	11,028.45	628,621,946	11,167.00	636,519,285	2.125	2026/5/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,600,000	10,353.39	579,790,355	11,300.55	632,830,977	2.250	2027/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,653.90	596,618,848	11,243.56	629,639,430	2.375	2024/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	5,800,000	10,870.68	630,499,908	10,849.72	629,283,871	1.500	2022/9/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,439.72	595,064,078	10,927.12	622,846,338	1.750	2023/5/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	5,000,000	12,459.63	622,981,701	12,414.54	620,727,403	0.000	2024/3/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,050,000	14,612.55	591,808,384	15,101.12	611,595,433	2.750	2027/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,567.31	581,202,294	11,013.04	605,717,306	2.000	2023/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	10,862.48	597,436,469	10,995.17	604,734,831	2.625	2020/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000	19,666.80	550,670,489	21,081.20	590,273,737	5.750	2032/10/25	0.35

## □ 種類別の投資比率

2019年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.15
合計	98.15

## マネーインカム・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄

2019年10月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
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	300,000,000	101.15	303,451,000	100.88	302,658,000	1.100	2020/7/31	11.61

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	244,000,000	101.10	246,696,200	100.90	246,203,320	1.000	2020/8/31	9.44
日本	特殊債券	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	100.90	202,813,020	100.11	201,235,170	1.400	2019/11/29	7.72
日本	特殊債券	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101.02	101,026,000	100.95	100,958,000	0.900	2020/10/21	3.87
日本	特殊債券	第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101.22	101,226,000	100.50	100,506,000	1.300	2020/3/13	3.85
日本	特殊債券	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101.07	101,072,000	100.34	100,347,000	1.300	2020/1/31	3.85
日本	特殊債券	第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101.03	101,031,000	100.30	100,306,000	1.300	2020/1/20	3.85
日本	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	100.25	100,254,000	100.24	100,246,000	0.147	2020/11/25	3.84
日本	特殊債券	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100.87	100,873,000	100.19	100,199,000	1.200	2019/12/27	3.84
日本	特殊債券	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	100,000,000	100.26	100,264,000	100.17	100,176,000	0.199	2020/6/18	3.84
日本	特殊債券	第208回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100.14	100,146,000	100.16	100,169,000	0.100	2020/10/6	3.84
日本	特殊債券	第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100.83	100,835,000	100.16	100,161,000	1.200	2019/12/16	3.84
日本	特殊債券	第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100.10	100,109,000	100.03	100,038,000	0.100	2020/1/17	3.84
日本	特殊債券	第5回政府保証阪神高速道路株式会社債券	64,600,000	101.24	65,404,270	100.52	64,939,150	1.300	2020/3/18	2.49

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別の投資比率

2019年10月31日現在

種類	投資比率（％）
特殊債券	69.73
合計	69.73

#### 投資不動産物件

##### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

##### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

##### 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年10月31日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	294	日本円	4,818,439,440	4,905,390,000	2.83

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2019年10月31日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1912	買建	304	米ドル	45,465,474.5	4,950,280,863	46,326,560	5,044,035,852	2.24
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1912	買建	276	ユーロ	9,825,782	1,193,439,482	9,963,600	1,210,178,856	0.53
	オース トラリア	シドニー先 物取引所	SPI200 1912	買建	25	オース トラリア ドル	4,158,287.5	313,035,883	4,168,750	313,823,500	0.13
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1912	買建	41	英ポンド	2,982,282	419,219,381	2,996,895	421,273,530	0.18

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2019年10月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	11,330,000.00	1,235,167,142	1,233,497,100	0.54

カナダドル	買建	810,000.00	67,646,340	66,938,400	0.02
ユーロ	買建	1,780,000.00	215,383,916	216,198,800	0.09
英ポンド	買建	770,000.00	107,872,226	108,231,200	0.04
スイスフラン	買建	570,000.00	62,471,259	62,802,600	0.02
スウェーデンクローナ	買建	1,590,000.00	17,858,778	17,935,200	0.00
ノルウェークローネ	買建	350,000.00	4,139,438	4,147,500	0.00
デンマーククローネ	買建	730,000.00	11,823,872	11,862,500	0.00
オーストラリアドル	買建	600,000.00	44,764,980	45,162,000	0.02
ニュージーランドドル	買建	20,000.00	1,387,828	1,396,200	0.00
香港ドル	買建	1,700,000.00	23,637,811	23,596,000	0.01
シンガポールドル	買建	100,000.00	8,005,160	8,000,000	0.00
米ドル	売建	1,480,000.00	161,043,800	161,103,000	0.07
カナダドル	売建	100,000.00	8,288,500	8,263,000	0.00
ユーロ	売建	210,000.00	25,431,400	25,506,600	0.01
英ポンド	売建	90,000.00	12,618,600	12,649,600	0.00
スイスフラン	売建	60,000.00	6,588,000	6,610,800	0.00
スウェーデンクローナ	売建	380,000.00	4,274,820	4,286,400	0.00
ノルウェークローネ	売建	50,000.00	592,356	592,500	0.00
デンマーククローネ	売建	90,000.00	1,461,310	1,462,500	0.00
オーストラリアドル	売建	90,000.00	6,746,100	6,773,900	0.00
香港ドル	売建	190,000.00	2,638,050	2,637,200	0.00
シンガポールドル	売建	10,000.00	799,600	799,800	0.00
イスラエルシェケル	売建	10,000.00	308,200	308,300	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報

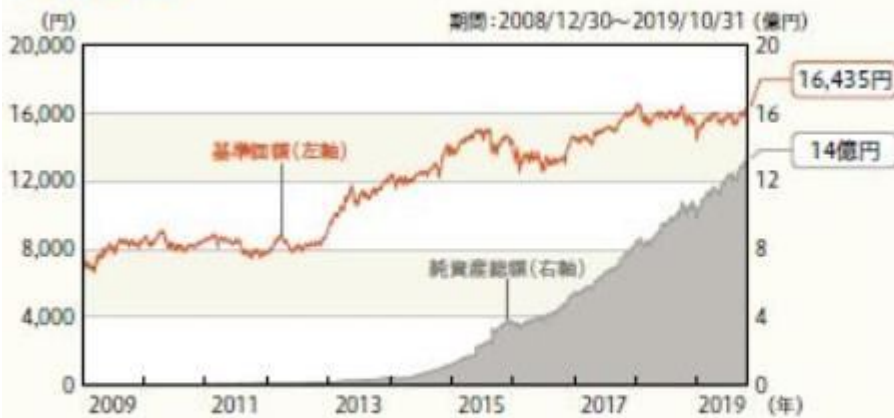
基準日:2019年10月31日

※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

分配の推移

## ▶&lt;2045&gt;



決算期	分配金
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4月	0円
2016年4月	0円
2015年4月	0円
設定来累計	0円

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

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

## ▶&lt;2045&gt;

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
総投資信託受益証券	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	総投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(信託)	31.01
日本	総投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	23.49
日本	総投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	23.34
日本	総投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	19.78
日本	総投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	1.85

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## ■国内株式インデックス・マザーファンド(8号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.97
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.83%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.46
日本	株式	ソニー	電気機器	1.73
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.59
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.45
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.34
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.09
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.02
日本	株式	任天堂	その他製品	0.97

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	76.50
特殊債券	日本	11.56
地方債証券	日本	6.44
社債券	日本	4.72
	フランス	0.15
	オーストラリア	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.49
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.54
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.13
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.98
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	0.95
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.93
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.82
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1.900	2023/12/20	0.81
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1.900	2023/09/20	0.81
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	0.900	2022/03/20	0.80
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	0.75

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	61.63
	イギリス	5.69
	フランス	3.64
	カナダ	3.61
	スイス	3.60
	ドイツ	3.09
	その他	12.93
	投資証券	アメリカ・その他
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.17
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 3.08%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.63
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.86
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.13
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	0.94
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	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	0.78

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.95
	フランス	10.10
	イタリア	9.01
	イギリス	6.23
	ドイツ	5.53
	スペイン	5.46
	ベルギー	2.49
	その他	12.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.85
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2024/06/30	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2021/07/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2021/02/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.49
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4.75	4.750	2034/07/04	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2026/03/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2029/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.41

## ■マネーインカム・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	69.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		30.27
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	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	11.61
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	9.44
日本	特殊債券	第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.400	2019/11/29	7.72
日本	特殊債券	第17回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.900	2020/10/21	3.87
日本	特殊債券	第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.300	2020/03/13	3.85
日本	特殊債券	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2020/01/31	3.85
日本	特殊債券	第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.300	2020/01/20	3.85
日本	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	0.147	2020/11/25	3.84
日本	特殊債券	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.200	2019/12/27	3.84
日本	特殊債券	第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	0.199	2020/06/18	3.84

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



## &lt;2045&gt;



※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年10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) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受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。

## ハ 申込手数料

ありません。

## ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

## ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

#### 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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

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

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

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC2045」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

## (2)【保管】

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

## (3)【信託期間】

2008年3月31日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

## (4)【計算期間】

毎年4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### イ 信託の終了

#### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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、）に支払われます。

八 信託約款の変更等

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

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

る受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日

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

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

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

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### ハ 一部解約実行請求権

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

#### ニ 書面決議における議決権

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

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期(平成30年4月14日から平成31年4月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第10期 (平成30年 4月13日現在)	第11期 (平成31年 4月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,740,992	6,631,312
コール・ローン	1,437,128	562,983
親投資信託受益証券	859,100,251	1,161,485,716
未収入金	3,600,000	1,100,000
流動資産合計	868,878,371	1,169,780,011
資産合計	868,878,371	1,169,780,011
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	563,424
未払受託者報酬	132,499	176,058
未払委託者報酬	1,722,396	2,288,620
未払利息	4	1
その他未払費用	22,698	29,483
流動負債合計	1,877,597	3,057,586
負債合計	1,877,597	3,057,586
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	550,506,470	725,517,767
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	316,494,304	441,204,658
元本等合計	867,000,774	1,166,722,425
純資産合計	867,000,774	1,166,722,425
負債純資産合計	868,878,371	1,169,780,011



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日	自	平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		67,802,119		27,885,465
営業収益合計		67,802,119		27,885,465
営業費用				
支払利息		4,608		4,158
受託者報酬		239,922		332,645
委託者報酬		3,118,869		4,324,275
その他費用		41,214		59,461
営業費用合計		3,404,613		4,720,539
営業利益又は営業損失( )		64,397,506		23,164,926
経常利益又は経常損失( )		64,397,506		23,164,926
当期純利益又は当期純損失( )		64,397,506		23,164,926
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( )		4,820,038		30,703
期首剰余金又は期首欠損金( )		169,875,872		316,494,304
剰余金増加額又は欠損金減少額		105,662,327		126,186,183
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		105,662,327		126,186,183
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,621,363		24,671,458
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,621,363		24,671,458
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( )		316,494,304		441,204,658

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第11期	
	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日	
1. 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>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は当期末が休日のため、平成30年 4月14日から平成31年 4月15日までとなっております。</p>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第10期		第11期	
	（平成30年 4月13日現在）		（平成31年 4月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	550,506,470口		725,517,767口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5749円	1口当たり純資産額	1.6081円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,749円)	(10,000口当たりの純資産額)	16,081円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第10期	第11期
	自 平成29年 4月14日 至 平成30年 4月13日	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,828,814円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(34,314,958円)、収益調整金(276,561,995円)、および分配準備積立金(30,393,776円)より、分配対象収益は355,099,543円(1万口当たり6,450.40円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,839,867円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,355,762円)、収益調整金(394,664,538円)、および分配準備積立金(73,693,864円)より、分配対象収益は491,554,031円(1万口当たり6,775.19円)であります。分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第11期
	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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、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>

項目	第11期 自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
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	第11期 (平成31年 4月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>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。</p>
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>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第10期(自平成29年4月14日 至平成30年4月13日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	65,714,939円
合計	65,714,939円

第11期(自平成30年4月14日 至平成31年4月15日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,602,157円
合計	27,602,157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11期 自平成30年4月14日 至平成31年4月15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10期	第11期
	(平成30年4月13日現在)	(平成31年4月15日現在)
期首元本額	402,422,232円	550,506,470円
期中追加設定元本額	189,774,670円	217,772,319円
期中一部解約元本額	41,690,432円	42,761,022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
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）	144,202,998	369,967,211	
	外国株式インデックス・マザーファンド	75,117,986	276,847,337	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	129,190,063	230,294,206	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	205,486,079	263,433,153	
	マネーインカム・マザーファンド	20,734,392	20,943,809	
合計		574,731,518	1,161,485,716	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

(単位：円)

	(平成30年 4月13日現在)	(平成31年 4月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,296,322,668	2,457,525,367
コール・ローン	696,080,183	208,638,233
株式	176,796,539,042	173,171,361,310
派生商品評価勘定	79,387,680	80,937,960
未収入金	1,143,520	4,824,311
未収配当金	1,668,690,100	1,923,955,847
差入委託証拠金	25,305,000	50,690,000
流動資産合計	181,563,468,193	177,897,933,028
資産合計	181,563,468,193	177,897,933,028
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	212,560	-
前受金	79,430,000	81,195,000
未払解約金	548,844,868	163,338,570

	（平成30年 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
未払利息	2,040	608
その他未払費用	347,014	72,541
流動負債合計	628,836,482	244,606,719
負債合計	628,836,482	244,606,719
純資産の部		
元本等		
元本	68,068,329,504	69,243,723,709
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	112,866,302,207	108,409,602,600
元本等合計	180,934,631,711	177,653,326,309
純資産合計	180,934,631,711	177,653,326,309
負債純資産合計	181,563,468,193	177,897,933,028

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成30年 4月13日現在）	（平成31年 4月15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	2,764,000,000円	株式	2,732,400,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		68,068,329,504口		69,243,723,709口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.6581円 26,581円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	2.5656円 25,656円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式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	(平成31年 4月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120
	東証株価指数先物	4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120
合計		4,003,624,880	-	4,082,800,000	79,175,120

(平成31年 4月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960
	東証株価指数先物	4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960
合計		4,279,422,040	-	4,360,360,000	80,937,960

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在)
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	88,953,399,408円
同期中における追加設定元本額	9,849,755,431円
同期中における一部解約元本額	30,734,825,335円
平成30年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,019,201,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	656,170,114円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,174,611,330円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,341,574,535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)	98,423,118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)	7,451,102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)	23,605,504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)	57,669,775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)	67,460,127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)	37,694,743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)	103,594,831円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,674,090,137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	4,850,049,150円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	530,400,363円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	764,660,113円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	756,226,519円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,128,918円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	312,825円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,379,644円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,116,632円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,707,145円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,494,238円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	2,206,030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)	7,050,490,278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>	29,843,140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>	2,100,013,284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>	3,897,902,109円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	2,575,394,920円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	9,519,506,705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>	58,389,025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>	233,380,829円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	1,265,342円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	1,042,616,592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>	58,305,372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>	403,229,598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>	1,139,461,875円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,176,432,255円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,292,030,822円
S M A M・バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	58,530,027円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,491,761,168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>	70,337,724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>	113,704,142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)	1,676,254,768円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	113,401,289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 >	49,655,788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 >	22,291,989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 >	230,253,415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 >	413,451,782円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	171,547,764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 >	122,157,944円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	60,182,351円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	11,179,619円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	79,078,095円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,028,353,423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 )	199,684,881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 >	21,028,969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 >	1,787,366,166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 >	265,581,987円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,772,189,307円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	308,023,278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 >	7,364,536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 >	70,808,588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 >	33,953,240円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	68,688,360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 >	8,189円
合計	68,068,329,504円

(平成31年 4月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,068,329,504円
同期中における追加設定元本額	13,916,268,555円
同期中における一部解約元本額	12,740,874,350円
平成31年 4月15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	10,274,019,641円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	830,155,477円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,964,449,304円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,853,907,596円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	121,085,132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)	7,938,639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)	26,728,335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)	66,367,789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)	98,546,290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)	58,012,897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)	144,202,998円
国内株式指数ファンド(T O P I X )	1,877,407,552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	9,129,223,248円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,081,860,998円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,029,489,659円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	994,185,788円
イオン・バランス戦略ファンド	72,532,788円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,361,956円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	19,948,207円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	22,326,660円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	78,900,004円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	46,684,329円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	79,518,179円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,293,486円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,402,453,400円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	25,017,073円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	225,151,325円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,454,923,789円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,489,132,334円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,253,609,369円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	59,588,186円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	226,593,592円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	796,449円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	942,907,444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〉	57,187,516円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	382,097,522円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,109,499,058円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	966,355,652円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,118,178,505円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,573,523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)	930,339,818円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	65,794,715円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	46,865,696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)	1,174,726,549円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	107,829,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,426,618円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,746,684円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	212,053,626円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	393,936,535円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	164,873,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	119,503,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	62,251,723円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	9,591,895円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	77,717,022円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	946,967,774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)	201,015,951円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	20,958,549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〉	1,618,468,794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〉	224,746,577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〉	133,073,322円

S M A M ・ 年 金 W リ ス ク コ ン ト ロ ー ル フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	11,331,622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 >	118,884,555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 >	56,899,955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 >	140,273,790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 >	148,327,141円
合 計	69,243,723,709円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘 柄	株 数	評 価 額		備 考
		単 価	金 額	
極洋	3,500	2,861.00	10,013,500	
日本水産	100,400	787.00	79,014,800	
マルハニチロ	14,400	3,665.00	52,776,000	
カネコ種苗	4,000	1,442.00	5,768,000	
サカタのタネ	12,100	3,635.00	43,983,500	
ホクト	8,100	1,926.00	15,600,600	
日鉄鉱業	2,400	4,755.00	11,412,000	
三井松島ホールディングス	5,300	1,291.00	6,842,300	
国際石油開発帝石	404,500	1,059.00	428,365,500	
石油資源開発	14,200	2,453.00	34,832,600	
K & O エナジーグループ	5,100	1,675.00	8,542,500	
ヒノキヤグループ	2,700	2,246.00	6,064,200	
ショーボンドホールディングス	7,200	7,770.00	55,944,000	
ミライト・ホールディングス	28,400	1,654.00	46,973,600	
タマホーム	7,200	1,079.00	7,768,800	
ベステラ	2,700	1,362.00	3,677,400	
T A T E R U	14,000	262.00	3,668,000	
スペースバリューホールディングス	13,800	597.00	8,238,600	
安藤・間	64,300	731.00	47,003,300	
東急建設	29,100	820.00	23,862,000	
コムシスホールディングス	35,600	3,035.00	108,046,000	
ミサワホーム	9,700	770.00	7,469,000	
ピーアールホールディングス	11,500	328.00	3,772,000	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,388.00	15,044,400	
東建コーポレーション	3,100	7,440.00	23,064,000	

大成建設	82,800	4,810.00	398,268,000
大林組	249,800	1,097.00	274,030,600
清水建設	253,800	946.00	240,094,800
飛島建設	8,200	1,415.00	11,603,000
長谷工コーポレーション	103,600	1,368.00	141,724,800
松井建設	11,200	734.00	8,220,800
銭高組	1,300	5,430.00	7,059,000
鹿島建設	194,600	1,599.00	311,165,400
不動テトラ	7,000	1,493.00	10,451,000
大末建設	5,400	929.00	5,016,600
鉄建建設	5,400	2,942.00	15,886,800
西松建設	18,600	2,364.00	43,970,400
三井住友建設	61,500	726.00	44,649,000
大豊建設	5,800	3,065.00	17,777,000
前田建設工業	60,300	1,093.00	65,907,900
奥村組	14,300	3,575.00	51,122,500
東鉄工業	10,000	3,085.00	30,850,000
浅沼組	3,300	2,318.00	7,649,400
戸田建設	97,100	691.00	67,096,100
熊谷組	11,800	3,175.00	37,465,000
北野建設	2,300	3,115.00	7,164,500
矢作建設工業	13,900	783.00	10,883,700
ピーエス三菱	11,100	657.00	7,292,700
日本ハウスホールディングス	20,000	478.00	9,560,000
大東建託	29,700	15,340.00	455,598,000
新日本建設	10,800	979.00	10,573,200
N I P P O	22,200	2,106.00	46,753,200
東亜道路工業	2,300	2,969.00	6,828,700
前田道路	26,100	2,160.00	56,376,000
日本道路	2,400	6,520.00	15,648,000
東亜建設工業	8,300	1,590.00	13,197,000
若築建設	5,800	1,457.00	8,450,600
東洋建設	32,900	419.00	13,785,100
五洋建設	100,700	503.00	50,652,100
世紀東急工業	15,400	581.00	8,947,400
福田組	3,100	4,390.00	13,609,000
住友林業	58,600	1,581.00	92,646,600
巴コーポレーション	16,600	368.00	6,108,800
大和ハウス工業	230,100	3,142.00	722,974,200
ライト工業	16,300	1,497.00	24,401,100
積水ハウス	254,200	1,779.50	452,348,900
日特建設	9,500	588.00	5,586,000

ユアテック	14,300	834.00	11,926,200
中電工	10,800	2,312.00	24,969,600
関電工	37,800	941.00	35,569,800
きんでん	55,200	1,825.00	100,740,000
東京エネシス	9,400	993.00	9,334,200
トーエネック	2,900	3,200.00	9,280,000
住友電設	6,200	1,932.00	11,978,400
日本電設工業	14,100	2,402.00	33,868,200
協和エクシオ	32,500	3,120.00	101,400,000
新日本空調	7,500	1,807.00	13,552,500
九電工	16,300	3,140.00	51,182,000
三機工業	18,800	1,244.00	23,387,200
日揮	72,100	1,734.00	125,021,400
中外炉工業	3,200	1,779.00	5,692,800
ヤマト	10,600	524.00	5,554,400
太平電業	5,800	2,462.00	14,279,600
高砂熱学工業	21,100	1,818.00	38,359,800
朝日工業社	2,300	2,930.00	6,739,000
明星工業	16,600	754.00	12,516,400
大気社	11,400	3,485.00	39,729,000
ダイダン	5,900	2,583.00	15,239,700
日比谷総合設備	8,200	1,899.00	15,571,800
東芝プラントシステム	17,800	2,003.00	35,653,400
OSJBホールディングス	41,700	268.00	11,175,600
新興プランテック	15,500	1,181.00	18,305,500
日本製粉	24,400	1,887.00	46,042,800
日清製粉グループ本社	83,400	2,548.00	212,503,200
日東富士製粉	800	6,370.00	5,096,000
昭和産業	6,800	3,080.00	20,944,000
鳥越製粉	9,100	778.00	7,079,800
中部飼料	9,200	1,210.00	11,132,000
フィード・ワン	52,400	173.00	9,065,200
日本甜菜製糖	5,300	1,898.00	10,059,400
三井製糖	5,500	2,776.00	15,268,000
日新製糖	3,800	2,076.00	7,888,800
森永製菓	18,600	4,680.00	87,048,000
中村屋	2,500	4,415.00	11,037,500
江崎グリコ	22,400	5,720.00	128,128,000
名糖産業	5,400	1,464.00	7,905,600
井村屋グループ	3,600	2,482.00	8,935,200
不二家	4,500	2,197.00	9,886,500
山崎製パン	60,900	1,739.00	105,905,100



モロゾフ	1,600	5,200.00	8,320,000
亀田製菓	4,500	5,220.00	23,490,000
寿スピリッツ	7,800	4,370.00	34,086,000
カルビー	33,900	3,000.00	101,700,000
森永乳業	15,000	3,425.00	51,375,000
六甲バター	5,700	2,126.00	12,118,200
ヤクルト本社	55,100	7,460.00	411,046,000
明治ホールディングス	52,700	8,800.00	463,760,000
雪印メグミルク	17,900	2,474.00	44,284,600
プリマハム	10,000	2,088.00	20,880,000
日本ハム	32,200	4,265.00	137,333,000
丸大食品	8,000	1,949.00	15,592,000
S Foods	6,700	3,970.00	26,599,000
伊藤ハム米久ホールディングス	46,800	696.00	32,572,800
サッポロホールディングス	27,300	2,292.00	62,571,600
アサヒグループホールディングス	155,900	4,902.00	764,221,800
キリンホールディングス	336,800	2,540.50	855,640,400
宝ホールディングス	56,200	1,282.00	72,048,400
オエノンホールディングス	24,800	403.00	9,994,400
養命酒製造	3,200	2,124.00	6,796,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	57,100	2,720.00	155,312,000
サントリー食品インターナショナル	49,700	4,980.00	247,506,000
ダイトーグループホールディングス	4,000	5,080.00	20,320,000
伊藤園	22,600	5,480.00	123,848,000
キーコーヒー	7,200	2,127.00	15,314,400
日清オイリオグループ	9,300	3,285.00	30,550,500
不二製油グループ本社	18,100	3,665.00	66,336,500
かどや製油	1,000	5,190.00	5,190,000
J - オイルミルズ	3,700	4,095.00	15,151,500
キッコーマン	49,000	5,450.00	267,050,000
味の素	164,500	1,719.50	282,857,750
キューピー	41,400	2,593.00	107,350,200
ハウス食品グループ本社	28,300	4,440.00	125,652,000
カゴメ	29,600	3,030.00	89,688,000
焼津水産化学工業	5,700	1,149.00	6,549,300
アリアケジャパン	6,800	6,610.00	44,948,000
ニチレイ	38,600	2,597.00	100,244,200
東洋水産	38,200	4,215.00	161,013,000
イトアンド	3,800	1,668.00	6,338,400
日清食品ホールディングス	31,600	7,900.00	249,640,000
永谷園ホールディングス	4,600	2,413.00	11,099,800
一正蒲鉾	3,900	1,145.00	4,465,500

フジッコ	8,000	2,217.00	17,736,000
ロック・フィールド	8,000	1,638.00	13,104,000
日本たばこ産業	430,100	2,624.50	1,128,797,450
ケンコーマヨネーズ	4,700	2,222.00	10,443,400
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,940.00	9,894,000
なとり	5,500	1,663.00	9,146,500
ピククルスコーポレーション	2,300	2,207.00	5,076,100
北の達人コーポレーション	30,000	514.00	15,420,000
ユーグレナ	31,100	748.00	23,262,800
ミヨシ油脂	4,300	1,170.00	5,031,000
理研ビタミン	3,600	3,595.00	12,942,000
片倉工業	10,000	1,287.00	12,870,000
ゲンゼ	5,000	4,785.00	23,925,000
東洋紡	31,700	1,533.00	48,596,100
ユニチカ	25,300	465.00	11,764,500
富士紡ホールディングス	4,300	2,815.00	12,104,500
倉敷紡績	6,900	2,150.00	14,835,000
シキボウ	6,300	1,029.00	6,482,700
日本毛織	23,800	943.00	22,443,400
ダイドーリミテッド	15,000	334.00	5,010,000
帝国繊維	8,400	2,651.00	22,268,400
帝人	58,900	1,941.00	114,324,900
東レ	563,700	790.30	445,492,110
住江織物	2,600	2,982.00	7,753,200
アツギ	8,700	990.00	8,613,000
ダイニック	6,200	746.00	4,625,200
セーレン	17,900	1,753.00	31,378,700
小松マテーレ	15,100	885.00	13,363,500
ワコールホールディングス	21,400	2,838.00	60,733,200
ホギメディカル	9,200	3,745.00	34,454,000
T S Iホールディングス	27,000	726.00	19,602,000
マツオカコーポレーション	3,000	3,500.00	10,500,000
ワールド	7,400	2,131.00	15,769,400
三陽商会	5,100	1,848.00	9,424,800
オンワードホールディングス	45,400	648.00	29,419,200
ゴールドウイン	6,600	17,510.00	115,566,000
デサント	17,600	2,685.00	47,256,000
特種東海製紙	4,400	4,285.00	18,854,000
王子ホールディングス	325,700	704.00	229,292,800
日本製紙	34,300	2,276.00	78,066,800
三菱製紙	14,800	587.00	8,687,600
北越コーポレーション	46,900	641.00	30,062,900

中越パルプ工業	4,000	1,407.00	5,628,000
巴川製紙所	3,700	1,037.00	3,836,900
大王製紙	35,500	1,354.00	48,067,000
レンゴー	74,100	994.00	73,655,400
トーモク	5,200	1,810.00	9,412,000
ザ・パック	5,400	3,640.00	19,656,000
クラレ	122,100	1,508.00	184,126,800
旭化成	516,800	1,163.50	601,296,800
昭和電工	48,200	4,220.00	203,404,000
住友化学	571,500	544.00	310,896,000
住友精化	3,500	4,410.00	15,435,000
日産化学	44,500	5,190.00	230,955,000
ラサ工業	3,600	1,568.00	5,644,800
クレハ	6,600	7,030.00	46,398,000
多木化学	2,200	5,880.00	12,936,000
テイカ	6,200	2,573.00	15,952,600
石原産業	14,300	1,261.00	18,032,300
日本曹達	11,500	3,085.00	35,477,500
東ソー	111,900	1,841.00	206,007,900
トクヤマ	21,000	2,908.00	61,068,000
セントラル硝子	16,300	2,686.00	43,781,800
東亜合成	46,100	1,270.00	58,547,000
大阪ソーダ	7,800	2,786.00	21,730,800
関東電化工業	17,700	815.00	14,425,500
デンカ	28,400	3,325.00	94,430,000
信越化学工業	128,100	10,610.00	1,359,141,000
日本カーバイド工業	3,200	1,526.00	4,883,200
堺化学工業	5,200	2,660.00	13,832,000
第一稀元素化学工業	7,100	878.00	6,233,800
エア・ウォーター	59,700	1,761.00	105,131,700
大陽日酸	59,900	1,841.00	110,275,900
日本化学工業	2,900	2,170.00	6,293,000
日本パーカライジング	40,100	1,505.00	60,350,500
高压ガス工業	12,800	894.00	11,443,200
四国化成工業	12,300	1,223.00	15,042,900
戸田工業	2,200	2,293.00	5,044,600
ステラ ケミファ	4,600	3,215.00	14,789,000
保土谷化学工業	3,100	3,395.00	10,524,500
日本触媒	12,200	7,850.00	95,770,000
大日精化工業	6,000	3,360.00	20,160,000
カネカ	19,200	4,440.00	85,248,000
三菱瓦斯化学	74,600	1,699.00	126,745,400

三井化学	65,600	2,859.00	187,550,400
J S R	72,900	1,845.00	134,500,500
東京応化工業	12,700	3,500.00	44,450,000
大阪有機化学工業	8,500	1,167.00	9,919,500
三菱ケミカルホールディングス	484,900	808.60	392,090,140
K Hネオケム	11,100	3,270.00	36,297,000
ダイセル	112,700	1,270.00	143,129,000
住友ベークライト	12,600	4,320.00	54,432,000
積水化学工業	159,000	1,858.00	295,422,000
日本ゼオン	65,200	1,194.00	77,848,800
アイカ工業	21,800	3,865.00	84,257,000
宇部興産	36,500	2,500.00	91,250,000
積水樹脂	12,100	2,134.00	25,821,400
タキロンシーアイ	18,900	642.00	12,133,800
旭有機材	5,700	1,858.00	10,590,600
日立化成	33,600	2,622.00	88,099,200
ニチバン	4,300	2,202.00	9,468,600
リケンテクノス	21,800	511.00	11,139,800
大倉工業	4,400	1,907.00	8,390,800
積水化成品工業	12,000	931.00	11,172,000
群栄化学工業	2,500	2,791.00	6,977,500
ダイキョーニシカワ	15,400	1,177.00	18,125,800
森六ホールディングス	4,400	2,658.00	11,695,200
日本化薬	46,000	1,335.00	61,410,000
カーリットホールディングス	9,500	863.00	8,198,500
日本精化	7,300	1,297.00	9,468,100
扶桑化学工業	7,300	2,018.00	14,731,400
トリケミカル研究所	1,800	5,420.00	9,756,000
A D E K A	35,900	1,698.00	60,958,200
日油	27,900	3,880.00	108,252,000
ハリマ化成グループ	7,300	1,119.00	8,168,700
花王	180,100	8,429.00	1,518,062,900
第一工業製薬	3,000	3,775.00	11,325,000
石原ケミカル	2,800	1,771.00	4,958,800
三洋化成工業	4,800	5,540.00	26,592,000
大日本塗料	9,300	1,148.00	10,676,400
日本ペイントホールディングス	59,900	4,455.00	266,854,500
関西ペイント	81,700	2,194.00	179,249,800
中国塗料	24,000	1,100.00	26,400,000
日本特殊塗料	7,100	1,198.00	8,505,800
藤倉化成	12,600	648.00	8,164,800
太陽ホールディングス	5,900	3,890.00	22,951,000

D I C	32,700	3,480.00	113,796,000
サカタインクス	16,000	1,065.00	17,040,000
東洋インキS Cホールディングス	15,200	2,691.00	40,903,200
T & K T O K A	6,600	997.00	6,580,200
富士フィルムホールディングス	154,100	5,279.00	813,493,900
資生堂	147,500	8,152.00	1,202,420,000
ライオン	103,400	2,300.00	237,820,000
高砂香料工業	5,200	3,610.00	18,772,000
マンダム	16,700	2,921.00	48,780,700
ミルボン	9,200	5,450.00	50,140,000
ファンケル	33,000	2,853.00	94,149,000
コーセー	12,500	21,320.00	266,500,000
コタ	4,800	1,280.00	6,144,000
ポーラ・オルビスホールディングス	31,700	3,465.00	109,840,500
ノエビアホールディングス	4,700	5,820.00	27,354,000
エステー	5,800	1,936.00	11,228,800
アグロ カネショウ	3,800	2,227.00	8,462,600
コニシ	13,100	1,778.00	23,291,800
長谷川香料	9,100	1,833.00	16,680,300
星光P M C	8,000	804.00	6,432,000
小林製薬	20,800	9,830.00	204,464,000
荒川化学工業	8,300	1,470.00	12,201,000
メック	6,900	1,168.00	8,059,200
日本高純度化学	3,200	2,356.00	7,539,200
タカラバイオ	19,500	2,434.00	47,463,000
J C U	9,800	1,906.00	18,678,800
デクセリアルズ	19,400	711.00	13,793,400
アース製薬	5,500	5,090.00	27,995,000
北興化学工業	10,500	549.00	5,764,500
大成ラミック	3,600	2,838.00	10,216,800
クミアイ化学工業	30,500	862.00	26,291,000
日本農薬	19,700	459.00	9,042,300
アキレス	5,900	1,958.00	11,552,200
有沢製作所	13,100	871.00	11,410,100
日東電工	55,900	6,124.00	342,331,600
レック	8,100	1,571.00	12,725,100
藤森工業	6,600	3,280.00	21,648,000
前澤化成工業	7,700	1,043.00	8,031,100
未来工業	4,700	2,428.00	11,411,600
J S P	4,800	2,513.00	12,062,400
エフピコ	6,000	6,750.00	40,500,000
天馬	5,600	2,178.00	12,196,800

信越ポリマー	14,000	906.00	12,684,000
東リ	24,400	274.00	6,685,600
ニフコ	29,500	3,170.00	93,515,000
バルカー	6,200	2,406.00	14,917,200
ユニ・チャーム	157,400	3,642.00	573,250,800
協和発酵キリン	86,800	2,155.00	187,054,000
武田薬品工業	647,800	4,277.00	2,770,640,600
アステラス製薬	684,400	1,577.50	1,079,641,000
大日本住友製薬	55,200	2,544.00	140,428,800
塩野義製薬	94,900	6,521.00	618,842,900
田辺三菱製薬	77,500	1,459.00	113,072,500
あすか製薬	9,900	1,164.00	11,523,600
日本新薬	19,400	7,600.00	147,440,000
中外製薬	77,300	6,980.00	539,554,000
科研製薬	13,400	4,880.00	65,392,000
エーザイ	88,800	6,581.00	584,392,800
ロート製薬	38,100	3,015.00	114,871,500
小野薬品工業	175,400	2,075.00	363,955,000
久光製薬	22,000	5,140.00	113,080,000
持田製薬	11,200	5,530.00	61,936,000
参天製薬	140,800	1,652.00	232,601,600
扶桑薬品工業	3,800	2,553.00	9,701,400
日本ケミファ	1,700	2,904.00	4,936,800
ツムラ	23,100	3,370.00	77,847,000
日医工	18,700	1,418.00	26,516,600
キッセイ薬品工業	13,400	2,803.00	37,560,200
生化学工業	14,600	1,194.00	17,432,400
栄研化学	13,100	2,435.00	31,898,500
鳥居薬品	4,200	2,185.00	9,177,000
JCRファーマ	5,200	6,260.00	32,552,000
東和薬品	10,500	2,860.00	30,030,000
富士製薬工業	5,300	1,792.00	9,497,600
沢井製薬	15,300	6,280.00	96,084,000
ゼリア新薬工業	14,700	1,998.00	29,370,600
第一三共	212,400	5,312.00	1,128,268,800
キョーリン製薬ホールディングス	16,700	2,066.00	34,502,200
大幸薬品	4,100	1,820.00	7,462,000
ダイト	4,200	3,405.00	14,301,000
大塚ホールディングス	141,400	4,107.00	580,729,800
大正製薬ホールディングス	16,600	10,440.00	173,304,000
ペプチドリーム	37,100	5,790.00	214,809,000
日本コークス工業	75,000	103.00	7,725,000

ニチレキ	10,100	1,093.00	11,039,300
ユシロ化学工業	4,800	1,346.00	6,460,800
富士石油	23,300	274.00	6,384,200
MORESCO	3,400	1,529.00	5,198,600
出光興産	85,700	3,580.00	306,806,000
JXTGホールディングス	1,248,200	544.20	679,270,440
コスモエネルギーホールディングス	21,300	2,312.00	49,245,600
横浜ゴム	43,800	2,186.00	95,746,800
TOYO TIRE	38,900	1,340.00	52,126,000
ブリヂストン	228,000	4,432.00	1,010,496,000
住友ゴム工業	66,700	1,395.00	93,046,500
オカモト	5,200	5,740.00	29,848,000
ニッタ	8,400	3,805.00	31,962,000
住友理工	14,600	1,048.00	15,300,800
三ツ星ベルト	10,100	2,252.00	22,745,200
バンドー化学	15,200	1,177.00	17,890,400
日東紡績	11,000	2,279.00	25,069,000
AGC	73,200	3,935.00	288,042,000
日本板硝子	31,500	957.00	30,145,500
日本山村硝子	4,500	1,477.00	6,646,500
日本電気硝子	32,100	3,155.00	101,275,500
オハラ	3,100	1,394.00	4,321,400
住友大阪セメント	15,200	4,630.00	70,376,000
太平洋セメント	46,900	3,860.00	181,034,000
日本ヒューム	8,900	773.00	6,879,700
日本コンクリート工業	20,500	288.00	5,904,000
三谷セキサン	3,700	3,085.00	11,414,500
アジアパイルホールディングス	11,700	613.00	7,172,100
東海カーボン	67,300	1,488.00	100,142,400
日本カーボン	3,600	5,310.00	19,116,000
東洋炭素	4,600	2,196.00	10,101,600
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	5,420.00	23,848,000
TOTO	57,000	4,765.00	271,605,000
日本碍子	90,200	1,706.00	153,881,200
日本特殊陶業	62,600	2,267.00	141,914,200
MARUWA	2,600	5,780.00	15,028,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,310.00	7,282,000
黒崎播磨	1,600	5,820.00	9,312,000
ヨータイ	8,700	534.00	4,645,800
東京窯業	12,600	381.00	4,800,600
ニッカトー	4,800	934.00	4,483,200
フジミインコーポレーテッド	6,700	2,478.00	16,602,600

ニチアス	20,300	2,299.00	46,669,700
ニチハ	10,200	3,165.00	32,283,000
日本製鉄	341,300	2,045.00	697,958,500
神戸製鋼所	134,900	875.00	118,037,500
中山製鋼所	13,000	512.00	6,656,000
合同製鐵	4,300	1,734.00	7,456,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,000	1,967.50	389,565,000
東京製鐵	38,800	898.00	34,842,400
共英製鋼	8,400	1,710.00	14,364,000
大和工業	15,700	3,020.00	47,414,000
東京鐵鋼	4,700	1,214.00	5,705,800
大阪製鐵	5,700	1,876.00	10,693,200
淀川製鋼所	10,000	2,187.00	21,870,000
丸一鋼管	26,100	3,215.00	83,911,500
モリ工業	2,700	2,599.00	7,017,300
大同特殊鋼	12,000	4,845.00	58,140,000
日本冶金工業	62,700	258.00	16,176,600
山陽特殊製鋼	9,400	2,427.00	22,813,800
愛知製鋼	4,000	3,485.00	13,940,000
日立金属	79,100	1,304.00	103,146,400
大平洋金属	5,200	2,593.00	13,483,600
新日本電工	50,200	237.00	11,897,400
栗本鐵工所	4,600	1,502.00	6,909,200
三菱製鋼	6,300	1,660.00	10,458,000
シンニッタン	14,700	386.00	5,674,200
大紀アルミニウム工業所	14,100	687.00	9,686,700
日本輕金属ホールディングス	199,600	252.00	50,299,200
三井金属鉱業	20,100	3,040.00	61,104,000
東邦亜鉛	4,100	3,265.00	13,386,500
三菱マテリアル	48,600	3,100.00	150,660,000
住友金属鉱山	100,600	3,597.00	361,858,200
D O W A ホールディングス	17,200	3,790.00	65,188,000
古河機械金属	12,300	1,477.00	18,167,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,700	1,697.00	14,763,900
東邦チタニウム	13,400	963.00	12,904,200
U A C J	11,000	2,190.00	24,090,000
C K サンエツ	1,800	3,145.00	5,661,000
古河電気工業	21,300	3,095.00	65,923,500
住友電気工業	275,000	1,525.50	419,512,500
フジクラ	90,900	459.00	41,723,100
タツタ電線	16,300	498.00	8,117,400
平河ヒューテック	4,000	1,478.00	5,912,000



リョービ	9,000	2,662.00	23,958,000
アーレスティ	11,000	679.00	7,469,000
アサヒホールディングス	13,900	2,052.00	28,522,800
稲葉製作所	5,700	1,427.00	8,133,900
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,903.00	6,279,900
トーカロ	18,800	950.00	17,860,000
アルファC o	4,300	1,336.00	5,744,800
SUMCO	81,300	1,433.00	116,502,900
川田テクノロジーズ	1,700	7,240.00	12,308,000
RS Technologies	2,200	3,480.00	7,656,000
東洋製罐グループホールディングス	46,700	2,302.00	107,503,400
ホッカンホールディングス	4,800	1,925.00	9,240,000
コロナ	5,900	1,097.00	6,472,300
横河ブリッジホールディングス	13,800	1,954.00	26,965,200
三和ホールディングス	75,400	1,356.00	102,242,400
文化シャッター	22,000	824.00	18,128,000
三協立山	10,500	1,302.00	13,671,000
アルインコ	8,900	1,000.00	8,900,000
LIXILグループ	108,600	1,664.00	180,710,400
ノーリツ	16,300	1,790.00	29,177,000
長府製作所	7,200	2,430.00	17,496,000
リンナイ	13,100	7,850.00	102,835,000
日東精工	14,000	607.00	8,498,000
岡部	15,200	1,030.00	15,656,000
ジーテクト	8,200	1,731.00	14,194,200
東プレ	13,500	2,147.00	28,984,500
高周波熱錬	14,600	942.00	13,753,200
東京製綱	7,000	1,062.00	7,434,000
パイオラックス	11,700	2,318.00	27,120,600
エイチワン	9,300	998.00	9,281,400
日本発條	73,000	1,058.00	77,234,000
三益半導体工業	7,400	1,719.00	12,720,600
日本製鋼所	22,500	2,110.00	47,475,000
三浦工業	31,600	2,757.00	87,121,200
タクマ	26,800	1,388.00	37,198,400
ツガミ	18,800	1,048.00	19,702,400
オークマ	9,300	6,470.00	60,171,000
東芝機械	8,200	2,433.00	19,950,600
アマダホールディングス	112,800	1,230.00	138,744,000
アイダエンジニアリング	20,100	891.00	17,909,100
F U J I	21,800	1,619.00	35,294,200
牧野フライス製作所	8,600	4,955.00	42,613,000

オーエスジー	36,200	2,260.00	81,812,000
旭ダイヤモンド工業	19,600	804.00	15,758,400
D M G 森精機	46,100	1,638.00	75,511,800
ソディック	16,100	1,009.00	16,244,900
ディスコ	9,900	18,140.00	179,586,000
日東工器	4,400	2,388.00	10,507,200
日進工具	2,400	2,463.00	5,911,200
豊和工業	5,300	974.00	5,162,200
津田駒工業	2,200	2,015.00	4,433,000
島精機製作所	10,100	3,860.00	38,986,000
オプトラン	7,200	2,458.00	17,697,600
フリー	7,600	1,003.00	7,622,800
ヤマシンフィルタ	13,200	742.00	9,794,400
日阪製作所	10,500	972.00	10,206,000
やまびこ	14,400	1,114.00	16,041,600
平田機工	3,500	7,680.00	26,880,000
ペガサスミシン製造	8,600	660.00	5,676,000
ナプテスコ	40,400	3,555.00	143,622,000
三井海洋開発	7,900	3,560.00	28,124,000
レオン自動機	7,500	1,709.00	12,817,500
S M C	21,700	45,370.00	984,529,000
ホソカワミクロン	2,600	5,310.00	13,806,000
ユニオンツール	3,300	3,090.00	10,197,000
オイレス工業	10,000	1,916.00	19,160,000
日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,125.00	9,487,500
サトーホールディングス	8,900	2,655.00	23,629,500
技研製作所	5,200	3,570.00	18,564,000
日精樹脂工業	7,300	942.00	6,876,600
オカダアイヨン	3,200	1,320.00	4,224,000
小松製作所	336,000	2,807.00	943,152,000
住友重機械工業	42,200	3,955.00	166,901,000
日立建機	29,500	2,927.00	86,346,500
日工	2,800	2,407.00	6,739,600
巴工業	3,700	2,455.00	9,083,500
井関農機	7,900	1,755.00	13,864,500
T O W A	7,800	841.00	6,559,800
北川鉄工所	3,800	2,392.00	9,089,600
ローツェ	3,600	2,695.00	9,702,000
クボタ	397,400	1,620.50	643,986,700
荏原実業	3,500	2,014.00	7,049,000
三菱化工機	3,900	1,563.00	6,095,700
月島機械	15,000	1,480.00	22,200,000

帝国電機製作所	6,000	1,172.00	7,032,000
新東工業	17,600	1,063.00	18,708,800
澁谷工業	6,500	3,560.00	23,140,000
アイチ コーポレーション	14,200	736.00	10,451,200
小森コーポレーション	20,200	1,331.00	26,886,200
鶴見製作所	6,000	2,038.00	12,228,000
住友精密工業	2,000	2,996.00	5,992,000
酒井重工業	2,000	2,996.00	5,992,000
荏原製作所	33,000	3,405.00	112,365,000
西島製作所	9,800	998.00	9,780,400
北越工業	8,100	1,198.00	9,703,800
ダイキン工業	101,300	13,355.00	1,352,861,500
オルガノ	3,100	3,250.00	10,075,000
トーヨーカネツ	3,300	2,125.00	7,012,500
栗田工業	40,000	2,964.00	118,560,000
椿本チエイン	9,600	4,080.00	39,168,000
大同工業	5,700	882.00	5,027,400
アネスト岩田	12,800	988.00	12,646,400
ダイフク	40,800	6,560.00	267,648,000
加藤製作所	4,200	2,810.00	11,802,000
タダノ	36,300	1,169.00	42,434,700
フジテック	27,100	1,377.00	37,316,700
C K D	20,600	1,315.00	27,089,000
キトー	6,100	1,800.00	10,980,000
平和	20,400	2,269.00	46,287,600
理想科学工業	6,600	1,892.00	12,487,200
S A N K Y O	18,700	4,400.00	82,280,000
日本金銭機械	9,400	1,229.00	11,552,600
マースグループホールディングス	5,200	2,196.00	11,419,200
福島工業	4,600	3,970.00	18,262,000
ダイコク電機	4,300	1,526.00	6,561,800
竹内製作所	12,400	2,071.00	25,680,400
アマノ	21,200	2,635.00	55,862,000
J U K I	10,600	1,262.00	13,377,200
サンデンホールディングス	9,700	848.00	8,225,600
蛇の目マシン工業	10,400	480.00	4,992,000
マックス	11,400	1,757.00	20,029,800
グローリー	20,700	2,814.00	58,249,800
新晃工業	7,400	1,640.00	12,136,000
大和冷機工業	10,800	1,242.00	13,413,600
セガサミーホールディングス	74,200	1,355.00	100,541,000
日本ピストンリング	3,500	1,614.00	5,649,000

リケン	3,400	5,510.00	18,734,000
T P R	9,800	2,284.00	22,383,200
ツバキ・ナカシマ	11,400	2,050.00	23,370,000
ホシザキ	21,800	7,460.00	162,628,000
大豊工業	6,900	1,005.00	6,934,500
日本精工	150,900	1,139.00	171,875,100
N T N	157,600	371.00	58,469,600
ジェイテクト	70,300	1,490.00	104,747,000
不二越	7,000	5,230.00	36,610,000
日本トムソン	23,600	561.00	13,239,600
T H K	46,300	3,030.00	140,289,000
ユーシン精機	6,300	1,229.00	7,742,700
前澤給装工業	4,100	1,945.00	7,974,500
イーグル工業	10,300	1,302.00	13,410,600
日本ピラー工業	8,300	1,374.00	11,404,200
キッツ	30,000	850.00	25,500,000
マキタ	90,300	4,025.00	363,457,500
日立造船	57,100	348.00	19,870,800
三菱重工業	124,400	4,631.00	576,096,400
I H I	57,100	2,695.00	153,884,500
スター精密	12,400	1,805.00	22,382,000
日清紡ホールディングス	41,900	1,035.00	43,366,500
イビデン	45,700	1,779.00	81,300,300
コニカミノルタ	161,900	1,127.00	182,461,300
ブラザー工業	96,400	2,198.00	211,887,200
ミネベアミツミ	137,600	1,921.00	264,329,600
日立製作所	334,200	3,655.00	1,221,501,000
三菱電機	741,600	1,556.50	1,154,300,400
富士電機	48,100	3,410.00	164,021,000
東洋電機製造	4,400	1,353.00	5,953,200
安川電機	86,100	4,090.00	352,149,000
シンフォニアテクノロジー	10,500	1,583.00	16,621,500
明電舎	14,700	1,647.00	24,210,900
オリジン	3,200	2,137.00	6,838,400
山洋電気	3,600	4,885.00	17,586,000
デンヨー	7,700	1,439.00	11,080,300
東芝テック	9,100	3,300.00	30,030,000
芝浦メカトロニクス	1,700	3,980.00	6,766,000
マブチモーター	20,400	4,020.00	82,008,000
日本電産	89,300	15,840.00	1,414,512,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	1,598.00	6,711,600
トレックス・セミコンダクター	3,400	1,267.00	4,307,800

東光高岳	4,600	1,407.00	6,472,200
ダブル・スコープ	11,200	1,655.00	18,536,000
ダイヘン	8,200	3,125.00	25,625,000
ヤーマン	10,800	1,171.00	12,646,800
JVCケンウッド	57,500	276.00	15,870,000
ミマキエンジニアリング	7,700	657.00	5,058,900
第一精工	3,900	1,161.00	4,527,900
日新電機	17,500	1,073.00	18,777,500
大崎電気工業	16,200	739.00	11,971,800
オムロン	78,900	5,800.00	457,620,000
日東工業	12,100	2,280.00	27,588,000
I D E C	10,200	2,163.00	22,062,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,900	2,317.00	62,327,300
サクサホールディングス	2,700	1,746.00	4,714,200
メルコホールディングス	3,200	3,860.00	12,352,000
日本電気	96,200	3,895.00	374,699,000
富士通	71,600	8,102.00	580,103,200
沖電気工業	32,800	1,342.00	44,017,600
電気興業	4,100	3,345.00	13,714,500
サンケン電気	8,900	2,460.00	21,894,000
アイホン	5,400	1,815.00	9,801,000
ルネサスエレクトロニクス	75,300	610.00	45,933,000
セイコーエプソン	91,800	1,767.00	162,210,600
ワコム	55,300	471.00	26,046,300
アルバック	14,900	3,640.00	54,236,000
E I Z O	6,800	4,505.00	30,634,000
日本信号	18,800	1,050.00	19,740,000
京三製作所	18,500	422.00	7,807,000
能美防災	9,900	1,949.00	19,295,100
ホーチキ	5,500	1,240.00	6,820,000
エレコム	6,900	3,715.00	25,633,500
パナソニック	847,400	1,020.50	864,771,700
シャープ	73,900	1,281.00	94,665,900
アンリツ	48,000	2,209.00	106,032,000
富士通ゼネラル	23,300	1,590.00	37,047,000
ソニー	497,600	5,220.00	2,597,472,000
T D K	38,800	9,450.00	366,660,000
帝国通信工業	5,400	1,223.00	6,604,200
タムラ製作所	28,600	707.00	20,220,200
アルプスアルパイン	77,200	2,377.00	183,504,400
日本トリム	1,600	5,730.00	9,168,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,490.00	10,707,000

フォスター電機	9,000	1,719.00	15,471,000
S M K	2,600	2,779.00	7,225,400
ヨコオ	5,700	1,773.00	10,106,100
ホシデン	21,900	1,003.00	21,965,700
ヒロセ電機	10,600	12,590.00	133,454,000
日本航空電子工業	16,800	1,650.00	27,720,000
T O A	8,600	1,203.00	10,345,800
マクセルホールディングス	16,100	1,644.00	26,468,400
古野電気	10,100	1,106.00	11,170,600
ユニデンホールディングス	2,900	2,512.00	7,284,800
スミダコーポレーション	7,000	1,731.00	12,117,000
アイコム	4,700	2,242.00	10,537,400
リオン	4,000	2,119.00	8,476,000
本多通信工業	8,300	560.00	4,648,000
船井電機	10,700	790.00	8,453,000
横河電機	74,300	2,359.00	175,273,700
新電元工業	2,800	4,645.00	13,006,000
アズビル	47,900	2,762.00	132,299,800
東亜ディーケーケー	4,600	838.00	3,854,800
日本光電工業	32,800	3,270.00	107,256,000
チノー	4,500	1,349.00	6,070,500
共和電業	15,800	418.00	6,604,400
堀場製作所	14,800	6,560.00	97,088,000
アドバンテスト	50,700	3,090.00	156,663,000
エスペック	6,700	2,195.00	14,706,500
キーエンス	36,400	71,970.00	2,619,708,000
日置電機	4,000	5,050.00	20,200,000
シスメックス	57,800	6,400.00	369,920,000
日本マイクロニクス	13,400	855.00	11,457,000
メガチップス	6,300	1,927.00	12,140,100
O B A R A G R O U P	4,300	4,205.00	18,081,500
コーセル	11,400	1,229.00	14,010,600
イリソ電子工業	6,800	5,690.00	38,692,000
オブテックスグループ	13,200	1,917.00	25,304,400
千代田インテグレ	3,600	2,063.00	7,426,800
アイ・オー・データ機器	4,300	1,205.00	5,181,500
レーザーテック	15,200	5,080.00	77,216,000
スタンレー電気	52,300	3,295.00	172,328,500
岩崎電気	4,700	1,410.00	6,627,000
ウシオ電機	45,600	1,369.00	62,426,400
ヘリオス テクノ ホールディング	8,800	696.00	6,124,800
日本セラミック	7,700	3,110.00	23,947,000

古河電池	6,800	728.00	4,950,400
山一電機	5,800	1,263.00	7,325,400
図研	5,400	1,565.00	8,451,000
日本電子	14,700	2,240.00	32,928,000
カシオ計算機	65,700	1,400.00	91,980,000
ファナック	70,500	21,580.00	1,521,390,000
日本シイエムケイ	19,400	768.00	14,899,200
エンプラス	3,700	3,030.00	11,211,000
ローム	35,900	7,930.00	284,687,000
浜松ホトニクス	53,200	4,535.00	241,262,000
三井ハイテック	8,700	1,267.00	11,022,900
新光電気工業	24,300	905.00	21,991,500
京セラ	113,100	6,873.00	777,336,300
太陽誘電	33,200	2,606.00	86,519,200
村田製作所	233,400	5,789.00	1,351,152,600
ユーシン	13,900	982.00	13,649,800
双葉電子工業	12,100	1,821.00	22,034,100
ニチコン	23,800	1,066.00	25,370,800
日本ケミコン	3,400	2,309.00	7,850,600
K O A	11,500	1,677.00	19,285,500
市光工業	11,700	700.00	8,190,000
小糸製作所	44,300	6,760.00	299,468,000
ミツバ	14,300	757.00	10,825,100
S C R E E Nホールディングス	13,000	5,150.00	66,950,000
キャノン電子	6,900	1,864.00	12,861,600
キャノン	399,100	3,258.00	1,300,267,800
リコー	223,500	1,143.00	255,460,500
象印マホービン	14,200	1,161.00	16,486,200
東京エレクトロン	49,500	17,565.00	869,467,500
トヨタ紡織	25,700	1,773.00	45,566,100
ユニプレス	14,100	1,868.00	26,338,800
豊田自動織機	59,900	6,070.00	363,593,000
モリタホールディングス	12,900	1,956.00	25,232,400
三櫻工業	11,900	550.00	6,545,000
デンソー	163,100	4,854.00	791,687,400
東海理化電機製作所	19,600	2,077.00	40,709,200
三井E & Sホールディングス	27,700	1,244.00	34,458,800
川崎重工業	57,800	2,776.00	160,452,800
名村造船所	25,400	395.00	10,033,000
日本車輛製造	3,300	2,520.00	8,316,000
三菱ロジスネクスト	9,200	1,323.00	12,171,600
日産自動車	874,800	936.40	819,162,720

いすゞ自動車	234,200	1,553.00	363,712,600	
トヨタ自動車	827,000	6,831.00	5,649,237,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	92,600	1,002.00	92,785,200	
三菱自動車工業	275,000	622.00	171,050,000	
エフテック	6,700	945.00	6,331,500	
武蔵精密工業	17,900	1,690.00	30,251,000	
日産車体	14,200	1,016.00	14,427,200	
新明和工業	33,200	1,383.00	45,915,600	
極東開発工業	14,900	1,570.00	23,393,000	
日信工業	13,200	1,504.00	19,852,800	
トピー工業	6,300	2,456.00	15,472,800	
ティラド	3,500	2,442.00	8,547,000	
タチエス	13,000	1,715.00	22,295,000	
N O K	39,800	1,820.00	72,436,000	
フタバ産業	21,300	681.00	14,505,300	
K Y B	7,900	2,993.00	23,644,700	
大同メタル工業	13,900	739.00	10,272,100	
プレス工業	37,100	600.00	22,260,000	
ミクニ	11,800	450.00	5,310,000	
太平洋工業	15,500	1,707.00	26,458,500	
ケーヒン	16,600	1,898.00	31,506,800	
河西工業	9,900	953.00	9,434,700	
アイシン精機	60,900	4,390.00	267,351,000	
マツダ	232,800	1,314.50	306,015,600	
今仙電機製作所	8,800	1,069.00	9,407,200	
本田技研工業	626,100	3,119.00	1,952,805,900	
スズキ	135,800	4,834.00	656,457,200	
S U B A R U	230,400	2,763.50	636,710,400	
安永	4,100	1,862.00	7,634,200	
ヤマハ発動機	104,500	2,395.00	250,277,500	
ショーワ	17,600	1,585.00	27,896,000	
T B K	16,500	424.00	6,996,000	
エクセディ	9,700	2,627.00	25,481,900	
豊田合成	24,000	2,566.00	61,584,000	
愛三工業	12,900	754.00	9,726,600	
日本プラスト	7,800	828.00	6,458,400	
ヨロズ	7,900	1,705.00	13,469,500	
エフ・シー・シー	13,400	2,387.00	31,985,800	
シマノ	29,900	18,600.00	556,140,000	
テイ・エス テック	17,300	3,470.00	60,031,000	
ジャムコ	4,000	2,380.00	9,520,000	
テルモ	209,800	3,415.00	716,467,000	



日機装	23,500	1,427.00	33,534,500
島津製作所	95,300	3,290.00	313,537,000
JMS	10,000	682.00	6,820,000
長野計器	7,400	833.00	6,164,200
ブイ・テクノロジー	1,700	16,340.00	27,778,000
東京計器	6,000	1,153.00	6,918,000
インターアクション	4,300	1,600.00	6,880,000
東京精密	13,200	3,115.00	41,118,000
マニー	9,000	6,130.00	55,170,000
ニコン	129,400	1,600.00	207,040,000
トプコン	39,700	1,353.00	53,714,100
オリンパス	442,800	1,242.00	549,957,600
理研計器	6,400	2,267.00	14,508,800
タムロン	6,500	2,277.00	14,800,500
HOYA	149,500	7,620.00	1,139,190,000
シード	3,500	1,088.00	3,808,000
ノーリツ鋼機	6,100	2,102.00	12,822,200
エー・アンド・デイ	7,900	944.00	7,457,600
朝日インテック	31,500	5,240.00	165,060,000
シチズン時計	81,400	621.00	50,549,400
リズム時計工業	3,500	1,339.00	4,686,500
大研医器	8,500	552.00	4,692,000
メニコン	10,200	3,170.00	32,334,000
松風	5,100	1,279.00	6,522,900
セイコーホールディングス	11,100	2,635.00	29,248,500
ニプロ	51,700	1,391.00	71,914,700
スノーピーク	3,600	1,547.00	5,569,200
パラマウントベッドホールディングス	8,300	5,120.00	42,496,000
トランザクション	5,100	779.00	3,972,900
ニホンフラッシュ	3,600	2,328.00	8,380,800
前田工織	8,200	2,429.00	19,917,800
永大産業	14,700	447.00	6,570,900
アートネイチャー	10,700	642.00	6,869,400
バンダイナムコホールディングス	76,800	5,140.00	394,752,000
SHOEI	3,700	4,810.00	17,797,000
フランスベッドホールディングス	12,800	933.00	11,942,400
パイロットコーポレーション	13,000	4,545.00	59,085,000
萩原工業	4,700	1,486.00	6,984,200
トッパン・フォームズ	15,700	994.00	15,605,800
フジシールインターナショナル	16,700	3,820.00	63,794,000
タカラトミー	31,000	1,177.00	36,487,000
廣濟堂	10,100	778.00	7,857,800

プロネクサス	7,900	1,340.00	10,586,000
大建工業	5,800	2,146.00	12,446,800
凸版印刷	105,200	1,808.00	190,201,600
大日本印刷	104,500	2,668.00	278,806,000
図書印刷	8,800	964.00	8,483,200
共同印刷	3,000	2,530.00	7,590,000
N I S S H A	15,400	1,240.00	19,096,000
宝印刷	5,100	1,716.00	8,751,600
アシックス	74,100	1,439.00	106,629,900
ヤマハ	44,100	5,890.00	259,749,000
河合楽器製作所	2,600	3,000.00	7,800,000
クリナップ	9,500	656.00	6,232,000
ビジョン	44,900	4,650.00	208,785,000
キングジム	8,800	879.00	7,735,200
リンテック	17,900	2,468.00	44,177,200
イトーキ	15,800	570.00	9,006,000
任天堂	45,700	34,280.00	1,566,596,000
三菱鉛筆	12,000	2,216.00	26,592,000
タカラスタンダード	14,600	1,784.00	26,046,400
コクヨ	35,600	1,640.00	58,384,000
ナカバヤシ	10,000	526.00	5,260,000
グローブライド	3,900	3,175.00	12,382,500
オカムラ	25,400	1,204.00	30,581,600
美津濃	7,400	2,632.00	19,476,800
東京電力ホールディングス	592,500	644.00	381,570,000
中部電力	226,500	1,658.50	375,650,250
関西電力	302,600	1,629.00	492,935,400
中国電力	102,800	1,360.00	139,808,000
北陸電力	73,400	819.00	60,114,600
東北電力	172,900	1,403.00	242,578,700
四国電力	67,000	1,312.00	87,904,000
九州電力	152,300	1,243.00	189,308,900
北海道電力	70,100	627.00	43,952,700
沖縄電力	13,300	1,902.00	25,296,600
電源開発	58,900	2,657.00	156,497,300
エフオン	5,800	788.00	4,570,400
イーレックス	12,400	1,031.00	12,784,400
レノバ	9,400	945.00	8,883,000
東京瓦斯	145,300	2,872.50	417,374,250
大阪瓦斯	143,600	2,109.00	302,852,400
東邦瓦斯	36,700	4,810.00	176,527,000
北海道瓦斯	5,400	1,456.00	7,862,400

広島ガス	21,900	359.00	7,862,100
西部瓦斯	8,000	2,409.00	19,272,000
静岡ガス	22,600	927.00	20,950,200
メタウォーター	3,900	3,190.00	12,441,000
SBSホールディングス	7,700	1,973.00	15,192,100
東武鉄道	78,000	3,110.00	242,580,000
相鉄ホールディングス	25,300	3,240.00	81,972,000
東京急行電鉄	201,100	1,813.00	364,594,300
京浜急行電鉄	101,700	1,833.00	186,416,100
小田急電鉄	118,600	2,569.00	304,683,400
京王電鉄	41,400	6,600.00	273,240,000
京成電鉄	55,300	3,915.00	216,499,500
富士急行	10,200	4,285.00	43,707,000
新京成電鉄	3,600	2,090.00	7,524,000
東日本旅客鉄道	131,900	10,320.00	1,361,208,000
西日本旅客鉄道	66,400	8,247.00	547,600,800
東海旅客鉄道	66,400	24,415.00	1,621,156,000
西武ホールディングス	94,800	1,835.00	173,958,000
鴻池運輸	11,800	1,860.00	21,948,000
西日本鉄道	20,900	2,636.00	55,092,400
ハマキョウレックス	5,700	4,340.00	24,738,000
サカイ引越センター	3,900	6,750.00	26,325,000
近鉄グループホールディングス	70,100	4,905.00	343,840,500
阪急阪神ホールディングス	93,500	4,070.00	380,545,000
南海電気鉄道	31,400	2,934.00	92,127,600
京阪ホールディングス	31,200	4,470.00	139,464,000
神戸電鉄	2,700	4,045.00	10,921,500
名古屋鉄道	56,100	2,986.00	167,514,600
山陽電気鉄道	6,000	2,225.00	13,350,000
日本通運	27,600	6,150.00	169,740,000
ヤマトホールディングス	123,000	2,833.00	348,459,000
山九	19,500	5,220.00	101,790,000
丸全昭和運輸	5,900	3,040.00	17,936,000
センコーグループホールディングス	38,600	910.00	35,126,000
トナミホールディングス	1,800	6,260.00	11,268,000
ニッコンホールディングス	26,600	2,728.00	72,564,800
福山通運	8,900	4,435.00	39,471,500
セイノーホールディングス	52,800	1,534.00	80,995,200
神奈川中央交通	2,500	3,880.00	9,700,000
日立物流	15,500	3,260.00	50,530,000
丸和運輸機関	3,800	3,990.00	15,162,000
C&Fロジホールディングス	8,600	1,319.00	11,343,400

九州旅客鉄道	58,800	3,575.00	210,210,000
S Gホールディングス	66,500	3,200.00	212,800,000
日本郵船	58,700	1,774.00	104,133,800
商船三井	41,600	2,710.00	112,736,000
川崎汽船	22,100	1,446.00	31,956,600
N Sユナイテッド海運	4,200	2,530.00	10,626,000
飯野海運	35,500	389.00	13,809,500
乾汽船	8,400	891.00	7,484,400
日本航空	128,800	3,836.00	494,076,800
A N Aホールディングス	128,600	4,052.00	521,087,200
トランコム	2,000	6,550.00	13,100,000
日新	6,600	1,990.00	13,134,000
三菱倉庫	24,400	3,115.00	76,006,000
三井倉庫ホールディングス	8,600	1,792.00	15,411,200
住友倉庫	26,500	1,447.00	38,345,500
澁澤倉庫	5,500	1,788.00	9,834,000
東陽倉庫	25,300	325.00	8,222,500
日本トランスシティ	19,500	463.00	9,028,500
川西倉庫	2,800	1,342.00	3,757,600
安田倉庫	8,700	882.00	7,673,400
東洋埠頭	3,800	1,525.00	5,795,000
上組	42,800	2,681.00	114,746,800
キューソー流通システム	2,300	2,104.00	4,839,200
近鉄エクスプレス	13,300	1,740.00	23,142,000
エーアイティー	5,700	1,178.00	6,714,600
N E C ネットエスアイ	7,900	2,738.00	21,630,200
システナ	26,100	1,311.00	34,217,100
デジタルアーツ	3,900	9,690.00	37,791,000
日鉄ソリューションズ	10,900	2,957.00	32,231,300
キューブシステム	6,800	819.00	5,569,200
コア	4,400	1,205.00	5,302,000
ソリトンシステムズ	5,700	1,033.00	5,888,100
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,593.00	7,009,200
T I S	24,200	5,300.00	128,260,000
ネオス	3,200	1,124.00	3,596,800
電算システム	3,600	3,420.00	12,312,000
グリー	49,700	455.00	22,613,500
コーエーテクモホールディングス	14,800	2,086.00	30,872,800
三菱総合研究所	3,300	3,260.00	10,758,000
ファインデックス	8,100	845.00	6,844,500
ブレインパッド	1,700	5,950.00	10,115,000
K L a b	13,400	831.00	11,135,400

ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	10,300	1,035.00	10,660,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,642.00	2,791,400
ネクソン	185,700	1,680.00	311,976,000
アイスタイル	18,900	805.00	15,214,500
エムアップ	2,700	2,484.00	6,706,800
エイチーム	5,100	1,759.00	8,970,900
テクノスジャパン	6,900	712.00	4,912,800
コロプラ	21,600	671.00	14,493,600
ブロードリーフ	37,200	574.00	21,352,800
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,286.00	5,529,800
メディアドゥホールディングス	2,700	2,882.00	7,781,400
じげん	9,300	566.00	5,263,800
フィックスターズ	7,500	1,322.00	9,915,000
CARTA HOLDINGS	4,800	1,241.00	5,956,800
オブティム	3,600	2,235.00	8,046,000
セレス	2,800	2,127.00	5,955,600
ティーガイア	7,300	1,834.00	13,388,200
セック	1,400	3,685.00	5,159,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,102.00	7,824,200
テクマトリックス	5,500	1,914.00	10,527,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	177,000	372.00	65,844,000
GMOペイメントゲートウェイ	12,100	8,720.00	105,512,000
システムリサーチ	1,400	2,760.00	3,864,000
インターネットイニシアティブ	12,000	2,296.00	27,552,000
さくらインターネット	11,000	523.00	5,753,000
ヴィンクス	3,000	1,179.00	3,537,000
GMOクラウド	2,000	4,420.00	8,840,000
SRAホールディングス	4,300	2,478.00	10,655,400
eBASE	5,800	1,088.00	6,310,400
アドソル日進	3,000	1,698.00	5,094,000
フリービット	5,800	1,203.00	6,977,400
コムチュア	4,400	3,695.00	16,258,000
アステリア	4,800	842.00	4,041,600
マークライنز	3,600	1,550.00	5,580,000
メディカル・データ・ビジョン	7,000	1,035.00	7,245,000
gumi	10,200	663.00	6,762,600
モバイルファクトリー	2,700	1,350.00	3,645,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,524.00	5,486,400
PCIホールディングス	1,700	2,449.00	4,163,300
オープンドア	3,900	3,090.00	12,051,000
マイネット	2,700	973.00	2,627,100
アカツキ	2,600	5,640.00	14,664,000

LINE	22,400	3,800.00	85,120,000
チェンジ	1,100	4,100.00	4,510,000
オークネット	5,200	1,254.00	6,520,800
AOI TYO Holdings	8,700	760.00	6,612,000
マクロミル	12,600	1,379.00	17,375,400
オロ	900	7,140.00	6,426,000
フェイス	5,300	871.00	4,616,300
野村総合研究所	46,300	5,240.00	242,612,000
サイバネットシステム	8,000	561.00	4,488,000
インテージホールディングス	10,700	936.00	10,015,200
ソースネクスト	28,800	453.00	13,046,400
インフォコム	6,200	1,758.00	10,899,600
アルテリア・ネットワークス	6,500	1,342.00	8,723,000
フォーカスシステムズ	6,000	962.00	5,772,000
クレスコ	2,500	3,370.00	8,425,000
フジ・メディア・ホールディングス	76,100	1,512.00	115,063,200
オービック	25,300	11,930.00	301,829,000
ジャストシステム	10,400	2,928.00	30,451,200
TDCソフト	7,400	896.00	6,630,400
ヤフー	476,700	279.00	132,999,300
トレンドマイクロ	38,900	5,540.00	215,506,000
日本オラクル	14,700	7,480.00	109,956,000
アルファシステムズ	2,900	2,839.00	8,233,100
フューチャー	10,300	1,958.00	20,167,400
CAC Holdings	7,200	1,607.00	11,570,400
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	2,357.00	8,013,800
オービックビジネスコンサルタント	7,300	4,735.00	34,565,500
伊藤忠テクノソリューションズ	33,100	2,625.00	86,887,500
アイティフォー	10,300	921.00	9,486,300
大塚商会	39,400	4,435.00	174,739,000
サイボウズ	10,600	1,028.00	10,896,800
電通国際情報サービス	4,600	3,785.00	17,411,000
デジタルガレージ	14,300	3,240.00	46,332,000
EMシステムズ	7,200	1,430.00	10,296,000
ウェザーニューズ	3,000	3,245.00	9,735,000
C I J	9,000	851.00	7,659,000
WOWOW	3,600	2,889.00	10,400,400
スカラ	7,700	918.00	7,068,600
IMAGICA GROUP	7,400	607.00	4,491,800
ネットワンシステムズ	25,800	2,877.00	74,226,600
アルゴグラフィックス	6,400	2,376.00	15,206,400
マーベラス	12,200	857.00	10,455,400

エイベックス	12,800	1,425.00	18,240,000
日本ユニシス	22,300	2,874.00	64,090,200
兼松エレクトロニクス	4,000	3,255.00	13,020,000
東京放送ホールディングス	48,400	2,122.00	102,704,800
日本テレビホールディングス	67,100	1,670.00	112,057,000
朝日放送グループホールディングス	10,500	794.00	8,337,000
テレビ朝日ホールディングス	20,600	1,991.00	41,014,600
スカパーJ S A Tホールディングス	55,600	457.00	25,409,200
テレビ東京ホールディングス	6,100	2,300.00	14,030,000
ビジョン	2,400	5,170.00	12,408,000
USEN - N E X T H O L D I N G S	3,400	850.00	2,890,000
コネクシオ	6,000	1,441.00	8,646,000
日本電信電話	498,300	4,618.00	2,301,149,400
K D D I	642,000	2,385.00	1,531,170,000
ソフトバンク	579,300	1,294.50	749,903,850
光通信	8,600	20,770.00	178,622,000
N T T ドコモ	460,800	2,304.50	1,061,913,600
エムティーアイ	10,200	630.00	6,426,000
G M O インターネット	26,500	1,910.00	50,615,000
カドカワ	21,500	1,395.00	29,992,500
学研ホールディングス	2,600	5,480.00	14,248,000
ゼンリン	14,500	2,568.00	37,236,000
アイネット	5,200	1,357.00	7,056,400
松竹	4,900	13,250.00	64,925,000
東宝	48,000	4,430.00	212,640,000
東映	3,000	14,890.00	44,670,000
エヌ・ティ・ティ・データ	193,600	1,256.00	243,161,600
D T S	8,100	3,920.00	31,752,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,000	3,585.00	121,890,000
シーイーシー	7,800	2,189.00	17,074,200
カブコン	31,600	2,461.00	77,767,600
アイ・エス・ビー	2,200	1,918.00	4,219,600
ジャステック	5,800	990.00	5,742,000
S C S K	19,200	5,220.00	100,224,000
日本システムウエア	2,800	2,224.00	6,227,200
アイネス	10,300	1,419.00	14,615,700
T K C	6,200	4,325.00	26,815,000
富士ソフト	10,800	4,485.00	48,438,000
N S D	11,900	2,697.00	32,094,300
コナミホールディングス	29,800	4,870.00	145,126,000
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,120.00	6,784,000
J B C C ホールディングス	6,600	1,491.00	9,840,600

ミロク情報サービス	7,300	2,886.00	21,067,800
ソフトバンクグループ	304,400	11,825.00	3,599,530,000
伊藤忠食品	2,100	4,830.00	10,143,000
エレマテック	3,900	1,839.00	7,172,100
J A L U X	2,400	2,524.00	6,057,600
あらた	4,100	3,875.00	15,887,500
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,850.00	7,030,000
フィールズ	7,800	791.00	6,169,800
双日	402,100	384.00	154,406,400
アルフレッサ ホールディングス	81,000	3,065.00	248,265,000
横浜冷凍	20,200	884.00	17,856,800
ラクーンホールディングス	5,800	705.00	4,089,000
アルコニックス	8,700	1,356.00	11,797,200
神戸物産	11,000	4,455.00	49,005,000
あい ホールディングス	10,700	1,906.00	20,394,200
ダイワボウホールディングス	6,600	6,010.00	39,666,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,800	1,628.00	32,234,400
ラクト・ジャパン	1,600	7,880.00	12,608,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,000	1,063.00	14,882,000
八洲電機	9,000	837.00	7,533,000
レスターホールディングス	8,400	1,988.00	16,699,200
ジューテックホールディングス	2,900	989.00	2,868,100
T O K A I ホールディングス	38,500	940.00	36,190,000
三洋貿易	4,400	2,028.00	8,923,200
ウイン・パートナーズ	5,300	1,257.00	6,662,100
シップヘルスケアホールディングス	15,100	4,535.00	68,478,500
コメダホールディングス	17,300	2,158.00	37,333,400
小野建	7,100	1,596.00	11,331,600
佐島電機	7,300	1,006.00	7,343,800
伯東	5,900	1,235.00	7,286,500
コンドーテック	8,000	998.00	7,984,000
ナガイレーベン	10,800	2,646.00	28,576,800
三菱食品	8,100	2,928.00	23,716,800
松田産業	6,200	1,400.00	8,680,000
第一興商	11,000	5,710.00	62,810,000
メディバルホールディングス	78,800	2,556.00	201,412,800
S P K	2,800	2,426.00	6,792,800
萩原電気ホールディングス	3,200	3,120.00	9,984,000
アズワン	5,200	8,860.00	46,072,000
尾家産業	4,100	1,366.00	5,600,600
シモジマ	5,400	1,181.00	6,377,400
ドウシシャ	7,000	1,866.00	13,062,000



高速	6,500	1,192.00	7,748,000
丸文	9,000	670.00	6,030,000
ハピネット	6,700	1,352.00	9,058,400
日本ライフライン	22,800	1,798.00	40,994,400
エクセル	3,300	2,116.00	6,982,800
マルカ	3,200	2,144.00	6,860,800
I D O M	25,900	272.00	7,044,800
日本エム・ディ・エム	5,100	1,170.00	5,967,000
進和	4,800	2,314.00	11,107,200
ダイترون	4,100	1,782.00	7,306,200
シークス	9,400	1,776.00	16,694,400
オーハシテクニカ	5,900	1,468.00	8,661,200
白銅	3,500	1,558.00	5,453,000
伊藤忠商事	510,800	2,019.00	1,031,305,200
丸紅	719,600	802.30	577,335,080
長瀬産業	41,100	1,730.00	71,103,000
蝶理	5,400	1,670.00	9,018,000
豊田通商	81,100	3,750.00	304,125,000
三共生興	18,000	503.00	9,054,000
兼松	29,000	1,247.00	36,163,000
三井物産	601,800	1,786.50	1,075,115,700
日本紙パルプ商事	4,200	4,420.00	18,564,000
日立ハイテクノロジーズ	22,200	4,810.00	106,782,000
カメイ	9,900	1,238.00	12,256,200
スターゼン	3,000	3,900.00	11,700,000
山善	28,100	1,227.00	34,478,700
椿本興業	2,200	3,935.00	8,657,000
住友商事	431,300	1,600.00	690,080,000
内田洋行	3,900	3,415.00	13,318,500
三菱商事	512,600	3,059.00	1,568,043,400
第一実業	3,500	3,425.00	11,987,500
キャノンマーケティングジャパン	21,300	2,219.00	47,264,700
西華産業	4,800	1,412.00	6,777,600
佐藤商事	8,000	968.00	7,744,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,707.00	13,314,600
東京産業	10,100	525.00	5,302,500
ユアサ商事	7,400	3,375.00	24,975,000
神鋼商事	2,000	2,718.00	5,436,000
阪和興業	12,800	3,300.00	42,240,000
正栄食品工業	4,000	3,380.00	13,520,000
カナデン	8,200	1,257.00	10,307,400
菱電商事	6,900	1,535.00	10,591,500

フルサト工業	5,200	1,654.00	8,600,800
岩谷産業	16,400	3,545.00	58,138,000
極東貿易	3,400	1,584.00	5,385,600
イワキ	11,600	479.00	5,556,400
三愛石油	19,800	962.00	19,047,600
稲畑産業	17,400	1,587.00	27,613,800
ワキタ	16,400	1,186.00	19,450,400
東邦ホールディングス	21,900	2,691.00	58,932,900
サンゲツ	22,700	2,107.00	47,828,900
ミツウロコグループホールディングス	11,900	887.00	10,555,300
シナネンホールディングス	3,600	2,136.00	7,689,600
伊藤忠エネクス	16,300	912.00	14,865,600
サンリオ	23,100	2,500.00	57,750,000
サンワテクノス	5,700	932.00	5,312,400
リョーサン	8,000	3,095.00	24,760,000
新光商事	7,400	1,924.00	14,237,600
トーヨー	4,100	2,193.00	8,991,300
三信電気	6,200	1,937.00	12,009,400
東陽テクニカ	11,000	910.00	10,010,000
モスフードサービス	9,500	2,611.00	24,804,500
加賀電子	7,400	2,199.00	16,272,600
ソーダニッカ	11,200	584.00	6,540,800
立花エレテック	6,100	1,784.00	10,882,400
PALTA C	13,100	6,430.00	84,233,000
太平洋興発	7,800	764.00	5,959,200
西本Wismettacホールディングス	1,800	4,220.00	7,596,000
ヤマタネ	4,800	1,582.00	7,593,600
日鉄物産	5,100	4,675.00	23,842,500
泉州電業	3,000	2,723.00	8,169,000
トラスコ中山	14,900	3,015.00	44,923,500
オートバックスセブン	29,200	1,932.00	56,414,400
モリト	7,700	857.00	6,598,900
加藤産業	11,400	3,760.00	42,864,000
イノテック	5,800	1,019.00	5,910,200
イエローハット	13,600	1,421.00	19,325,600
J Kホールディングス	10,000	590.00	5,900,000
日伝	6,800	1,656.00	11,260,800
杉本商事	4,800	1,856.00	8,908,800
因幡電機産業	10,400	4,590.00	47,736,000
東テク	3,000	2,163.00	6,489,000
ミスミグループ本社	91,500	2,976.00	272,304,000
タキヒヨー	4,000	1,871.00	7,484,000

スズケン	33,300	6,550.00	218,115,000
ジェコス	6,500	1,032.00	6,708,000
ローソン	18,500	5,370.00	99,345,000
サンエー	5,500	4,245.00	23,347,500
カワチ薬品	6,300	1,784.00	11,239,200
エービーシー・マート	11,400	6,740.00	76,836,000
アスクル	7,500	2,818.00	21,135,000
ゲオホールディングス	11,100	1,502.00	16,672,200
アダストリア	10,200	2,827.00	28,835,400
くらコーポレーション	4,300	5,030.00	21,629,000
キャンドウ	5,100	1,690.00	8,619,000
パルグループホールディングス	4,100	3,370.00	13,817,000
エディオン	30,500	971.00	29,615,500
サーラコーポレーション	16,600	611.00	10,142,600
ハローズ	3,100	2,202.00	6,826,200
フジオフードシステム	3,300	3,115.00	10,279,500
あみやき亭	2,000	3,460.00	6,920,000
ひらまつ	20,500	343.00	7,031,500
大黒天物産	2,000	3,895.00	7,790,000
ハニーズホールディングス	8,700	1,027.00	8,934,900
アルペン	6,100	1,710.00	10,431,000
クオールホールディングス	10,900	1,635.00	17,821,500
ジーンズ	5,100	6,250.00	31,875,000
ビックカメラ	39,200	1,190.00	46,648,000
D C Mホールディングス	38,200	1,072.00	40,950,400
ペッパーフードサービス	5,800	2,174.00	12,609,200
Monotaro	46,200	2,510.00	115,962,000
DDホールディングス	2,000	1,831.00	3,662,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	2,021.00	11,115,500
J.フロント リテイリング	93,400	1,317.00	123,007,800
ドトール・日レスホールディングス	12,800	2,189.00	28,019,200
マツモトキヨシホールディングス	30,100	3,535.00	106,403,500
broncoビリー	4,100	2,585.00	10,598,500
Z O Z O	79,200	1,940.00	153,648,000
物語コーポレーション	1,900	9,030.00	17,157,000
ココカラファイン	8,200	4,305.00	35,301,000
三越伊勢丹ホールディングス	136,800	1,050.00	143,640,000
Hamee	3,000	783.00	2,349,000
ウエルシアホールディングス	19,200	4,075.00	78,240,000
クリエイトSDホールディングス	10,600	2,542.00	26,945,200
チムニー	2,800	2,652.00	7,425,600
シュッピン	5,900	808.00	4,767,200

ネクステージ	11,400	1,148.00	13,087,200
ジョイフル本田	21,400	1,348.00	28,847,200
鳥貴族	3,000	1,865.00	5,595,000
キリン堂ホールディングス	3,600	1,805.00	6,498,000
ホットランド	5,100	1,575.00	8,032,500
すかいらーくホールディングス	68,200	1,830.00	124,806,000
綿半ホールディングス	3,100	2,314.00	7,173,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,300	1,005.00	21,406,500
あさひ	6,700	1,360.00	9,112,000
日本調剤	2,700	3,900.00	10,530,000
コスモス薬品	3,200	18,010.00	57,632,000
セブン&アイ・ホールディングス	306,400	3,877.00	1,187,912,800
薬王堂	3,300	2,627.00	8,669,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19,500	1,342.00	26,169,000
ツルハホールディングス	15,900	8,970.00	142,623,000
サンマルクホールディングス	5,800	2,501.00	14,505,800
トリドールホールディングス	9,200	2,380.00	21,896,000
T O K Y O B A S E	7,300	876.00	6,394,800
ジャパンミート	3,100	1,852.00	5,741,200
アレンザホールディングス	5,000	888.00	4,440,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	962.00	6,637,800
クスリのアオキホールディングス	7,100	7,420.00	52,682,000
スシローグローバルホールディングス	8,000	7,420.00	59,360,000
L I X I L ビバ	6,800	1,350.00	9,180,000
メディカルシステムネットワーク	10,700	487.00	5,210,900
ノジマ	12,900	1,999.00	25,787,100
カップ・クリエイト	11,200	1,472.00	16,486,400
ライトオン	8,000	762.00	6,096,000
良品計画	10,400	22,720.00	236,288,000
三城ホールディングス	15,500	399.00	6,184,500
アドヴァン	12,600	1,054.00	13,280,400
アルビス	3,200	2,293.00	7,337,600
コナカ	17,200	449.00	7,722,800
G - 7ホールディングス	2,600	2,371.00	6,164,600
イオン北海道	10,100	745.00	7,524,500
コジマ	12,800	643.00	8,230,400
コーナン商事	9,600	2,622.00	25,171,200
エコス	3,100	1,551.00	4,808,100
ワタミ	10,300	1,613.00	16,613,900
パン・パシフィック・インターナショナルホ	43,800	7,470.00	327,186,000
西松屋チェーン	16,400	876.00	14,366,400

ゼンショーホールディングス	34,600	2,453.00	84,873,800
幸楽苑ホールディングス	5,700	3,190.00	18,183,000
サイゼリヤ	12,100	2,423.00	29,318,300
V Tホールディングス	27,000	452.00	12,204,000
ユナイテッドアローズ	8,400	3,555.00	29,862,000
ハイデイ日高	10,400	2,103.00	21,871,200
コロワイド	24,500	2,236.00	54,782,000
ピーシーデポコーポレーション	11,800	432.00	5,097,600
荳番屋	5,000	4,555.00	22,775,000
スギホールディングス	16,000	4,980.00	79,680,000
ヴィア・ホールディングス	13,300	665.00	8,844,500
スクロール	14,200	376.00	5,339,200
ヨンドシーホールディングス	8,300	2,410.00	20,003,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	81,800	2,920.00	238,856,000
木曽路	8,900	2,630.00	23,407,000
S R Sホールディングス	11,200	1,014.00	11,356,800
ケーヨー	17,000	495.00	8,415,000
上新電機	8,600	2,539.00	21,835,400
日本瓦斯	11,900	3,045.00	36,235,500
ロイヤルホールディングス	12,700	2,739.00	34,785,300
いなげや	8,500	1,342.00	11,407,000
島忠	16,700	2,583.00	43,136,100
チヨダ	7,600	1,772.00	13,467,200
ライフコーポレーション	5,600	2,303.00	12,896,800
リンガーハット	9,100	2,407.00	21,903,700
Mr M a x H D	11,800	465.00	5,487,000
A O K Iホールディングス	14,500	1,159.00	16,805,500
オークワ	11,000	1,109.00	12,199,000
コメリ	11,100	2,651.00	29,426,100
青山商事	13,100	2,454.00	32,147,400
しまむら	8,500	8,930.00	75,905,000
高島屋	57,800	1,310.00	75,718,000
松屋	15,300	1,002.00	15,330,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,600	1,460.00	54,896,000
近鉄百貨店	3,000	3,360.00	10,080,000
パルコ	7,700	1,102.00	8,485,400
丸井グループ	61,900	2,231.00	138,098,900
アクシアル リテイリング	5,900	3,480.00	20,532,000
イオン	280,900	2,049.50	575,704,550
イズミ	14,800	4,800.00	71,040,000
平和堂	14,800	2,092.00	30,961,600
フジ	9,000	1,895.00	17,055,000

ヤオコー	8,200	5,380.00	44,116,000
ゼビオホールディングス	9,100	1,202.00	10,938,200
ケーズホールディングス	76,400	989.00	75,559,600
Olympicグループ	5,800	840.00	4,872,000
日産東京販売ホールディングス	17,800	295.00	5,251,000
Genky DrugStores	3,600	2,478.00	8,920,800
総合メディカルホールディングス	6,400	1,791.00	11,462,400
アインホールディングス	9,800	8,320.00	81,536,000
元気寿司	2,300	4,590.00	10,557,000
ヤマダ電機	224,400	532.00	119,380,800
アークランドサカモト	12,400	1,538.00	19,071,200
ニトリホールディングス	31,600	13,435.00	424,546,000
グルメ杵屋	8,200	1,172.00	9,610,400
吉野家ホールディングス	26,400	1,719.00	45,381,600
松屋フーズホールディングス	3,500	3,705.00	12,967,500
サガミホールディングス	10,800	1,328.00	14,342,400
関西スーパーマーケット	6,900	1,110.00	7,659,000
王将フードサービス	5,300	7,250.00	38,425,000
プレナス	8,000	1,770.00	14,160,000
ミニストップ	5,900	1,775.00	10,472,500
アークス	13,500	2,401.00	32,413,500
パローホールディングス	15,800	2,734.00	43,197,200
ベルク	3,500	5,140.00	17,990,000
大庄	5,500	1,550.00	8,525,000
ファーストリテイリング	9,800	60,430.00	592,214,000
サンドラッグ	27,400	2,989.00	81,898,600
サックスパー ホールディングス	7,300	1,115.00	8,139,500
ベルーナ	17,800	864.00	15,379,200
じもとホールディングス	59,100	115.00	6,796,500
めぶきフィナンシャルグループ	375,600	292.00	109,675,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,300	1,688.00	17,386,400
九州フィナンシャルグループ	120,000	472.00	56,640,000
ゆうちょ銀行	207,300	1,222.00	253,320,600
富山第一銀行	19,600	383.00	7,506,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	466,200	444.00	206,992,800
西日本フィナンシャルホールディングス	47,600	980.00	46,648,000
関西みらいフィナンシャルグループ	34,500	793.00	27,358,500
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,546.00	10,822,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	3,410.00	43,648,000
新生銀行	53,400	1,560.00	83,304,000
あおぞら銀行	40,600	2,701.00	109,660,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,039,200	563.50	2,839,589,200

りそなホールディングス	801,300	460.80	369,239,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	143,600	4,026.00	578,133,600	
三井住友フィナンシャルグループ	516,100	3,996.00	2,062,335,600	
千葉銀行	258,200	609.00	157,243,800	
群馬銀行	144,600	453.00	65,503,800	
武蔵野銀行	11,100	2,239.00	24,852,900	
千葉興業銀行	23,600	301.00	7,103,600	
筑波銀行	32,800	201.00	6,592,800	
七十七銀行	23,200	1,612.00	37,398,400	
青森銀行	6,000	2,967.00	17,802,000	
秋田銀行	5,100	2,297.00	11,714,700	
山形銀行	8,600	1,889.00	16,245,400	
岩手銀行	5,300	3,395.00	17,993,500	
東邦銀行	67,200	300.00	20,160,000	
東北銀行	4,000	1,090.00	4,360,000	
みちのく銀行	5,000	1,632.00	8,160,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,700	2,568.00	163,581,600	
静岡銀行	184,200	849.00	156,385,800	
十六銀行	9,900	2,375.00	23,512,500	
スルガ銀行	66,800	538.00	35,938,400	
八十二銀行	131,500	469.00	61,673,500	
山梨中央銀行	9,600	1,418.00	13,612,800	
大垣共立銀行	11,700	2,496.00	29,203,200	
福井銀行	6,900	1,699.00	11,723,100	
北國銀行	8,000	3,535.00	28,280,000	
清水銀行	3,500	1,829.00	6,401,500	
富山銀行	1,700	3,195.00	5,431,500	
滋賀銀行	14,700	2,698.00	39,660,600	
南都銀行	8,900	2,126.00	18,921,400	
百五銀行	65,400	368.00	24,067,200	
京都銀行	26,200	4,850.00	127,070,000	
紀陽銀行	25,800	1,571.00	40,531,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	48,500	1,212.00	58,782,000	
広島銀行	106,600	592.00	63,107,200	
山陰合同銀行	43,700	804.00	35,134,800	
中国銀行	47,200	1,108.00	52,297,600	
伊予銀行	96,500	621.00	59,926,500	
百十四銀行	8,100	2,370.00	19,197,000	
四国銀行	11,100	1,039.00	11,532,900	
阿波銀行	11,600	2,874.00	33,338,400	
大分銀行	4,700	3,545.00	16,661,500	
宮崎銀行	5,200	2,766.00	14,383,200	

佐賀銀行	4,700	1,837.00	8,633,900
沖縄銀行	6,900	3,530.00	24,357,000
琉球銀行	17,000	1,203.00	20,451,000
セブン銀行	247,900	302.00	74,865,800
みずほフィナンシャルグループ	9,947,300	173.60	1,726,851,280
山口フィナンシャルグループ	91,200	907.00	82,718,400
名古屋銀行	6,000	3,700.00	22,200,000
北洋銀行	112,300	286.00	32,117,800
愛知銀行	2,900	3,615.00	10,483,500
中京銀行	3,000	2,184.00	6,552,000
大光銀行	2,500	1,697.00	4,242,500
愛媛銀行	11,200	1,125.00	12,600,000
京葉銀行	32,300	691.00	22,319,300
栃木銀行	42,500	234.00	9,945,000
北日本銀行	2,000	1,964.00	3,928,000
東和銀行	13,800	741.00	10,225,800
福島銀行	7,000	373.00	2,611,000
トモニホールディングス	58,400	423.00	24,703,200
フィデアホールディングス	73,000	135.00	9,855,000
池田泉州ホールディングス	81,200	286.00	23,223,200
F P G	23,500	943.00	22,160,500
S B I ホールディングス	87,200	2,444.00	213,116,800
ジャフコ	12,100	4,220.00	51,062,000
大和証券グループ本社	585,900	537.50	314,921,250
野村ホールディングス	1,287,200	427.50	550,278,000
岡三証券グループ	63,600	427.00	27,157,200
丸三証券	22,500	671.00	15,097,500
東洋証券	32,000	144.00	4,608,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,900	408.00	36,271,200
水戸証券	26,500	205.00	5,432,500
いちよし証券	16,600	827.00	13,728,200
松井証券	35,900	994.00	35,684,600
マネックスグループ	69,900	379.00	26,492,100
カブドットコム証券	54,200	558.00	30,243,600
極東証券	11,100	1,051.00	11,666,100
岩井コスモホールディングス	8,000	1,208.00	9,664,000
藍澤證券	15,600	700.00	10,920,000
かんぽ生命保険	27,800	2,474.00	68,777,200
S O M P O ホールディングス	128,800	4,224.00	544,051,200
アニコム ホールディングス	6,200	3,155.00	19,561,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	191,200	3,423.00	654,477,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	59,800	2,374.00	141,965,200



第一生命ホールディングス	413,600	1,621.50	670,652,400
東京海上ホールディングス	265,100	5,717.00	1,515,576,700
T & Dホールディングス	225,500	1,233.00	278,041,500
アドバンスクリエイト	4,000	1,937.00	7,748,000
全国保証	21,000	3,820.00	80,220,000
アルヒ	7,200	2,073.00	14,925,600
プレミアグループ	3,000	1,912.00	5,736,000
クレディセゾン	51,700	1,512.00	78,170,400
芙蓉総合リース	8,400	5,720.00	48,048,000
興銀リース	14,300	2,716.00	38,838,800
東京センチュリー	14,600	5,160.00	75,336,000
日本証券金融	32,200	579.00	18,643,800
アイフル	116,300	259.00	30,121,700
リコーリース	6,100	3,405.00	20,770,500
イオンフィナンシャルサービス	46,600	2,312.00	107,739,200
アコム	146,800	385.00	56,518,000
ジャックス	9,100	1,827.00	16,625,700
オリエントコーポレーション	203,000	117.00	23,751,000
日立キャピタル	17,200	2,647.00	45,528,400
オリックス	488,100	1,605.50	783,644,550
三菱UFJリース	164,100	579.00	95,013,900
日本取引所グループ	197,900	1,778.00	351,866,200
イー・ギャランティ	8,600	1,228.00	10,560,800
NECキャピタルソリューション	4,300	1,735.00	7,460,500
いちご	95,000	389.00	36,955,000
日本駐車場開発	90,400	170.00	15,368,000
ヒューリック	154,300	1,002.00	154,608,600
三栄建築設計	3,600	1,597.00	5,749,200
スター・マイカ	4,000	1,505.00	6,020,000
野村不動産ホールディングス	49,500	2,082.00	103,059,000
三重交通グループホールディングス	16,400	585.00	9,594,000
サムティ	10,600	1,369.00	14,511,400
ディア・ライフ	11,100	422.00	4,684,200
日本商業開発	5,500	1,497.00	8,233,500
プレサンスコーポレーション	12,100	1,405.00	17,000,500
ユニゾホールディングス	11,300	2,049.00	23,153,700
日本管理センター	5,800	929.00	5,388,200
フージャースホールディングス	17,800	656.00	11,676,800
オープンハウス	12,100	4,080.00	49,368,000
東急不動産ホールディングス	200,300	634.00	126,990,200
飯田グループホールディングス	62,200	1,944.00	120,916,800
ムゲンエステート	8,200	587.00	4,813,400

ハウストゥ	4,800	1,485.00	7,128,000
パーク24	43,100	2,387.00	102,879,700
パラカ	2,800	1,977.00	5,535,600
三井不動産	389,000	2,650.50	1,031,044,500
三菱地所	514,100	1,889.00	971,134,900
平和不動産	14,100	2,007.00	28,298,700
東京建物	80,800	1,284.00	103,747,200
ダイビル	22,800	1,011.00	23,050,800
京阪神ビルディング	15,000	1,027.00	15,405,000
住友不動産	165,000	4,151.00	684,915,000
テーオーシー	17,500	737.00	12,897,500
東京楽天地	1,800	5,080.00	9,144,000
スターツコーポレーション	10,200	2,468.00	25,173,600
フジ住宅	11,800	840.00	9,912,000
空港施設	13,300	555.00	7,381,500
ゴールドクレスト	6,700	1,484.00	9,942,800
日本エスリード	4,200	1,569.00	6,589,800
日神不動産	13,500	464.00	6,264,000
日本エスコン	14,100	776.00	10,941,600
タカラレーベン	36,800	345.00	12,696,000
サンヨーハウジング名古屋	7,000	971.00	6,797,000
イオンモール	37,100	1,726.00	64,034,600
カチタス	8,300	3,540.00	29,382,000
トーセイ	10,800	956.00	10,324,800
サンフロンティア不動産	10,500	1,135.00	11,917,500
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	920.00	7,544,000
ランドビジネス	6,500	799.00	5,193,500
日本空港ビルデング	23,500	4,555.00	107,042,500
日本工営	5,100	2,562.00	13,066,200
LIFULL	26,800	595.00	15,946,000
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,571.00	14,911,800
日本M&Aセンター	52,900	3,145.00	166,370,500
タケエイ	10,300	802.00	8,260,600
トラスト・テック	3,700	3,755.00	13,893,500
コシダカホールディングス	19,200	1,703.00	32,697,600
パソナグループ	8,200	1,708.00	14,005,600
リンクアンドモチベーション	13,400	891.00	11,939,400
GCA	8,500	823.00	6,995,500
エス・エム・エス	26,200	1,916.00	50,199,200
パーソルホールディングス	71,000	1,995.00	141,645,000
リニカル	4,400	1,304.00	5,737,600
クックパッド	24,700	267.00	6,594,900

学情	3,800	1,235.00	4,693,000
スタジオアリス	4,100	2,129.00	8,728,900
シミックホールディングス	4,500	1,634.00	7,353,000
総合警備保障	28,300	4,915.00	139,094,500
カカクコム	53,400	2,310.00	123,354,000
アイロムグループ	3,100	1,656.00	5,133,600
ルネサンス	4,500	2,070.00	9,315,000
ディップ	11,400	1,621.00	18,479,400
オプトホールディング	4,800	1,823.00	8,750,400
新日本科学	11,600	873.00	10,126,800
ツクイ	17,000	693.00	11,781,000
ベネフィット・ワン	19,700	2,227.00	43,871,900
エムスリー	149,600	1,821.00	272,421,600
アウトソーシング	37,500	1,456.00	54,600,000
ウェルネット	8,600	1,080.00	9,288,000
ワールドホールディングス	2,200	1,963.00	4,318,600
ディー・エヌ・エー	38,600	1,656.00	63,921,600
博報堂D Yホールディングス	99,400	1,805.00	179,417,000
ぐるなび	11,500	647.00	7,440,500
タカミヤ	9,400	658.00	6,185,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,627.00	10,250,100
ファンコミュニケーションズ	21,000	540.00	11,340,000
ライク	3,500	952.00	3,332,000
WDBホールディングス	3,600	3,215.00	11,574,000
バリューコマース	5,200	2,276.00	11,835,200
インフォマート	39,000	1,527.00	59,553,000
J Pホールディングス	25,400	296.00	7,518,400
E P Sホールディングス	10,700	1,977.00	21,153,900
プレステージ・インターナショナル	13,600	1,574.00	21,406,400
アミューズ	4,600	2,459.00	11,311,400
ドリームインキュベータ	3,200	1,579.00	5,052,800
クイック	5,000	1,755.00	8,775,000
ケネディクス	63,400	558.00	35,377,200
電通	86,500	4,660.00	403,090,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,200	1,390.00	4,448,000
ぴあ	2,100	4,705.00	9,880,500
イオンファンタジー	2,400	2,996.00	7,190,400
シーティーエス	9,200	646.00	5,943,200
ネクシィーズグループ	2,400	2,428.00	5,827,200
みらかホールディングス	20,100	2,739.00	55,053,900
アルプス技研	6,400	1,884.00	12,057,600
日本空調サービス	9,600	689.00	6,614,400

オリエンタルランド	83,800	12,575.00	1,053,785,000
ダスキン	19,400	2,715.00	52,671,000
明光ネットワークジャパン	10,600	1,067.00	11,310,200
ファルコホールディングス	5,200	1,357.00	7,056,400
ラウンドワン	22,200	1,495.00	33,189,000
リゾートトラスト	30,800	1,581.00	48,694,800
ビー・エム・エル	9,100	3,175.00	28,892,500
りらいあコミュニケーションズ	12,800	1,031.00	13,196,800
リソー教育	36,700	434.00	15,927,800
ユー・エス・エス	86,600	2,109.00	182,639,400
サイバーエージェント	43,900	4,120.00	180,868,000
楽天	331,300	1,073.00	355,484,900
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,330.00	6,517,000
テー・オー・ダブリュー	8,300	749.00	6,216,700
山田コンサルティンググループ	3,500	2,423.00	8,480,500
セントラルスポーツ	2,900	3,165.00	9,178,500
フルキャストホールディングス	6,900	2,460.00	16,974,000
エン・ジャパン	7,800	3,485.00	27,183,000
テクノプロ・ホールディングス	14,300	6,680.00	95,524,000
Gunosy	5,400	1,860.00	10,044,000
イー・ガーディアン	3,600	2,217.00	7,981,200
ジャパンマテリアル	19,600	1,604.00	31,438,400
ベクトル	8,900	1,630.00	14,507,000
I B J	5,600	902.00	5,051,200
アサンテ	3,500	2,129.00	7,451,500
N・フィールド	5,300	777.00	4,118,100
バリューHR	2,300	2,580.00	5,934,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	4,500.00	8,550,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,152.00	4,262,400
アビスト	1,500	3,290.00	4,935,000
シグマクシス	4,400	1,063.00	4,677,200
ウィルグループ	5,400	1,159.00	6,258,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	302.00	3,473,000
リクルートホールディングス	508,300	3,182.00	1,617,410,600
エラン	5,200	1,843.00	9,583,600
日本郵政	581,700	1,251.00	727,706,700
ベルシステム24ホールディングス	12,000	1,641.00	19,692,000
鎌倉新書	5,400	1,375.00	7,425,000
LITALICO	2,200	1,789.00	3,935,800
エボラブルアジア	2,500	2,208.00	5,520,000
アトラエ	1,600	3,230.00	5,168,000
ストライク	2,100	2,079.00	4,365,900

ソラスト	17,300	1,150.00	19,895,000
インソース	2,600	2,231.00	5,800,600
ペイカレント・コンサルティング	4,000	4,110.00	16,440,000
キャリアインデックス	2,800	853.00	2,388,400
MS - J a p a n	3,200	1,652.00	5,286,400
グレイステクノロジー	2,200	1,913.00	4,208,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	2,090.00	9,405,000
日総工産	2,000	2,454.00	4,908,000
キュービーネットホールディングス	4,200	2,375.00	9,975,000
スプリックス	2,400	2,447.00	5,872,800
リログループ	39,000	3,070.00	119,730,000
東祥	4,500	3,060.00	13,770,000
エイチ・アイ・エス	12,400	3,980.00	49,352,000
共立メンテナンス	10,800	5,630.00	60,804,000
イチネンホールディングス	8,500	1,239.00	10,531,500
建設技術研究所	5,700	1,527.00	8,703,900
スペース	5,300	1,337.00	7,086,100
燦ホールディングス	2,500	2,488.00	6,220,000
東京テアトル	4,900	1,318.00	6,458,200
ナガワ	2,100	6,270.00	13,167,000
よみうりランド	2,300	4,310.00	9,913,000
東京都競馬	4,700	3,450.00	16,215,000
常磐興産	5,300	1,654.00	8,766,200
カナモト	10,700	2,768.00	29,617,600
東京ドーム	27,000	1,066.00	28,782,000
西尾レントオール	7,200	3,215.00	23,148,000
トランス・コスモス	7,800	2,350.00	18,330,000
乃村工藝社	16,500	3,320.00	54,780,000
藤田観光	3,300	2,756.00	9,094,800
K N T - C Tホールディングス	4,300	1,489.00	6,402,700
日本管財	7,000	2,016.00	14,112,000
トーカイ	6,800	2,732.00	18,577,600
セコム	75,200	9,393.00	706,353,600
セントラル警備保障	3,500	5,500.00	19,250,000
丹青社	13,500	1,278.00	17,253,000
メイテック	9,100	5,160.00	46,956,000
応用地質	8,800	1,180.00	10,384,000
船井総研ホールディングス	14,600	2,873.00	41,945,800
オオバ	7,800	682.00	5,319,600
学究社	4,200	1,296.00	5,443,200
ベネッセホールディングス	26,200	3,060.00	80,172,000
イオンディライト	8,800	3,925.00	34,540,000

ナック	6,000	1,009.00	6,054,000
ニチイ学館	10,800	1,377.00	14,871,600
ダイセキ	11,900	2,664.00	31,701,600
合 計	85,529,900		173,171,361,310

## (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。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成30年 4月13日現在)	(平成31年 4月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	346,911,843	873,679,468
コール・ローン	105,158,766	74,173,371
国債証券	154,889,533,040	128,755,928,840
地方債証券	18,967,191,978	13,604,936,260
特殊債券	25,348,519,878	21,878,822,266
社債券	7,833,085,000	8,085,080,000
未収入金	104,805,000	340,728,400
未収利息	395,912,903	334,209,358
前払費用	11,735,452	4,582,070
流動資産合計	208,002,853,860	173,952,140,033
資産合計	208,002,853,860	173,952,140,033
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	100,000,000
未払解約金	21,072,431	572,376,379
未払利息	308	216
その他未払費用	161,740	28,877
流動負債合計	121,234,479	672,405,472
負債合計	121,234,479	672,405,472
純資産の部		
元本等		
元本	164,426,145,427	135,164,231,551
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	43,455,473,954	38,115,503,010
元本等合計	207,881,619,381	173,279,734,561
純資産合計	207,881,619,381	173,279,734,561
負債純資産合計	208,002,853,860	173,952,140,033

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	164,426,145,427口	135,164,231,551口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2643円 (10,000口当たりの純資産額 12,643円)	1口当たり純資産額 1.2820円 (10,000口当たりの純資産額 12,820円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

<p>リスク</p>	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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

<p>項目</p>	<p>（平成31年 4月15日現在）</p>
-----------	------------------------



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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	174,107,403,486円
同期中における追加設定元本額	24,974,986,318円
同期中における一部解約元本額	34,656,244,377円
平成30年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	3,731,623,951円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	6,582,077,843円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,468,021,352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)	519,902,102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)	55,572,714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)	149,647,674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)	242,124,819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)	163,622,986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)	65,165,843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)	148,161,438円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	63,300,147円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,982,790,671円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	770,645,782円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	666,729,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,618,820円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	108,862円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	197,123円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,114,968円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	991,818円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	2,912,601円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,933,292円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,893,054,891円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	22,108,583,158円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,267,510,005円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,010,677,598円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	366,643,600円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	640,083,663円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,683,310円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	307,803,288円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,663,689円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,173,224,706円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,296,820,245円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,722,888,775円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,265,266,018円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	123,224,826円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	6,708,409,211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)	19,051,899,331円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	603,732,535円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	958,092,973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)	16,541,301,861円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,015,363,497円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	204,634,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	45,922,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,337,131,046円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,834,171,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,615,488,146円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,101,467,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	248,597,307円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	22,951,295円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	389,089,332円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,056,525,713円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	318,754,686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>	200,325,538円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,734,019,761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>	830,924,791円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,679,399,252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 >	551,905円
合計	164,426,145,427円

(平成31年 4月15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	164,426,145,427円
同期中における追加設定元本額	19,535,271,602円
同期中における一部解約元本額	48,797,185,478円
平成31年 4月15日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 年金バランス30 (債券重点型)	4,482,730,145円
三井住友 ・ D C 年金バランス50 (標準型)	7,808,731,235円
三井住友 ・ D C 年金バランス70 (株式重点型)	1,692,996,801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)	601,656,207円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	55,315,846円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ)	166,178,438円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	284,949,077円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	249,509,952円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	97,802,322円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	205,486,079円
三井住友 ・ D C 年金バランスゼロ (債券型)	89,745,240円
アセットアロケーション ・ ファンド (安定型)	2,542,502,334円
アセットアロケーション ・ ファンド (安定成長型)	681,391,509円
アセットアロケーション ・ ファンド (成長型)	35,152,756円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	9,754,258円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (1安定重視型)	32,572,333円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (2やや安定型)	12,463,338円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (3バランス型)	7,386,803円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (4やや成長型)	3,545,151円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド (5成長重視型)	5,091,687円
三井住友 ・ D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	25,016,965円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド < 適格機関投資家限定 >	5,804,678,114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 >	18,391,887,313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 >	7,314,559,645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 >	17,857,476,316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 >	349,856,151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 >	586,552,080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 >	2,742,513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 >	252,488,538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 >	112,648,590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 >	2,014,357,930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 >	2,167,297,178円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,824,705,632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 >	10,766,831,762円
S M A M ・ バランスV A 株40T < 適格機関投資家限定 >	3,063,620円

三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,812,140,837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)	11,107,156,241円
S M A M ・ グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	520,836,297円
S M A M ・ バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	373,216,255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)	10,572,184,186円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	927,922,952円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	187,670,363円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	44,089,906円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	2,006,963,386円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	2,524,154,466円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	2,398,251,609円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	1,026,373,073円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	244,033,609円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	18,430,319円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	357,572,916円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	6,290,675,364円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	301,457,933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>	154,310,304円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	1,424,200,086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>	682,426,859円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,680,356,767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>	1,970,683,965円
合計	135,164,231,551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)	100,000,000	100,455,000	
	第397回利付国債(2年)	540,000,000	542,575,800	

第128回利付国債(5年)	865,000,000	870,008,350	
第129回利付国債(5年)	950,000,000	956,137,000	
第130回利付国債(5年)	830,000,000	835,917,900	
第131回利付国債(5年)	140,000,000	141,090,600	
第132回利付国債(5年)	145,000,000	146,226,700	
第133回利付国債(5年)	108,000,000	109,005,480	
第134回利付国債(5年)	110,000,000	111,098,900	
第135回利付国債(5年)	270,000,000	272,880,900	
第136回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,122,609,600	
第137回利付国債(5年)	700,000,000	708,435,000	
第138回利付国債(5年)	700,000,000	708,743,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	60,040,400	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	352,763,400	
第3回利付国債(40年)	225,000,000	330,995,250	
第4回利付国債(40年)	332,000,000	492,810,840	
第5回利付国債(40年)	315,000,000	452,418,750	
第6回利付国債(40年)	325,000,000	460,313,750	
第7回利付国債(40年)	365,000,000	497,451,200	
第8回利付国債(40年)	390,000,000	496,142,400	
第9回利付国債(40年)	596,000,000	563,369,000	
第10回利付国債(40年)	598,000,000	665,765,360	
第11回利付国債(40年)	425,000,000	458,328,500	
第313回利付国債(10年)	1,195,000,000	1,228,818,500	
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,853,694,000	
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,036,014,300	
第318回利付国債(10年)	895,000,000	920,435,900	
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,013,359,200	
第320回利付国債(10年)	960,000,000	990,096,000	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	992,880,000	
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,098,345,150	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	527,350,200	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	402,023,700	
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,410,427,200	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	79,465,540	
第327回利付国債(10年)	375,000,000	388,395,000	
第328回利付国債(10年)	380,000,000	391,483,600	

第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,112,844,300	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,340,627,650	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	821,603,510	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	845,961,850	
第334回利付国債(10年)	695,000,000	722,577,600	
第335回利付国債(10年)	350,000,000	362,652,500	
第336回利付国債(10年)	470,000,000	487,775,400	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	123,163,200	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	831,967,500	
第339回利付国債(10年)	1,105,000,000	1,143,244,050	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	797,750,800	
第341回利付国債(10年)	1,107,000,000	1,140,984,900	
第342回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,272,312,500	
第343回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,130,135,400	
第344回利付国債(10年)	1,381,000,000	1,406,410,400	
第345回利付国債(10年)	1,398,000,000	1,424,044,740	
第346回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,364,669,400	
第347回利付国債(10年)	990,000,000	1,008,404,100	
第348回利付国債(10年)	665,000,000	677,169,500	
第349回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,425,130,000	
第350回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,740,010,500	
第351回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,291,132,800	
第352回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,218,780,000	
第353回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,126,183,800	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	642,447,000	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	399,273,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,727,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	609,161,100	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	117,226,000	
第10回利付国債(30年)	585,000,000	662,617,800	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	523,254,100	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	753,028,800	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	984,292,680	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	626,959,500	
第18回利付国債(30年)	500,000,000	662,060,000	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	650,234,900	

第21回利付国債(30年)	345,000,000	460,081,650	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	431,493,300	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	451,667,650	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	426,498,000	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	403,443,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	495,200,970	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	610,654,000	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	538,084,000	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	244,569,750	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	645,847,040	
第31回利付国債(30年)	395,000,000	534,837,900	
第32回利付国債(30年)	540,000,000	744,584,400	
第33回利付国債(30年)	613,000,000	811,391,320	
第34回利付国債(30年)	477,000,000	653,365,980	
第35回利付国債(30年)	505,000,000	673,392,250	
第36回利付国債(30年)	260,000,000	348,090,600	
第37回利付国債(30年)	710,000,000	938,144,300	
第38回利付国債(30年)	375,000,000	488,572,500	
第39回利付国債(30年)	260,000,000	345,217,600	
第40回利付国債(30年)	370,000,000	483,667,700	
第41回利付国債(30年)	335,000,000	430,883,700	
第42回利付国債(30年)	365,000,000	470,415,650	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	406,343,700	
第44回利付国債(30年)	415,000,000	536,429,000	
第45回利付国債(30年)	415,000,000	517,090,000	
第46回利付国債(30年)	510,000,000	635,801,700	
第47回利付国債(30年)	490,000,000	623,427,000	
第48回利付国債(30年)	425,000,000	520,365,750	
第49回利付国債(30年)	395,000,000	483,803,900	
第50回利付国債(30年)	505,000,000	542,885,100	
第51回利付国債(30年)	520,000,000	493,344,800	
第52回利付国債(30年)	543,000,000	542,342,970	
第53回利付国債(30年)	237,000,000	242,467,590	
第54回利付国債(30年)	180,000,000	193,469,400	
第55回利付国債(30年)	425,000,000	456,488,250	
第56回利付国債(30年)	430,000,000	461,531,900	

第57回利付国債(30年)	590,000,000	633,601,000	
第58回利付国債(30年)	685,000,000	735,073,500	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	418,768,000	
第60回利付国債(30年)	460,000,000	505,903,400	
第61回利付国債(30年)	380,000,000	397,073,400	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	954,820,980	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	759,924,000	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,026,557,350	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	874,711,940	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,555,729,650	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,271,181,600	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,119,453,750	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,119,327,600	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,134,454,200	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	884,028,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	845,980,440	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	749,788,800	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	556,086,300	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	665,419,700	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	710,569,600	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	973,301,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	746,303,700	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	873,274,640	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,393,400	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	681,645,000	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	860,959,980	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	739,509,520	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	365,807,850	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	809,725,850	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	826,118,370	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	249,540,570	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	434,342,500	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	561,529,610	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	469,891,500	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	449,302,100	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	456,824,340	



第108回利付国債(20年)	390,000,000	463,741,200	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	405,327,600	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	473,394,260	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	521,068,100	
第114回利付国債(20年)	383,000,000	468,891,580	
第116回利付国債(20年)	380,000,000	470,823,800	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	244,166,000	
第119回利付国債(20年)	405,000,000	485,400,600	
第120回利付国債(20年)	280,000,000	329,338,800	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	309,317,550	
第122回利付国債(20年)	440,000,000	528,712,800	
第123回利付国債(20年)	230,000,000	285,078,100	
第124回利付国債(20年)	380,000,000	466,583,000	
第125回利付国債(20年)	365,000,000	458,031,200	
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,727,600	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	176,801,400	
第128回利付国債(20年)	295,000,000	360,622,750	
第129回利付国債(20年)	230,000,000	278,382,800	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	163,779,300	
第131回利付国債(20年)	640,000,000	768,550,400	
第132回利付国債(20年)	750,000,000	902,505,000	
第133回利付国債(20年)	160,000,000	194,542,400	
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,924,500	
第135回利付国債(20年)	275,000,000	331,570,250	
第136回利付国債(20年)	420,000,000	501,030,600	
第137回利付国債(20年)	245,000,000	295,984,500	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,552,250	
第139回利付国債(20年)	80,000,000	95,608,000	
第140回利付国債(20年)	600,000,000	726,258,000	
第141回利付国債(20年)	460,000,000	557,814,400	
第142回利付国債(20年)	230,000,000	282,003,000	
第143回利付国債(20年)	310,000,000	372,331,700	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	213,730,200	
第145回利付国債(20年)	445,000,000	541,507,150	
第146回利付国債(20年)	275,000,000	335,203,000	
第147回利付国債(20年)	690,000,000	832,505,700	

	第148回利付国債(20年)	284,000,000	338,982,400	
	第149回利付国債(20年)	715,000,000	854,439,300	
	第150回利付国債(20年)	631,000,000	745,450,780	
	第151回利付国債(20年)	790,000,000	910,095,800	
	第152回利付国債(20年)	720,000,000	829,843,200	
	第153回利付国債(20年)	457,000,000	534,100,470	
	第154回利付国債(20年)	610,000,000	703,671,600	
	第155回利付国債(20年)	610,000,000	683,797,800	
	第156回利付国債(20年)	630,000,000	643,771,800	
	第157回利付国債(20年)	615,000,000	606,931,200	
	第158回利付国債(20年)	595,000,000	616,241,500	
	第159回利付国債(20年)	598,000,000	629,173,740	
	第160回利付国債(20年)	560,000,000	598,102,400	
	第161回利付国債(20年)	540,000,000	566,946,000	
	第162回利付国債(20年)	505,000,000	529,608,650	
	第163回利付国債(20年)	750,000,000	785,625,000	
	第164回利付国債(20年)	660,000,000	678,777,000	
	第165回利付国債(20年)	630,000,000	646,978,500	
	第166回利付国債(20年)	485,000,000	515,409,500	
	第167回利付国債(20年)	720,000,000	737,164,800	
国債証券合計		114,959,000,000	128,755,928,840	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,346,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	126,408,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,625,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,604,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,071,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	524,524,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	640,385,000	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	101,467,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	101,313,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	196,054,200	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	203,040,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	102,615,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	103,037,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	102,511,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,293,000	

平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	102,877,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,937,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,065,000	
平成26年度第10回北海道公募公債(5年)	200,000,000	200,144,000	
平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,277,000	
平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,703,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,011,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,769,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,228,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,959,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,394,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,630,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,619,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,124,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	112,304,500	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,656,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,163,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,222,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	332,955,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	90,000,000	90,144,900	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	101,431,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	130,392,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	227,466,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,743,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,740,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,936,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,996,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,565,000	
平成21年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,925,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,279,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,056,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,447,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	45,000,000	45,074,700	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,625,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,820,000	

第 8 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,912,000	
第 8 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,098,000	
第 9 1 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,041,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,703,000	
第 1 1 1 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,325,000	
第 1 1 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,027,500	
第 1 1 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,520,000	
第 1 1 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,749,000	
第 1 1 5 回共同発行市場公募地方債	600,000,000	616,500,000	
第 1 1 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,097,000	
第 1 3 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,568,000	
第 1 4 9 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,420,000	
第 1 7 2 回共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,775,000	
平成 2 1 年度第 4 回大阪市公募公債	300,000,000	301,680,000	
第 1 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	200,000,000	218,434,000	
第 3 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	112,276,000	
第 1 回京都市公募公債（ 7 年）	300,000,000	300,720,000	
第 1 回京都市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	136,586,000	
第 7 回京都市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	121,330,000	
平成 2 9 年度第 5 回京都市公募公債	100,000,000	100,075,000	
平成 2 6 年度第 1 7 回神戸市公募公債	100,000,000	101,411,000	
第 4 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	111,803,000	
第 9 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	116,545,000	
第 1 4 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	120,069,000	
第 4 7 回横浜市公募公債（ 5 年）	100,000,000	100,074,000	
平成 2 6 年度第 4 回札幌市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	102,612,000	
第 2 回川崎市 1 5 年公募公債	100,000,000	101,916,000	
第 4 回川崎市 1 5 年公募公債	100,000,000	105,619,000	
平成 2 4 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	102,568,000	
平成 2 3 年度第 9 回福岡市公募公債	147,000,000	151,289,460	
平成 2 9 年度第 1 1 回福岡市公募公債（ 5 年）	300,000,000	300,222,000	
地方債証券合計	12,835,500,000	13,604,936,260	
特殊債券	第 3 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	220,006,000
	第 9 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,473,000
	第 1 5 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,489,000
	第 2 0 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,498,000

第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,273,000	
第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,345,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,351,000	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,390,000	
第7回道路債券	100,000,000	108,382,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,452,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,776,000	
第9回道路債券	100,000,000	133,358,000	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	154,027,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	448,290,000	
第42回道路債券	100,000,000	112,638,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	244,374,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,462,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,419,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	751,000,000	755,648,690	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	362,259,000	
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	100,873,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	160,704,480	
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	122,243,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,518,720,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,506,000	
第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,196,000	
第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,449,000	
第120回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,323,000	
第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,027,400,000	

第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,644,000	
第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,255,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,278,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,862,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	101,805,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,161,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,885,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,161,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	130,329,990	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,136,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,483,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,562,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,770,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	301,000,000	305,433,730	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,542,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,068,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,480,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,896,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,023,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,207,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	239,218,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,707,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,848,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,752,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,514,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,804,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,241,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,912,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,762,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,591,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,809,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,206,000	

第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,310,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	101,651,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	107,539,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	107,221,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,654,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,236,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,380,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,029,000	13,425,081	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,779,000	16,640,848	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,566,000	13,985,325	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,708,000	20,857,304	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,179,000	18,168,682	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,411,000	10,472,841	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,374,000	30,835,062	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,307,000	18,427,628	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,468,000	47,759,132	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,889,000	17,856,401	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,208,000	19,388,424	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,740,000	11,966,347	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,260,000	16,632,354	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,900,000	39,043,443	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,328,000	23,880,242	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,362,000	50,075,132	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,105,000	77,566,232	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,086,000	28,062,797	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,884,000	31,060,120	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,233,000	14,726,458	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,320,000	33,803,676	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,637,000	33,038,940	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,271,000	16,943,480	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,600,000	64,848,666	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,828,000	17,597,376	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,407,000	35,763,529	

第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,819,000	36,073,374	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,057,000	15,678,854	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,472,000	17,388,996	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,310,000	33,126,606	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,173,000	47,163,070	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,553,000	39,203,458	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,518,000	73,416,351	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,874,000	36,138,815	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,725,000	15,474,944	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,394,000	79,263,087	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,854,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,589,000	16,398,692	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,952,000	102,882,553	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,190,000	49,037,613	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,803,000	51,776,566	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,684,000	100,596,068	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,867,000	156,548,271	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,719,000	50,326,843	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,499,000	56,007,568	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,926,000	115,058,533	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,486,000	101,524,498	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,127,000	57,299,383	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,992,000	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,946,000	80,978,878	
第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,353,000	94,599,262	
第1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,605,000	94,644,951	
第1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,757,000	94,796,765	
第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,756,000	95,682,713	
第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,738,000	95,810,434	
第1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,416,000	96,792,852	
第1 3 0 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,906,000	
第1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,071,000	99,517,547	
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,988,000	31,341,958	
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,536,000	34,265,288	
第3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	15,980,000	16,846,275	
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,390,000	16,110,713	



	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,170,000	34,982,077	
	い第810号農林債	300,000,000	300,432,000	
	第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,142,000	
	第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,462,000	
	第197号商工債(3年)	200,000,000	200,002,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	102,735,000	
	第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,124,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,134,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,856,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,045,000	
	第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,309,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,588,000	
特殊債券合計		20,771,322,000	21,878,822,266	
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非 上位円貨社債	200,000,000	199,250,000	
	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	200,000,000	200,414,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,680,000	
	第10回アサヒグループホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,078,000	
	第9回株式会社セブン&アイ・ホールディング ス無担保社債	100,000,000	102,051,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	100,134,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	200,812,000	
	第47回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
	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	100,337,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,836,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	100,121,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,016,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,118,000	
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,612,000	
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,462,000	
	第1回明治安田生命2014基金特定目的会社 特定社債	100,000,000	100,085,000	
	第1回ユニー・ファミリーマートホールディ ングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,129,000	

第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,092,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,038,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	118,735,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	305,691,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,744,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,153,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	100,481,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,132,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	115,936,000	
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	102,296,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,162,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,093,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	116,101,000	
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,655,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,660,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,551,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,975,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,052,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,084,000	
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	99,866,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,654,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,900,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	130,935,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,716,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,580,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,557,000	
	100,000,000	124,479,000	

第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,554,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,582,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,286,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,403,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,156,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,004,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,054,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,051,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,014,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,540,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,213,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,281,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,472,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	199,592,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,341,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,616,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,113,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	210,478,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,192,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	103,051,000	
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	100,433,000	
社債券合計	7,800,000,000	8,085,080,000	
合計		172,324,767,366	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

	(平成30年 4月13日現在)	(平成31年 4月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,988,902,702	2,218,088,180
金銭信託	296,893,770	627,644,157
コール・ローン	89,996,877	53,285,541
株式	168,541,223,522	179,938,443,589
投資証券	3,751,670,756	4,532,168,945
派生商品評価勘定	52,253,403	119,560,762
未収入金	61,847,957	11,304,820
未収配当金	255,760,533	306,701,659
前払金	58,873,541	-
差入委託証拠金	2,110,640,254	1,714,108,747
流動資産合計	178,208,063,315	189,521,306,400
資産合計	178,208,063,315	189,521,306,400
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	110,763,744	19,800
前受金	-	119,522,362
未払解約金	270,724,989	601,276,393
未払利息	263	155
その他未払費用	32,409	16,112
流動負債合計	381,521,405	720,834,822
負債合計	381,521,405	720,834,822
純資産の部		
元本等		
元本	53,755,349,667	51,227,388,044
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	124,071,192,243	137,573,083,534
元本等合計	177,826,541,910	188,800,471,578
純資産合計	177,826,541,910	188,800,471,578
負債純資産合計	178,208,063,315	189,521,306,400

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 4月14日 至平成31年 4月15日
----	------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 4月13日現在)	(平成31年 4月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	53,755,349,667口	51,227,388,044口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3081円 (10,000口当たりの純資産額 33,081円)	1口当たり純資産額 3.6855円 (10,000口当たりの純資産額 36,855円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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	(平成31年 4月15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 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,549,165,281	-	5,490,291,740	58,873,541
	SPMINI 1806	3,864,248,754	-	3,777,051,168	87,197,586
	DJ EUR 1806	1,028,097,916	-	1,051,441,360	23,343,444
	FTSE 1806	387,073,821	-	395,890,822	8,817,001
	SPI200 1806	269,744,790	-	265,908,390	3,836,400
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	75,109,900	-	75,493,100	383,200
	米ドル	53,430,000	-	53,690,000	260,000
	英ポンド	13,654,800	-	13,767,300	112,500
	スイスフラン	2,232,200	-	2,231,200	1,000
	スウェーデンクローナ	898,800	-	893,900	4,900
	香港ドル	2,041,500	-	2,050,500	9,000
	シンガポールドル	1,634,200	-	1,638,200	4,000
	イスラエルシェケル	1,218,400	-	1,222,000	3,600
	売建	72,913,500	-	72,933,500	20,000

	米ドル	42,944,000	-	42,952,000	8,000
	カナダドル	2,558,100	-	2,559,600	1,500
	ユーロ	13,237,000	-	13,240,000	3,000
	英ポンド	6,115,200	-	6,118,400	3,200
	スイスフラン	2,230,200	-	2,231,200	1,000
	スウェーデンク ローナ	1,276,000	-	1,277,000	1,000
	ノルウェークロー ネ	276,400	-	276,200	200
	デンマーククロー ネ	1,777,000	-	1,778,000	1,000
	オーストラリアドル	2,499,600	-	2,501,100	1,500
	合計	5,697,188,681	-	5,638,718,340	58,510,341

(平成31年 4月15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	3,700,621,603	-	3,820,143,965	119,522,362
	SPMINI 1906	2,636,887,895	-	2,724,013,193	87,125,298
	DJ EUR 1906	634,893,936	-	658,003,500	23,109,564
	FTSE 1906	231,078,939	-	237,826,952	6,748,013
	SPI200 1906	197,760,833	-	200,300,320	2,539,487
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	523,396,800	-	523,378,200	18,600
	米ドル	355,040,000	-	355,008,300	31,700
	カナダドル	19,317,700	-	19,320,000	2,300
	ユーロ	62,029,100	-	62,034,000	4,900
	英ポンド	33,724,900	-	33,734,100	9,200
	スイスフラン	16,753,500	-	16,756,500	3,000
	スウェーデンク ローナ	5,319,600	-	5,319,600	-
	ノルウェークロー ネ	1,450,900	-	1,449,800	1,100



デンマーククローネ	13,568,000	-	13,568,000	-
オーストラリアドル	4,014,500	-	4,014,500	-
ニュージーランドドル	757,900	-	758,000	100
香港ドル	7,996,800	-	7,991,200	5,600
シンガポールドル	2,482,500	-	2,482,800	300
イスラエルシケル	941,400	-	941,400	-
合計	4,224,018,403	-	4,343,522,165	119,540,962

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

- 1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成30年 4月14日

至 平成31年 4月15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 4月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,241,612,029円
同期中における追加設定元本額	6,553,544,669円
同期中における一部解約元本額	21,039,807,031円
平成30年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	12,306,830,683円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	269,401,414円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,118,175,577円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	768,789,110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)	88,928,836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)	3,023,693円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	9,140,770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)	25,231,773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)	36,982,056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)	22,367,694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)	63,089,993円
外国株式指数ファンド	477,230,356円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,834,046,241円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	505,594,952円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	546,677,956円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	480,607,175円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,844,074円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	258,118円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,128,067円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,135,207円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,473,788円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	39,901,346円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	3,615,637円
S M A M ・ 外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,950,224,751円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,102,560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 >	836,784,489円
S M A M ・ バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	2,087,096,531円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,837,700,430円
S M A M ・ バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	7,621,846,055円
S M A M ・ バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	23,184,564円
S M A M ・ バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	123,614,027円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	772,703円
S M A M ・ バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	960,151,440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 >	70,572,501円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	211,727,164円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	909,876,599円
S M A M ・ バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	955,057,949円
S M A M ・ バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	2,015,353,572円
S M A M ・ バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	46,673,622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)	883,583,465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)	1,195,139,569円

S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	175,494,800円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	89,537,244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 )	1,378,857,819円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	29,139,560円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	15,585,889円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	7,525,974円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	58,355,726円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	136,603,968円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	137,243,424円
S M A M ・ 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 >	1,427,941,057円
S M A M ・ 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 >	210,986,415円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	7,630,165,231円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	790,224,790円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	87,684,238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 >	8,869,456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 >	84,319,064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 >	40,344,880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 >	81,519,080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 >	14,545円
合計	53,755,349,667円

(平成31年 4月15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	53,755,349,667円
同期中における追加設定元本額	12,591,793,268円
同期中における一部解約元本額	15,119,754,891円
平成31年 4月15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	14,540,997,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	290,922,381円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,187,034,969円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	798,762,179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)	76,136,735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)	2,801,776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)	8,441,977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)	23,584,478円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	44,103,145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)	29,913,899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)	75,117,986円
外国株式指数ファンド	518,436,819円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,285,262,338円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	551,156,354円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	537,982,046円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	536,487,290円
イオン・バランス戦略ファンド	31,169,212円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,505,740円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	13,944,330円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,621,644円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	55,172,963円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,650,373円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	55,569,185円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,770,492円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,790,978,249円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	8,634,376円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	76,749,837円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,600,205,202円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,531,892,342円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,544,631,497円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	20,379,742円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,911,372円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	423,742円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	774,601,539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>	61,481,215円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	178,362,779円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	781,134,189円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	680,375,816円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,636,518,942円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,145,754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)	449,735,413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)	650,268,242円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	140,890,084円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	32,773,189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)	829,365,075円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	25,082,064円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	13,148,689円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,839,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	49,575,372円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	119,485,764円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	115,889,361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>	1,149,798,643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>	158,117,325円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,232,458,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	293,843,839円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	2,012,443,704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>	7,865,987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>	101,802,107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>	48,744,796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>	120,134,876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>	147,153,141円
合計	51,227,388,044円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	21,404	61.78	1,322,339.12	
	APACHE CORPORATION	16,399	36.50	598,563.50	
	BAKER HUGHES A GE CO	23,431	26.38	618,109.78	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	27.30	535,953.60	
	CHENIERE ENERGY INC	10,007	67.51	675,572.57	
	CHEVRON CORPORATION	83,657	119.76	10,018,762.32	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	70.83	288,986.40	
	CONCHO RESOURCES INC	9,223	113.89	1,050,407.47	
	CONOCOPHILLIPS	50,365	67.37	3,393,090.05	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	49.08	222,577.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	33.48	738,434.88	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,082	106.28	752,674.96	
	EOG RESOURCES INC	25,219	105.31	2,655,812.89	
	EXXON MOBIL CORPORATION	185,027	80.92	14,972,384.84	
	HALLIBURTON CO	37,453	31.33	1,173,402.49	
	HELMERICH & PAYNE INC	4,080	60.32	246,105.60	
	HESS CORPORATION	11,053	66.10	730,603.30	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,365	50.25	370,091.25	
	KINDER MORGAN INC	86,457	19.82	1,713,577.74	
	MARATHON OIL CORP	36,817	17.76	653,869.92	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	30,435	61.59	1,874,491.65	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	26.87	452,705.76	
	NOBLE ENERGY INC	20,924	26.87	562,227.88	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,362	65.33	2,179,539.46	
	ONEOK INC	18,835	70.60	1,329,751.00	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	20.29	186,830.32	
	PHILLIPS 66	19,641	97.17	1,908,515.97	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,846	168.32	1,320,638.72	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	25.01	195,228.06		
SCHLUMBERGER LTD	60,249	45.65	2,750,366.85		
TARGA RESOURCES CORP	8,672	40.11	347,833.92		

TECHNIPFMC PLC	18,187	24.67	448,673.29
VALERO ENERGY CORP	18,039	88.41	1,594,827.99
WILLIAMS COS INC	55,076	28.94	1,593,899.44
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,939	194.16	1,929,756.24
ALBEMARLE CORPORATION	4,603	83.66	385,086.98
AVERY DENNISON CORP	3,941	116.31	458,377.71
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	27.13	292,380.01
BALL CORPORATION	13,670	58.03	793,270.10
CELANESE CORPORATION	5,647	105.30	594,629.10
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	42.58	431,718.62
CHEMOURS CO	8,067	39.66	319,937.22
CROWN HOLDINGS INC	5,272	56.73	299,080.56
DOW INC	33,348	58.30	1,944,188.40
DOWDUPONT INC	100,044	39.47	3,948,736.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	83.94	499,946.64
ECOLAB INC	11,211	185.09	2,075,043.99
FMC CORPORATION	5,698	79.97	455,669.06
FREEMPORT-MCMORAN INC	60,238	13.70	825,260.60
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	47.76	818,176.56
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,770	133.51	503,332.70
LINDE PLC	24,467	180.35	4,412,623.45
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,642	92.29	1,351,310.18
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	212.16	546,736.32
MOSAIC CO/THE	15,550	26.80	416,740.00
NEWMONT MINING CORP	24,066	36.25	872,392.50
NUCOR CORP	13,218	58.54	773,781.72
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	103.33	418,073.18
PPG INDUSTRIES INC	10,300	115.60	1,190,680.00
SEALED AIR CORP	8,102	46.70	378,363.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,813	441.53	1,683,553.89
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	33.87	345,169.17
VULCAN MATERIALS CO	5,483	122.15	669,748.45
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	76.40	112,690.00
WESTROCK CO	11,330	39.54	447,988.20
3M COMPANY	25,646	217.42	5,575,953.32
ACUITY BRANDS INC	1,884	143.00	269,412.00
AERCAP HOLDINGS NV	4,629	49.21	227,793.09
ALLEGION PLC	3,946	94.57	373,173.22
AMETEK INC	9,623	85.81	825,749.63
ARCONIC INC	19,024	20.71	393,987.04
BOEING CO	23,766	379.64	9,022,524.24
CATERPILLAR INC	25,747	141.20	3,635,476.40

CUMMINS INC	6,946	166.07	1,153,522.22
DEERE & CO	13,344	161.46	2,154,522.24
DOVER CORP	6,894	97.13	669,614.22
EATON CORP PLC	19,706	83.88	1,652,939.28
EMERSON ELECTRIC CO	28,385	72.10	2,046,558.50
FASTENAL COMPANY	11,953	69.71	833,243.63
FLOWSERVE CORPORATION	4,849	48.97	237,455.53
FLUOR CORP	5,677	41.18	233,778.86
FORTIVE CORP	13,835	87.66	1,212,776.10
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	49.13	316,888.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,368	174.93	1,988,604.24
GENERAL ELECTRIC CO	379,099	9.00	3,411,891.00
HARRIS CORP	4,981	167.84	836,011.04
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	44.68	347,923.16
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,446	162.47	5,271,501.62
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	219.28	401,720.96
IDEX CORP	3,078	157.27	484,077.06
ILLINOIS TOOL WORKS	13,015	156.40	2,035,546.00
INGERSOLL-RAND PLC	10,304	114.41	1,178,880.64
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	77.00	378,994.00
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	63.43	596,242.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	36.88	335,608.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	36.08	1,427,072.24
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	217.06	729,538.66
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,542	273.50	421,737.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,119	309.70	3,443,554.30
MASCO CORP	14,833	40.46	600,143.18
MIDDLEBY CORP	2,315	134.86	312,200.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,244	283.05	2,050,414.20
OWENS CORNING	4,859	52.30	254,125.70
PACCAR INC	15,714	70.50	1,107,837.00
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,941	188.64	1,120,710.24
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	40.06	280,660.36
RAYTHEON COMPANY	12,344	184.41	2,276,357.04
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,199	184.24	957,863.76
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,708	351.26	1,653,732.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,106	48.65	345,706.90
SMITH(A.O.) CORP	5,944	55.51	329,951.44
SNAP-ON INC	2,448	155.97	381,814.56
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	87.55	449,744.35
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,882	146.17	1,005,941.94
TEXTRON INC	10,639	51.64	549,397.96

TRANSDIGM GROUP INC	2,020	463.38	936,027.60
UNITED RENTALS INC	3,677	126.74	466,022.98
UNITED TECHNOLOGIES CORP	35,740	135.30	4,835,622.00
WABCO HOLDINGS INC	2,109	133.00	280,497.00
WABTEC CORP	5,533	76.78	424,823.74
WW GRAINGER INC	1,980	304.86	603,622.80
XYLEM INC	7,965	82.37	656,077.05
CINTAS CORP	4,216	207.40	874,398.40
COPART INC	8,553	65.37	559,109.61
COSTAR GROUP INC	1,507	487.38	734,481.66
EQUIFAX INC	5,740	125.06	717,844.40
IHS MARKIT LTD	17,968	55.08	989,677.44
MANPOWERGROUP	3,240	85.65	277,506.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	26.64	403,223.04
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	78.22	760,376.62
ROBERT HALF INTL INC	4,666	66.96	312,435.36
ROLLINS INC	6,451	42.93	276,941.43
TRANSUNION	7,559	70.11	529,961.49
VERISK ANALYTICS INC	7,079	136.98	969,681.42
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	88.01	963,973.53
WASTE MANAGEMENT INC	18,801	101.79	1,913,753.79
AMERCO	390	377.32	147,154.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	34.69	196,900.44
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	90.79	550,459.77
CSX CORPORATION	35,380	76.66	2,712,230.80
DELTA AIR LINES INC	7,251	58.05	420,920.55
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,336	79.04	658,877.44
FEDEX CORP	11,325	196.95	2,230,458.75
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	106.68	375,833.64
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	118.38	550,348.62
KNIGHT-SWIFT TRANSPORATION	5,115	34.08	174,319.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,102	196.15	2,373,807.30
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	153.74	405,719.86
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	53.13	335,569.08
UNION PACIFIC CORP	32,334	169.50	5,480,613.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	2,880	85.49	246,211.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,088	114.46	3,443,872.48
XPO LOGISTICS INC	4,945	63.19	312,474.55
APTIV PLC	12,276	90.79	1,114,538.04
AUTOLIV INC	4,001	83.76	335,123.76
BORGWARNER INC	8,566	44.23	378,874.18
FORD MOTOR COMPANY	169,448	9.45	1,601,283.60



GENERAL MOTORS CO	55,540	39.71	2,205,493.40
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	19.77	204,283.41
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	40.22	295,496.34
LEAR CORP	2,531	157.79	399,366.49
TESLA INC	5,786	267.70	1,548,912.20
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	48.46	301,857.34
D.R.HORTON INC	15,658	45.35	710,090.30
GARMIN LTD	4,936	88.95	439,057.20
HANESBRANDS INC	13,181	18.52	244,112.12
HASBRO INC	5,156	87.57	451,510.92
LEGGETT & PLATT INC	5,036	43.25	217,807.00
LENNAR CORP-CL A	13,866	50.97	706,750.02
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	169.88	726,916.52
MATTEL INC	14,058	13.60	191,188.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	132.13	378,288.19
NEWELL BRANDS INC	18,477	15.39	284,361.03
NIKE INC -CL B	56,415	86.24	4,865,229.60
NVR INC	143	2,970.10	424,724.30
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	96.45	237,942.15
PULTE GROUP INC	13,052	29.39	383,598.28
PVH CORP	3,303	129.15	426,582.45
RALPH LAUREN CORPORATION	2,077	128.15	266,167.55
TAPESTRY INC	11,987	32.57	390,416.59
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	21.86	188,739.24
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	19.69	163,249.79
VF CORP	14,995	90.71	1,360,196.45
WHIRLPOOL CORP	2,604	139.88	364,247.52
ARAMARK	10,783	31.23	336,753.09
CARNIVAL CORP	17,764	53.57	951,617.48
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,101	712.44	784,396.44
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	116.50	625,838.00
DOMINO'S PIZZA INC	1,661	257.61	427,890.21
H&R BLOCK INC	7,820	25.79	201,677.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	13,107	88.73	1,162,984.11
LAS VEGAS SANDS CORP	17,618	66.87	1,178,115.66
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,696	134.65	1,709,516.40
MCDONALD'S CORPORATION	33,687	191.60	6,454,429.20
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	25.66	286,109.00
MGM MIRAGE	22,498	27.35	615,320.30
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	58.60	535,311.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,767	121.94	947,107.98
STARBUCKS CORP	54,394	76.65	4,169,300.10

VAIL RESORTS INC	1,680	217.09	364,711.20
WYNN RESORTS LTD	4,252	143.78	611,352.56
YUM! BRANDS INC	13,431	101.40	1,361,903.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,851	47.28	1,505,915.28
ALPHABET INC-CL A	13,108	1,222.73	16,027,544.84
ALPHABET INC-CL C	13,796	1,217.87	16,801,734.52
ALTICE USA INC-A	16,558	23.24	384,807.92
CBS CORP-CL B	15,883	51.58	819,245.14
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,151	356.05	2,546,113.55
COMCAST CORP-CLASS A	199,060	41.30	8,221,178.00
DISCOVERY INC-A	7,075	30.02	212,391.50
DISCOVERY INC-C	12,731	28.00	356,468.00
DISH NETWORK CORP.	9,780	34.30	335,454.00
ELECTRONIC ARTS INC	12,994	101.83	1,323,179.02
FACEBOOK INC-A	105,460	179.10	18,887,886.00
FOX CORPORATION-CLASS A	15,479	37.53	580,926.87
FOX CORPORATION-CLASS B	6,260	36.95	231,307.00
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	214.01	691,466.31
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	21.79	338,703.76
LIBERTY BROADBAND-C	4,072	94.95	386,636.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	27.92	235,421.44
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	27.05	638,109.50
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	37.54	321,642.72
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	40.46	309,438.08
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	40.28	166,799.48
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	64.46	390,949.90
NETFLIX INC	19,073	351.14	6,697,293.22
NEWS CORP-CLASS A	16,662	12.65	210,774.30
OMNICOM GROUP	9,445	76.43	721,881.35
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.10	416,337.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	94.11	452,480.88
THE WALT DISNEY CO.	78,858	130.06	10,256,271.48
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	52.59	213,042.09
TWITTER INC	29,540	34.37	1,015,289.80
VIACOM INC-CLASS B	14,668	30.29	444,293.72
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	37.42	199,074.40
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	180.11	595,083.44
AMAZON.COM INC	18,234	1,843.06	33,606,356.04
AUTOZONE INC	1,086	1,060.30	1,151,485.80
BEST BUY COMPANY INC	10,543	73.57	775,648.51
BOOKING HOLDINGS INC	2,056	1,833.07	3,768,791.92
BURLINGTON STORES INC	3,144	158.43	498,103.92

CARMAX INC	7,453	74.58	555,844.74
DOLLAR GENERAL CORP	11,733	122.38	1,435,884.54
DOLLAR TREE INC	10,263	104.45	1,071,970.35
EBAY INC	40,316	36.17	1,458,229.72
EXPEDIA GROUP INC	5,168	125.79	650,082.72
GAP INC/THE	9,218	25.78	237,640.04
GENUINE PARTS CO	6,098	112.81	687,915.38
GRUBHUB INC	4,403	65.40	287,956.20
HOME DEPOT INC	49,778	203.85	10,147,245.30
KOHL'S CORP	6,991	69.73	487,482.43
L BRANDS INC	10,675	25.83	275,735.25
LKQ CORPORATION	13,945	30.82	429,784.90
LOWE'S COMPANIES INC	35,353	116.26	4,110,139.78
MACY'S INC	13,521	24.28	328,289.88
MERCADOLIBRE INC	1,842	504.52	929,325.84
NORDSTROM INC	4,756	43.83	208,455.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,676	406.32	1,493,632.32
QURATE RETAIL INC	18,982	16.97	322,124.54
ROSS STORES INC	16,129	97.37	1,570,480.73
TARGET CORP	21,448	80.73	1,731,497.04
TIFFANY & CO	4,643	106.18	492,993.74
TJX COMPANIES INC	54,698	53.97	2,952,051.06
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	104.25	550,231.50
ULTA BEAUTY INC	2,389	344.83	823,798.87
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	147.23	425,053.01
COSTCO WHOLESALE CORP	19,321	241.95	4,674,715.95
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	8.00	108,000.00
KROGER CO	36,791	25.67	944,424.97
SYSCO CORP	21,225	69.01	1,464,737.25
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,877	53.45	1,864,175.65
WALMART INC	63,691	101.56	6,468,457.96
ALTRIA GROUP INC	81,472	56.56	4,608,056.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,953	43.38	1,082,461.14
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	53.27	603,336.02
BUNGE LIMITED	5,968	52.65	314,215.20
CAMPBELL SOUP CO	7,879	39.81	313,662.99
COCA-COLA CO/THE	176,926	46.74	8,269,521.24
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	51.35	480,225.20
CONAGRA BRANDS INC	20,188	29.75	600,593.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,429	190.53	1,415,447.37
GENERAL MILLS INC	25,006	51.58	1,289,809.48
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	41.15	512,029.45

INGREDION INC	3,320	94.56	313,939.20
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	118.34	581,522.76
KELLOGG CO	11,216	57.57	645,705.12
KRAFT HEINZ COMPANY	27,010	33.07	893,220.70
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,090	71.11	433,059.90
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,040	153.86	775,454.40
MOLSON COORS BREWING COMPANY	7,864	59.98	471,682.72
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	63,749	49.79	3,174,062.71
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,060	53.02	1,010,561.20
PEPSICO INC	62,311	122.23	7,616,273.53
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,487	85.77	5,874,129.99
THE HERSHEY COMPANY	6,652	116.11	772,363.72
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	70.84	894,000.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,995	73.89	738,530.55
CLOROX COMPANY	5,583	155.49	868,100.67
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,318	68.77	2,497,588.86
COTY INC-CL A	22,574	11.20	252,828.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,584	167.52	1,605,511.68
KIMBERLY-CLARK CORP	15,599	123.18	1,921,484.82
PROCTER & GAMBLE CO	109,237	105.06	11,476,439.22
ABBOTT LABORATORIES	77,290	78.01	6,029,392.90
ABIOMED INC	1,839	270.08	496,677.12
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,164	293.08	927,305.12
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	74.74	527,514.92
ANTHEM INC	11,286	252.85	2,853,665.10
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,361	79.32	1,773,674.52
BECTON DICKINSON & CO	11,788	246.71	2,908,217.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,113	37.73	2,343,523.49
CARDINAL HEALTH INC	12,873	46.79	602,327.67
CENTENE CORP	18,086	52.92	957,111.12
CERNER CORP	12,409	62.80	779,285.20
CIGNA CORPORATION	16,487	160.60	2,647,812.20
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	292.94	601,991.70
CVS HEALTH CORPORATION	57,653	52.81	3,044,654.93
DANAHER CORP	27,746	131.63	3,652,205.98
DAVITA INC	5,801	54.54	316,386.54
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	51.24	509,530.56
DEXCOM INC	3,778	117.88	445,350.64
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,953	191.71	1,716,379.63
HCA HEALTHCARE INC	11,901	127.87	1,521,780.87
HENRY SCHEIN INC	6,050	61.78	373,769.00
HOLOGIC INC	12,110	47.54	575,709.40

HUMANA INC.	5,930	253.31	1,502,128.30
IDEXX LABORATORIES INC	3,602	225.32	811,602.64
INTUITIVE SURGICAL INC	5,099	582.85	2,971,952.15
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	157.45	693,567.25
MCKESSON CORP	8,396	116.05	974,355.80
MEDTRONIC PLC	59,499	86.75	5,161,538.25
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	89.88	531,190.80
RESMED INC	5,931	102.28	606,622.68
STRYKER CORP	15,083	192.67	2,906,041.61
TELEFLEX INC	1,951	305.13	595,308.63
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,242	223.22	9,429,259.24
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	132.80	499,328.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	141.50	582,980.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,787	134.75	779,798.25
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,377	270.34	642,598.18
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,965	127.92	1,146,802.80
ABBVIE INC	66,714	80.78	5,389,156.92
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,657	80.98	1,186,923.86
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,529	136.20	1,297,849.80
ALKERMES PLC	6,413	34.22	219,452.86
ALLERGAN PLC	14,642	144.95	2,122,357.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	89.81	350,977.48
AMGEN INC	28,043	191.42	5,367,991.06
BEIGENE LTD-ADR	1,790	130.10	232,879.00
BIOGEN INC	9,022	234.50	2,115,659.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	89.93	675,913.88
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72,826	45.57	3,318,680.82
CELGENE CORP	30,503	94.14	2,871,552.42
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	12,022	32.57	391,556.54
ELI LILLY & CO	39,173	123.06	4,820,629.38
GILEAD SCIENCES INC	56,422	65.28	3,683,228.16
ILLUMINA INC	6,286	338.37	2,126,993.82
INCYTE CORP	7,576	79.40	601,534.40
IQVIA HOLDINGS INC	6,827	142.52	972,984.04
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	137.12	357,060.48
JOHNSON & JOHNSON	117,727	135.98	16,008,517.46
MERCK & CO. INC.	114,014	79.43	9,056,132.02
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	742.35	825,493.20
MYLAN NV	22,501	26.97	606,851.97
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	35.15	247,245.10
PERRIGO CO PLC	5,561	50.37	280,107.57
PFIZER INC	254,555	41.71	10,617,489.05

REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	382.94	1,298,932.48
SEATTLE GENETICS INC	4,290	78.05	334,834.50
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	43,466	14.38	625,041.08
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,582	280.65	4,934,388.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,809	107.91	195,209.19
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,516	182.78	2,104,894.48
WATERS CORP	3,459	250.88	867,793.92
ZOETIS INC	20,804	101.67	2,115,142.68
BANK OF AMERICA CORP	410,419	30.17	12,382,341.23
BB & T CORPORATION	34,052	49.26	1,677,401.52
CIT GROUP INC	4,770	50.84	242,506.80
CITIGROUP INC	107,820	67.42	7,269,224.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,142	35.06	706,178.52
COMERICA INC	7,145	80.33	573,957.85
EAST WEST BANCORP INC	6,233	52.13	324,926.29
FIFTH THIRD BANCORP	28,485	27.66	787,895.10
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,722	101.80	684,299.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	45,827	13.69	627,371.63
JPMORGAN CHASE & CO	146,256	111.21	16,265,129.76
KEYCORP	45,615	16.88	769,981.20
M & T BANK CORP	5,767	167.76	967,471.92
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	17.20	241,402.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,108	132.70	2,668,331.60
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,311	15.60	738,051.60
SIGNATURE BANK	2,508	135.24	339,181.92
SUNTRUST BANKS INC	19,640	62.87	1,234,766.80
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	243.74	568,645.42
US BANCORP	67,348	50.22	3,382,216.56
WELLS FARGO & COMPANY	197,032	46.49	9,160,017.68
ZIONS BANCORPORATION	8,874	48.42	429,679.08
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,252	112.34	252,989.68
ALLY FINANCIAL INC	17,783	29.51	524,776.33
AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,731	110.91	3,519,285.21
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,450	142.54	919,383.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	7,749	22.27	172,570.23
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	43,253	52.81	2,284,190.93
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,950	210.56	11,991,392.00
BLACKROCK INC	5,227	454.35	2,374,887.45
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	20,562	87.83	1,805,960.46
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	96.15	473,346.45
CME GROUP INC.	15,517	172.92	2,683,199.64
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,482	76.21	1,103,673.22

E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,967	49.29	540,563.43
EATON VANCE CORP	5,530	42.04	232,481.20
FRANKLIN RESOURCES INC	13,469	35.46	477,610.74
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,918	207.84	3,100,557.12
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,685	77.28	1,907,656.80
INVESCO LIMITED	18,328	21.32	390,752.96
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	20.36	262,338.60
KKR & CO INC -A	22,146	23.34	516,887.64
MOODY'S CORP	7,897	187.11	1,477,607.67
MORGAN STANLEY	56,688	46.69	2,646,762.72
MSCI INC-A	3,805	217.99	829,451.95
NASDAQ INC	5,459	87.80	479,300.20
NORTHERN TRUST CORP	9,865	94.55	932,735.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	87.80	482,022.00
S&P GLOBAL INC	11,000	214.93	2,364,230.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,994	45.35	2,403,277.90
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	57.37	336,302.94
STATE STREET CORP	16,881	71.03	1,199,057.43
SYNCHRONY FINANCIAL	27,831	33.00	918,423.00
T ROWE PRICE GROUP INC	10,303	105.90	1,091,087.70
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,790	53.72	633,358.80
VOYA FINANCIAL INC	7,528	54.40	409,523.20
AFLAC INC	32,950	49.51	1,631,354.50
ALLEGHANY CORPORATION	635	627.10	398,208.50
ALLSTATE CORP	15,758	97.01	1,528,683.58
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	98.07	347,069.73
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,171	46.19	1,763,118.49
AON PLC	10,438	176.12	1,838,340.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	32.89	586,198.47
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	80.52	610,905.24
ASSURANT INC	2,198	95.84	210,656.32
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	43.38	263,880.54
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	39.98	170,234.84
CHUBB LTD	20,144	139.17	2,803,440.48
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	87.49	552,149.39
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	226.34	373,461.00
FNF GROUP	10,851	38.80	421,018.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	51.07	777,030.05
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	64.91	596,717.63
LOEWS CORPORATION	10,639	49.28	524,289.92
MARKEL CORP	577	1,001.15	577,663.55
MARSH & MCLENNAN COS	22,762	94.67	2,154,878.54

METLIFE INC	36,314	45.86	1,665,360.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,900	54.87	652,953.00
PROGRESSIVE CORP	25,645	72.61	1,862,083.45
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,334	101.46	1,860,167.64
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	148.86	449,854.92
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	152.20	228,908.80
TORCHMARK CORPORATION	4,615	86.84	400,766.60
TRAVELERS COS INC(THE)	11,489	137.72	1,582,265.08
UNUM GROUP	9,769	37.08	362,234.52
W.R.BERKLEY CORPORATION	5,809	57.95	336,631.55
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,460	180.72	986,731.20
CBRE GROUP INC-A	13,193	52.17	688,278.81
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,132	128.87	2,336,670.84
EQUINIX INC	3,520	463.38	1,631,097.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	7.14	373,422.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	155.89	312,871.23
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,786	204.24	977,492.64
ACCENTURE PLC-CL A	27,971	178.64	4,996,739.44
ADOBE INC	21,573	271.86	5,864,835.78
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	77.05	569,707.70
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	180.93	402,026.46
ANSYS INC	3,662	189.55	694,132.10
AUTODESK INC	9,933	171.87	1,707,184.71
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,060	163.31	3,112,688.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,900	111.49	546,301.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,714	64.98	761,175.72
CDK GLOBAL INC	5,003	59.67	298,529.01
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,542	130.40	722,676.80
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	102.27	577,927.77
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,483	74.29	1,893,132.07
DXC TECHNOLOGY CO	11,834	65.98	780,807.32
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,914	113.16	1,687,668.24
FIRST DATA CORP-CLASS A	25,471	25.47	648,746.37
FISERV INC	17,328	86.30	1,495,406.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	251.38	961,277.12
FORTINET INC	5,937	92.71	550,419.27
GARTNER INC	4,011	159.38	639,273.18
GLOBAL PAYMENTS INC	6,630	139.14	922,498.20
GODADDY INC - CLASS A	8,240	79.17	652,360.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,214	144.35	5,804,890.90
INTUIT INC	10,638	260.06	2,766,518.28
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,212	144.12	462,913.44



LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	65.34	396,875.16
MASTERCARD INC-CL A	40,243	238.83	9,611,235.69
MICROSOFT CORP	319,738	120.95	38,672,311.10
ORACLE CORPORATION	117,186	54.50	6,386,637.00
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	244.66	958,333.22
PAYCHEX INC	14,864	82.16	1,221,226.24
PAYPAL HOLDINGS INC	49,082	108.48	5,324,415.36
PTC INC	5,462	98.59	538,498.58
RED HAT INC	8,075	182.37	1,472,637.75
SABRE CORP	9,850	21.88	215,518.00
SALESFORCE.COM, INC.	33,542	160.71	5,390,534.82
SERVICENOW INC	7,838	244.30	1,914,823.40
SPLUNK INC	6,247	134.94	842,970.18
SQUARE INC-A	13,915	75.28	1,047,521.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	65.29	590,352.18
SYMANTEC CORPORATION	27,227	23.96	652,358.92
SYNOPSYS INC	6,139	118.19	725,568.41
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,137	124.00	388,988.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	99.22	712,300.38
VERISIGN INC	4,603	189.60	872,728.80
VISA INC	77,159	159.64	12,317,662.76
VMWARE INC	3,612	192.81	696,429.72
WESTERN UNION COMPANY	19,054	19.11	364,121.94
WIX.COM LTD	2,198	125.02	274,793.96
WORKDAY INC-CLASS A	6,686	195.75	1,308,784.50
WORLDPAY INC-CL A	13,838	113.18	1,566,184.84
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,750	103.79	1,427,112.50
APPLE INC	208,293	198.87	41,423,228.91
ARISTA NETWORKS INC	2,260	324.77	733,980.20
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	84.62	349,480.60
CDW CORP/DE	6,306	107.00	674,742.00
CISCO SYSTEMS INC	197,127	56.29	11,096,278.83
COGNEX CORP	7,187	54.83	394,063.21
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	26.09	229,670.27
CORNING INC	34,504	35.01	1,207,985.04
DELL TECHNOLOGIES INC-C	6,212	63.51	394,524.12
F5 NETWORKS INC	2,620	167.01	437,566.20
FLEX LTD	23,204	11.38	264,061.52
FLIR SYSTEMS INC	5,286	49.84	263,454.24
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	62,873	16.40	1,031,117.20
HP INC	69,703	20.21	1,408,697.63
IPG PHOTONICS CORP	1,776	168.92	300,001.92

JUNIPER NETWORKS INC	15,026	27.80	417,722.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,598	91.84	697,800.32
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,507	143.23	1,075,227.61
NETAPP INC	11,136	75.63	842,215.68
SEAGATE TECHNOLOGY	11,332	49.67	562,860.44
TE CONNECTIVITY LTD	14,855	87.95	1,306,497.25
TRIMBLE INC	10,356	40.99	424,492.44
WESTERN DIGITAL CORP	13,851	51.83	717,897.33
XEROX CORP	9,697	34.39	333,479.83
AT&T INC	319,942	32.20	10,302,132.40
CENTURYLINK INC	40,608	12.12	492,168.96
SPRINT CORP	36,740	6.10	224,114.00
T-MOBILE US INC	15,612	73.71	1,150,760.52
VERIZON COMMUNICATIONS INC	182,041	58.74	10,693,088.34
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	30.83	284,900.03
AES CORPORATION	27,194	18.02	490,035.88
ALLIANT ENERGY CORP	11,027	46.81	516,173.87
AMEREN CORPORATION	10,336	71.98	743,985.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,663	84.15	1,822,941.45
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,199	104.16	854,007.84
ATMOS ENERGY CORP	4,697	101.19	475,289.43
CENTERPOINT ENERGY INC	22,526	30.57	688,619.82
CMS ENERGY CORPORATION	13,137	54.98	722,272.26
CONSOLIDATED EDISON INC	13,131	84.55	1,110,226.05
DOMINION ENERGY INC	32,632	76.44	2,494,390.08
DTE ENERGY COMPANY	8,162	124.42	1,015,516.04
DUKE ENERGY CORP	30,963	90.45	2,800,603.35
EDISON INTERNATIONAL	13,539	67.13	908,873.07
ENERGY CORP	8,240	95.24	784,777.60
EVERGY INC	11,852	57.72	684,097.44
EVERSOURCE ENERGY	13,730	70.68	970,436.40
EXELON CORP	42,258	49.70	2,100,222.60
FIRSTENERGY CORP	21,413	41.37	885,855.81
NEXTERA ENERGY INC	21,032	190.85	4,013,957.20
NISOURCE INC	15,794	28.07	443,337.58
NRG ENERGY INC	13,738	42.27	580,705.26
OGE ENERGY CORP	9,056	42.16	381,800.96
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	95.31	487,987.20
PPL CORPORATION	32,318	31.86	1,029,651.48
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,330	59.89	1,277,453.70
SEMPRA ENERGY	12,361	129.85	1,605,075.85
SOUTHERN CO	44,322	52.50	2,326,905.00

	UGI CORPORATION	7,497	53.19	398,765.43
	VISTRA ENERGY CORP	13,852	26.10	361,537.20
	WEC ENERGY GROUP INC	14,523	77.82	1,130,179.86
	XCEL ENERGY INC	22,653	55.87	1,265,623.11
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,452	27.85	1,098,738.20
	ANALOG DEVICES INC	15,993	114.21	1,826,560.53
	APPLIED MATERIALS INC	41,888	42.99	1,800,765.12
	BROADCOM INC	18,128	317.03	5,747,119.84
	INTEL CORP	200,110	56.42	11,290,206.20
	KLA-TENCOR CORPORATION	7,579	123.43	935,475.97
	LAM RESEARCH CORP	7,045	194.08	1,367,293.60
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	23.74	638,059.98
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11,622	59.30	689,184.60
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	95.36	964,757.12
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,850	42.01	2,136,208.50
	NVIDIA CORP	25,766	190.01	4,895,797.66
	NXP SEMICONDUCTORS NV	15,460	100.34	1,551,256.40
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	22.83	398,041.05
	QORVO INC	4,855	77.19	374,757.45
	QUALCOMM INC	53,148	56.95	3,026,778.60
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	90.68	719,817.84
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,115	116.76	4,917,347.40
	XILINX INC	11,291	134.41	1,517,623.31
	米ドル 小計	13,271,650		1,094,023,007.69 (122,541,517,091)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	17,074	9.36	159,812.64
	CAMECO CORP	16,384	15.69	257,064.96
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	55,596	39.76	2,210,496.96
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	13.19	546,501.27
	ENBRIDGE INC	87,692	49.93	4,378,461.56
	ENCANA CORP	66,377	10.08	669,080.16
	HUSKY ENERGY INC	14,553	14.16	206,070.48
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	38.77	503,971.23
	INTER PIPELINE LTD	18,081	22.26	402,483.06
	KEYERA CORP	8,467	32.73	277,124.91
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	50.04	1,085,918.04
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	19.23	173,800.74
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	8,534	10.06	85,852.04
	SUNCOR ENERGY INC	69,996	44.22	3,095,223.12
	TOURMALINE OIL CORP	12,887	21.58	278,101.46
	TRANSCANADA CORP	39,882	62.05	2,474,678.10
	VERMILION ENERGY INC	5,586	35.13	196,236.18

AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	56.31	546,038.07
BARRICK GOLD CORP	74,120	17.91	1,327,489.20
CCL INDUSTRIES INC-CL B	7,680	55.09	423,091.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	15.76	499,150.72
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	99.46	802,841.12
GOLDCORP INC	42,547	15.47	658,202.09
KINROSS GOLD CORP	57,099	4.62	263,797.38
LUNDIN MINING CORP	28,209	6.83	192,667.47
METHANEX CORPORATION	2,452	78.15	191,623.80
NUTRIEN LTD	26,986	69.50	1,875,527.00
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	20,669	33.63	695,098.47
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.16	97,431.12
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	67.12	192,835.76
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	30.84	603,785.52
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	2.71	205,558.92
CAE INC	13,932	30.28	421,860.96
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	24.07	147,188.05
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	34.36	283,470.00
WSP GLOBAL INC	4,524	72.42	327,628.08
THOMSON REUTERS CORP	8,224	79.56	654,301.44
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,885	121.99	3,889,651.15
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,426	284.71	1,829,546.46
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	72.16	1,056,494.56
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	49.39	447,769.74
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,929	88.78	970,276.62
STARS GROUP INC/THE	6,424	25.61	164,518.64
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	27.31	529,240.49
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,417	145.57	351,842.69
DOLLARAMA INC	12,110	38.40	465,024.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,945	81.80	1,631,501.00
EMPIRE CO LTD A	7,235	30.37	219,726.95
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	66.40	566,989.60
METRO INC	11,418	50.40	575,467.20
WESTON (GEORGE) LTD	3,112	101.61	316,210.32
SAPUTO INC	9,854	45.83	451,608.82
AURORA CANNABIS INC	28,563	11.83	337,900.29
BAUSCH HEALTH COS INC	14,796	33.08	489,451.68
CANOPY GROWTH CORP	8,388	56.31	472,328.28
CRONOS GROUP INC	8,026	22.67	181,949.42
BANK OF MONTREAL	27,525	103.23	2,841,405.75
BANK OF NOVA SCOTIA	53,488	71.78	3,839,368.64
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	20,109	109.95	2,210,984.55

	NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	62.54	920,276.10
	ROYAL BANK OF CANADA	62,800	104.69	6,574,532.00
	TORONTO-DOMINION BANK	81,292	74.47	6,053,815.24
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	38,058	63.23	2,406,407.34
	CI FINANCIAL CORP	11,041	18.68	206,245.88
	IGM FINANCIAL INC	3,023	35.63	107,709.49
	ONEX CORPORATION	4,217	76.92	324,371.64
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	612.01	705,647.53
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	32.67	463,914.00
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	51.81	251,330.31
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	110.79	693,988.56
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,843	24.17	2,050,655.31
	POWER CORP OF CANADA	14,595	31.32	457,115.40
	POWER FINANCIAL CORP	11,076	31.99	354,321.24
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	53.56	1,383,133.44
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	21.41	140,149.86
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	12.37	321,533.41
	CGI INC-CL A	11,470	93.52	1,072,674.40
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	1,196.45	1,014,589.60
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	51.74	604,788.86
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,824	286.47	1,095,461.28
	BCE INC	6,928	60.51	419,213.28
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	16,795	71.09	1,193,956.55
	TELUS CORPORATION	7,611	50.02	380,702.22
	ALTAGAS LTD	9,753	18.30	178,479.90
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	46.11	139,713.30
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	36.65	269,157.60
	EMERA INC	2,409	50.44	121,509.96
	FORTIS INC	17,933	50.00	896,650.00
	HYDRO ONE LTD	15,052	21.28	320,306.56
	カナダドル 小計	1,859,390		82,372,070.39 (6,920,077,633)
ユーロ	ENAGAS	10,471	25.28	264,706.88
	ENI SPA	111,408	15.81	1,762,028.92
	GALP ENERGIA SGPS S.A	25,110	14.65	367,987.05
	NESTE OYJ	16,896	32.62	551,147.52
	OMV AG	6,314	48.26	304,713.64
	REPSOL SA	63,434	15.07	956,267.55
	SNAM SPA	103,665	4.53	470,328.10
	TENARIS S.A.	18,477	12.51	231,147.27
	TOTAL SA	105,643	49.99	5,281,093.57
	VOPAK	3,130	41.73	130,614.90

AIR LIQUIDE SA	18,664	115.65	2,158,491.60
AKZO NOBEL	9,650	80.13	773,254.50
ARCELORMITTAL	27,576	20.05	553,036.68
ARKEMA	3,250	93.08	302,510.00
BASF SE	40,465	71.79	2,904,982.35
COVESTRO AG	8,053	55.32	445,491.96
CRH PLC	36,636	29.13	1,067,206.68
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	26.88	173,349.12
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	38.40	129,408.00
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	70.52	463,598.48
IMERYS SA	1,384	48.18	66,681.12
KONINKLIJKE DSM NV	8,310	101.45	843,049.50
LANXESS	3,160	53.30	168,428.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,196	26.78	273,048.88
SOLVAY SA	3,263	107.25	349,956.75
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	11.93	294,901.91
SYMRISE AG	5,581	81.70	455,967.70
THYSSENKRUPP AG	19,367	12.65	244,992.55
UMICORE	8,730	41.88	365,612.40
UPM-KYMMENE OYJ	24,675	26.81	661,536.75
VOESTALPINE AG	5,079	29.16	148,103.64
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,705	40.64	475,691.20
AIRBUS SE	25,353	118.60	3,006,865.80
ALSTOM RGPT	6,452	40.71	262,660.92
ANDRITZ AG	3,392	41.96	142,328.32
BOUYGUES SA	11,049	34.00	375,666.00
BRENTAG AG	6,629	47.54	315,142.66
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.75	420,810.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	35.88	763,024.08
DASSAULT AVIATION SA	89	1,315.00	117,035.00
EIFFAGE SA	3,580	88.00	315,040.00
FERROVIAL SA	23,072	20.69	477,359.68
GEA GROUP AG	8,178	25.65	209,765.70
HOCHTIEF AG	825	130.60	107,745.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,347	44.00	323,268.00
KION GROUP AG	3,179	58.86	187,115.94
KONE OYJ-B	15,370	47.43	728,999.10
LEGRAND SA	12,541	62.00	777,542.00
LEONARDO SPA	18,310	10.49	192,071.90
METSO OYJ	3,963	34.00	134,742.00
MTU AERO ENGINES AG	2,421	204.70	495,578.70
OSRAM LICHT AG	4,588	32.78	150,394.64

PRYSMIAN SPA	9,379	15.31	143,592.49
REXEL SA	12,854	11.06	142,229.51
SAFRAN SA	14,623	122.00	1,784,006.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,885	73.64	1,832,531.40
SIEMENS AG-REG	33,130	103.86	3,440,881.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	14.54	166,948.28
THALES SA	4,530	106.30	481,539.00
VINCI S.A.	22,212	89.66	1,991,527.92
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	14.94	282,505.33
BIC	1,337	77.15	103,149.55
BUREAU VERITAS SA	12,626	21.73	274,362.98
EDENRED	9,497	42.21	400,868.37
RANDSTAD NV	4,694	48.02	225,405.88
TELEPERFORMANCE	2,489	172.70	429,850.30
WOLTERS KLUWER-CVA	12,856	60.98	783,958.88
AENA SME SA	2,881	163.40	470,755.40
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	178.60	240,395.60
ATLANTIA SPA	22,160	23.26	515,441.60
BOLLORE	39,433	4.17	164,751.07
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	21.72	201,127.20
DEUTSCHE POST AG-REG	45,081	30.12	1,357,839.72
FRAPORT AG	1,856	70.78	131,367.68
GETLINK	16,953	13.67	231,747.51
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	11.65	18,811.17
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,180	75.29	1,142,902.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	64.75	162,393.00
CONTINENTAL AG	4,655	153.04	712,401.20
DAIMLER AG	39,426	56.67	2,234,271.42
FAURECIA	3,127	45.69	142,872.63
FERRARI NV	5,649	122.60	692,567.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	45,785	14.20	650,238.57
MICHELIN (CGDE)-B	7,374	116.35	857,964.90
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	30.99	170,661.93
PIRELLI & C SPA	17,484	6.60	115,429.36
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	6,624	60.26	399,162.24
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	23.93	625,075.53
RENAULT SA	8,830	62.23	549,490.90
VALEO SA	9,959	30.24	301,160.16
VOLKSWAGEN AG	1,256	156.50	196,564.00
VOLKSWAGEN AG PFD	8,203	153.34	1,257,848.02
ADIDAS AG	8,007	225.40	1,804,777.80
ESSILORLUXOTTICA	12,648	101.00	1,277,448.00

HERMES INTERNATIONAL	1,455	599.40	872,127.00
HUGO BOSS AG	2,203	60.12	132,444.36
KERING	3,429	530.40	1,818,741.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,097	342.90	4,148,061.30
MONCLER SPA	7,711	36.50	281,451.50
PUMA SE	383	541.50	207,394.50
SEB SA	1,032	163.50	168,732.00
ACCOR SA	7,551	37.13	280,368.63
PADDY POWER BETFAIR PLC	2,946	71.42	210,403.32
SODEXO	3,900	104.55	407,745.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	50.55	85,833.90
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	15.90	138,787.03
JC DECAUX SA	2,828	28.28	79,975.84
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	14.40	156,254.40
PUBLICIS GROUPE	9,116	47.19	430,184.04
RTL GROUP	1,615	50.25	81,153.75
SES	17,687	15.20	268,842.40
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	46.26	100,893.06
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	81.46	286,983.58
VIVENDI SA	43,372	26.28	1,139,816.16
DELIVERY HERO SE	3,417	35.50	121,303.50
INDITEX	47,526	26.30	1,249,933.80
ZALANDO SE	5,372	37.72	202,631.84
CARREFOUR SA	26,320	16.78	441,649.60
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	37.68	69,067.44
COLRUYT NV	3,100	65.44	202,864.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	8,915	14.05	125,255.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	53,314	21.93	1,169,176.02
METRO AG	8,344	14.74	123,032.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,699	78.41	2,642,338.59
DANONE	26,497	69.40	1,838,891.80
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	8.77	201,341.66
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	89.30	472,575.60
HEINEKEN NV	11,026	94.06	1,037,105.56
KERRY GROUP PLC-A	7,177	98.20	704,781.40
PERNOD-RICARD SA	9,080	158.80	1,441,904.00
REMY COINTREAU	1,273	118.30	150,595.90
BEIERSDORF AG	4,089	93.66	382,975.74
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	81.25	380,331.25
HENKEL AG & CO KGAA	7,849	87.66	688,043.34
L'OREAL	11,256	240.30	2,704,816.80
UNILEVER NV-CVA	66,846	50.91	3,403,129.86



BIOMERIEUX	1,779	77.10	137,160.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	74.02	679,577.62
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,038	51.45	979,505.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,641	35.22	1,431,376.02
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	159.80	209,018.40
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	37.78	248,743.52
BAYER AG	41,702	61.42	2,561,336.84
EUROFINS SCIENTIFIC	484	370.20	179,176.80
GRIFOLS S.A.	11,922	24.84	296,142.48
IPSEN	1,498	122.30	183,205.40
MERCK KGAA	5,705	97.18	554,411.90
ORION OYJ	4,259	32.60	138,843.40
QIAGEN N.V.	10,011	36.17	362,097.87
RECORDATI SPA	4,578	36.29	166,135.62
SANOFI	48,997	75.40	3,694,373.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	112.50	174,937.50
UCB SA	5,244	75.32	394,978.08
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	21.20	401,019.20
AIB GROUP PLC	36,918	4.25	157,049.17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,783	5.51	1,613,819.89
BANCO DE SABADELL SA	235,029	0.99	232,678.71
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	726,938	4.55	3,314,110.34
BANK OF IRELAND GROUP PLC	37,670	5.83	219,804.45
BANKIA SA	48,396	2.33	112,956.26
BANKINTER,S.A.	26,969	7.25	195,579.18
BNP PARIBAS	48,733	46.31	2,257,068.89
CAIXABANK	149,132	2.89	431,289.74
COMMERZBANK AG	46,644	7.63	356,080.29
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	11.94	591,961.32
ERSTE GROUP BANK AG	13,217	36.17	478,058.89
ING GROEP NV-CVA	175,231	11.86	2,079,291.04
INTESA SANPAOLO	666,967	2.28	1,523,019.14
KBC GROUPE SA	10,878	67.42	733,394.76
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.51	254,803.94
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	22.71	151,634.67
SOCIETE GENERALE	35,517	28.00	994,476.00
UNICREDIT SPA	88,548	12.40	1,097,995.20
AMUNDI SA	2,379	62.90	149,639.10
DEUTSCHE BANK AG -REG	92,086	7.61	701,234.89
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	114.55	942,402.85
EURAZEO	2,123	65.70	139,481.10

EXOR NV	4,683	59.90	280,511.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	87.88	296,595.00
NATIXIS	45,362	5.13	233,069.95
WENDEL	1,082	118.30	128,000.60
AEGON NV	74,580	4.54	339,040.68
AGEAS	9,051	45.74	413,992.74
ALLIANZ SE-REG	18,395	208.30	3,831,678.50
ASSICURAZIONI GENERALI	51,717	16.81	869,621.35
AXA SA	82,899	23.34	1,934,862.66
CNP ASSURANCES	8,978	21.00	188,538.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,386	130.70	311,850.20
MAPFRE SA	46,367	2.59	120,183.26
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,592	214.20	1,412,006.40
NN GROUP NV	12,995	37.80	491,211.00
POSTE ITALIANE SPA	26,562	8.97	238,367.38
SAMPO OYJ-A SHS	19,253	40.29	775,703.37
SCOR SE	7,100	38.42	272,782.00
AROUNDTOWN SA	34,226	7.10	243,278.40
DEUTSCHE WOHNEN SE	16,160	40.30	651,248.00
VONOVIA SE	22,168	44.72	991,352.96
ADYEN NV	350	693.80	242,830.00
AMADEUS IT GROUP SA	18,637	69.74	1,299,744.38
ATOS SE	4,547	90.26	410,412.22
CAPGEMINI SA	7,156	111.40	797,178.40
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	134.05	741,162.45
SAP SE	42,783	99.39	4,252,202.37
WIRECARD AG	5,504	110.40	607,641.60
INGENICO S.A.	2,691	65.86	177,229.26
NOKIA OYJ	248,108	5.20	1,291,650.24
1&1 DRILLISCH AG	2,188	32.60	71,328.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	149,746	14.82	2,220,433.68
ELISA OYJ	5,909	38.27	226,137.43
ILIAD SA	1,016	96.64	98,186.24
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.76	391,105.41
ORANGE S.A.	90,986	14.56	1,324,756.16
PROXIMUS SA	6,313	26.67	168,367.71
TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.51	254,245.84
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.47	120,636.30
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.70	109,346.55
TELEFONICA S.A.	204,679	7.43	1,521,174.32
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,179	33.99	142,044.21
E.ON SE	94,119	9.91	933,472.24

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	108,125	3.48	376,707.50
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	12.11	346,949.37
	ENDESA S.A.	12,944	22.21	287,486.24
	ENEL SPA	361,804	5.61	2,029,720.44
	ENGIE	78,100	13.20	1,030,920.00
	FORTUM OYJ	19,573	18.78	367,580.94
	IBERDROLA SA	266,679	7.75	2,067,828.96
	INNOGY SE	5,851	41.37	242,055.87
	NATURGY ENERGY GROUP SA	16,170	25.14	406,513.80
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	20,707	18.55	384,114.85
	RWE AG	22,852	23.63	539,992.76
	SUEZ	17,725	12.06	213,852.12
	TERNA SPA	66,384	5.51	366,174.14
	UNIPER SE	8,953	26.80	239,940.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,570	20.46	523,162.20
	VERBUND AG	2,937	44.52	130,755.24
	ASML HOLDING NV	17,784	178.72	3,178,356.48
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	20.72	1,003,366.00
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	16.05	450,214.31
	ユーロ 小計	8,772,502		170,433,874.52 (21,576,928,514)
英債券	BP PLC	880,162	5.70	5,022,204.37
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	196,048	24.79	4,860,029.92
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	165,015	25.05	4,133,625.75
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.22	170,485.20
	ANGLO AMERICAN PLC	44,719	22.09	988,066.30
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	10.22	198,763.77
	BHP GROUP PLC	93,051	19.35	1,800,536.85
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,100	50.52	257,652.00
	FRESNILLO PLC	8,512	7.95	67,721.47
	GLENCORE PLC	499,559	3.32	1,660,783.89
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,294	33.61	245,151.34
	MONDI PLC	17,733	17.99	319,105.33
	RIO TINTO PLC	51,055	47.71	2,436,089.32
	ASHTREAD GROUP PLC	19,216	20.68	397,386.88
	BAE SYSTEMS PLC	147,630	5.08	751,141.44
	BUNZL PLC	13,431	25.12	337,386.72
	DCC PLC	4,734	69.16	327,403.44
	FERGUSON PLC	9,945	53.30	530,068.50
	MEGGITT PLC	36,960	5.23	193,522.56
	MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	1.92	408,153.60
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	8.91	639,233.32

SMITHS GROUP PLC	18,742	15.19	284,690.98
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	17.49	161,292.78
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	5.13	58,788.99
EXPERIAN PLC	42,116	21.92	923,182.72
G4S PLC	74,291	2.29	170,274.97
INTERTEK GROUP PLC	6,794	51.70	351,249.80
RELX PLC	86,570	16.40	1,420,180.85
EASYJET PLC	7,630	11.51	87,821.30
ROYAL MAIL PLC	36,064	2.62	94,487.68
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	6.18	245,568.48
BURBERRY GROUP PLC	17,470	19.47	340,140.90
PERSIMMON PLC	13,916	22.85	317,980.60
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.87	243,617.02
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	38.27	204,208.72
CARNIVAL PLC	8,091	39.66	320,889.06
COMPASS GROUP PLC	69,382	17.93	1,244,019.26
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.29	149,966.18
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,220	48.32	348,906.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.48	113,461.14
TUI AG-DI	17,636	7.85	138,442.60
WHITBREAD PLC	7,771	48.39	376,038.69
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	5.45	229,441.16
INFORMA PLC	54,642	7.74	422,929.08
ITV PLC	151,064	1.30	197,667.24
PEARSON PLC	30,241	8.38	253,419.58
WPP PLC	54,571	8.72	475,859.12
KINGFISHER PLC	109,678	2.53	277,704.69
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.78	198,567.05
NEXT PLC	6,856	56.16	385,032.96
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.35	150,719.60
TESCO PLC	426,993	2.47	1,055,099.70
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.22	223,795.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	25.27	423,803.17
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	101,055	30.89	3,121,588.95
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	26.20	228,044.80
DIAGEO PLC	105,194	31.15	3,277,319.07
IMPERIAL BRANDS PLC	43,416	25.06	1,088,222.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,280	59.05	1,728,984.00
UNILEVER PLC	48,087	43.64	2,098,516.68
CONVATEC GROUP PLC	61,239	1.39	85,459.02
NMC HEALTH PLC	3,733	24.63	91,943.79
SMITH & NEPHEW PLC	37,643	14.92	561,821.77

	ASTRAZENECA PLC	56,444	59.88	3,379,866.72
	GLAXOSMITHKLINE PLC	218,523	15.51	3,389,728.77
	BARCLAYS PLC	752,904	1.65	1,249,519.47
	HSBC HOLDINGS PLC	882,563	6.58	5,813,442.48
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,083,967	0.64	1,998,410.61
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.60	545,057.93
	STANDARD CHARTERED PLC	125,623	6.72	844,437.80
	3I GROUP PLC	46,773	10.60	495,793.80
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	21.28	234,888.64
	INVESTEC PLC	33,008	4.94	163,059.52
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	48.58	630,422.66
	SCHRODERS PLC	6,213	30.68	190,614.84
	ST JAMES'S PLACE PLC	21,830	10.91	238,274.45
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	102,474	2.69	275,655.06
	ADMIRAL GROUP PLC	7,842	22.39	175,582.38
	AVIVA PLC	181,146	4.18	757,190.28
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.38	214,423.13
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.86	715,063.82
	PRUDENTIAL PLC	113,202	16.72	1,892,737.44
	RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	5.36	217,203.89
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	19.38	353,006.70
	SAGE GROUP PLC/THE	51,945	7.05	366,523.92
	BT GROUP PLC	365,274	2.24	821,318.58
	VODAFONE GROUP PLC	1,195,988	1.40	1,680,841.53
	CENTRICA PLC	254,915	1.09	278,494.63
	NATIONAL GRID PLC	147,017	8.17	1,201,569.94
	SEVERN TRENT PLC	9,868	19.53	192,722.04
	SSE PLC	44,560	11.34	505,310.40
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.20	272,496.64
	英ポンド 小計	13,109,258		79,009,318.71 (11,589,086,868)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	21.86	220,807.86
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	610.50	195,970.50
	GIVAUDAN-REG	413	2,530.00	1,044,890.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,578	51.86	1,067,175.08
	SIKA AG	5,281	146.50	773,666.50
	ABB LTD	81,000	19.77	1,601,775.00
	GEBERIT AG-REG	1,593	411.00	654,723.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	700	211.60	148,120.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	216.60	368,436.60
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	58.16	408,225.04
	SGS SA	255	2,596.00	661,980.00

	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	142.95	337,647.90
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,686	72.82	1,724,814.52
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	296.70	394,611.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	57.55	144,795.80
	DUFREY AG-REG	1,180	103.20	121,776.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,875.00	204,375.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,835.00	307,575.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	78,200.00	312,800.00
	NESTLE SA-REGISTERED	134,947	95.53	12,891,486.91
	SONOVA HOLDING AG	2,643	207.00	547,101.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	840.00	365,400.00
	ALCON INC	18,997	54.00	1,025,838.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	297.20	939,152.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	94,985	81.00	7,693,785.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,803	266.55	8,210,539.65
	VIFOR PHARMA AG	1,781	134.80	240,078.80
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	113,020	12.91	1,459,088.20
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	45.10	431,065.80
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	79.50	148,426.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	679	745.40	506,126.60
	UBS GROUP AG	168,121	12.92	2,172,123.32
	BALOISE HOLDING AG	1,987	170.70	339,180.90
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	456.30	671,673.60
	SWISS RE AG	13,910	99.40	1,382,654.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,815	317.10	2,161,036.50
	SWISS PRIME SITE-REG	3,252	82.20	267,314.40
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,416	157.75	381,124.00
	SWISSCOM AG-REG	1,242	463.50	575,667.00
	スイスフラン 小計	772,284		53,103,026.98 (5,932,139,143)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	6,834	311.20	2,126,740.80
	BOLIDEN AB	13,931	287.80	4,009,341.80
	ALFA LAVAL AB	12,041	224.10	2,698,388.10
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	207.10	8,994,353.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	29,698	275.60	8,184,768.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	15,558	255.60	3,976,624.80
	EPIROC AB-A	30,249	97.86	2,960,167.14
	EPIROC AB-B	16,107	93.50	1,506,004.50
	SANDVIK AB	51,127	168.45	8,612,343.15
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	176.70	2,776,133.70
	SKF AB-B SHARES	16,642	171.90	2,860,759.80
	VOLVO AB-B SHS	70,432	147.10	10,360,547.20

	SECURITAS AB-B SHS	12,234	159.90	1,956,216.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	236.10	2,607,960.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	81.82	1,521,279.26	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	162.18	5,878,700.64	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	345.40	1,226,170.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	436.70	3,299,268.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	28,040	264.90	7,427,796.00	
	NORDEA BANK ABP	130,401	77.57	10,115,205.57	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	76,224	90.40	6,890,649.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,140	104.45	7,221,673.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	149.70	5,842,791.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	211.20	1,323,379.20	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	430.70	8,568,776.50	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	250.00	2,814,250.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	301.40	944,587.60	
	ERICSSON LM-B SHS	136,211	91.40	12,449,685.40	
	HEXAGON AB-B SHS	11,065	509.40	5,636,511.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	561.00	1,511,334.00	
	TELE2 AB-B SHS	18,857	125.15	2,359,953.55	
	TELIA CO AB	126,963	41.19	5,229,605.97	
	スウェーデンクローナ 小計	1,090,163		153,891,966.78 (1,860,553,878)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,073	306.80	1,556,396.40	
	EQUINOR ASA	50,025	197.00	9,854,925.00	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	37.35	2,257,209.90	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	362.30	2,714,351.60	
	ADEVINTA ASA-B	5,466	86.57	473,191.62	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,466	229.20	1,252,807.20	
	MOWI ASA	19,167	186.60	3,576,562.20	
	ORKLA ASA	33,915	65.46	2,220,075.90	
	DNB ASA	44,986	165.80	7,458,678.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,997	158.75	1,110,773.75	
	TELENOR ASA	31,196	171.55	5,351,673.80	
	ノルウェークローネ 小計	270,217		37,826,646.17 (498,933,462)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	664.60	2,722,201.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,207	314.60	3,211,122.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	8,593	594.00	5,104,242.00	
	ISS A/S	6,409	209.00	1,339,481.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,040.00	1,350,720.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	8,514.00	2,511,630.00	
	DSV A/S	8,836	575.40	5,084,234.40	

	PANDORA A/S	4,763	286.00	1,362,218.00
	CARLSBERG AS-B	4,678	847.20	3,963,201.60
	COLOPLAST-B	4,991	693.40	3,460,759.40
	DEMANT A/S	4,455	197.50	879,862.50
	GENMAB A/S	2,773	1,159.00	3,213,907.00
	H LUNDBECK A/S	2,896	286.50	829,704.00
	NOVO NORDISK A/S-B	80,049	333.85	26,724,358.65
	DANSKE BANK A/S	29,784	127.00	3,782,568.00
	TRYG A/S	5,005	199.60	998,998.00
	ORSTED A/S	7,645	503.40	3,848,493.00
	デンマーククローネ 小計	185,643		70,387,701.35 (1,193,775,414)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,863	27.67	383,589.21
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.99	486,335.32
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	7.25	540,755.75
	SANTOS LTD	71,529	7.03	502,848.87
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,479	24.47	109,601.13
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,965	35.76	1,464,908.40
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,384	14.70	196,744.80
	ALUMINA LTD	106,977	2.41	257,814.57
	AMCOR LIMITED	50,321	15.70	790,039.70
	BHP GROUP LTD	128,266	39.58	5,076,768.28
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	13.62	314,472.18
	BORAL LIMITED	42,214	4.73	199,672.22
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	8.07	587,980.20
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	3.25	199,403.75
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	18.41	344,101.31
	NEWCREST MINING LIMITED	36,464	25.51	930,196.64
	ORICA LIMITED	17,981	18.48	332,288.88
	RIO TINTO LIMITED	15,921	100.50	1,600,060.50
	SOUTH32 LTD	223,474	3.54	791,097.96
	CIMIC GROUP LTD	4,062	49.13	199,566.06
	BRAMBLES LIMITED	67,015	11.98	802,839.70
	SEEK LIMITED	12,504	17.80	222,571.20
	AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.63	402,272.92
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,068	25.58	666,819.44
	CROWN RESORTS LTD	16,521	13.00	214,773.00
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	3,408	43.61	148,622.88
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	43.12	114,268.00	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.91	365,176.34	
REA GROUP LTD	3,067	76.00	233,092.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.96	81,350.28	



	WESFARMERS LIMITED	49,461	34.73	1,717,780.53
	COLES GROUP LIMITED	46,407	12.29	570,342.03
	WOOLWORTHS GROUP LTD	60,049	31.00	1,861,519.00
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	16,808	8.47	142,363.76
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	15.57	497,990.88
	COCHLEAR LIMITED	2,796	165.10	461,619.60
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	63.89	394,520.75
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	24.57	438,255.09
	CSL LIMITED	19,604	197.86	3,878,847.44
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	128,479	26.02	3,343,023.58
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	8.76	156,374.76
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	9.63	191,068.83
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	78,429	71.63	5,617,869.27
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	121,980	24.69	3,011,686.20
	WESTPAC BANKING CORPORATION	148,099	25.92	3,838,726.08
	AMP LIMITED	129,763	2.23	289,371.49
	ASX LTD	9,287	71.78	666,620.86
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	7.77	178,880.94
	MACQUARIE GROUP LTD	14,246	132.00	1,880,472.00
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	101,002	7.67	774,685.34
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.69	346,267.56
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	12.70	739,482.90
	SUNCORP GROUP LTD	52,373	13.45	704,416.85
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,639	17.50	396,182.50
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.33	565,204.23
	TPG TELECOM LTD	17,758	7.05	125,193.90
	AGL ENERGY LIMITED	28,043	22.09	619,469.87
	AUSNET SERVICES	85,220	1.78	151,691.60
	オーストラリアドル 小計	3,000,219		52,119,959.33 (4,185,232,734)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,032	5.00	155,160.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	42,507	7.96	338,568.25
	A2 MILK CO LTD	36,279	14.61	530,036.19
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	15.07	331,223.53
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	11.60	229,912.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.63	290,102.08
	MERIDIAN ENERGY LTD	58,184	4.04	235,354.28
	ニュージーランドドル 小計	289,609		2,110,356.33 (159,986,113)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	123,424	84.25	10,398,472.00
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	16.78	1,166,210.00
	MTR CORPORATION	67,000	48.70	3,262,900.00

	MINH GROUP LTD	32,000	26.65	852,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	57.85	3,239,600.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	26.05	703,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	103,000	58.20	5,994,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	16.68	733,920.00	
	SANDS CHINA LTD	110,800	42.50	4,709,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.10	710,400.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	9.45	756,000.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	21.20	1,500,960.00	
	WH GROUP LIMITED	397,500	8.92	3,545,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	52,820	25.50	1,346,910.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	35.35	5,549,950.00	
	HANG SENG BANK LTD	33,100	198.80	6,580,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	50,700	276.60	14,023,620.00	
	AIA GROUP LTD	533,600	79.30	42,314,480.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	118,924	68.65	8,164,132.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	24.15	1,014,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	19.12	1,873,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,622	49.95	3,327,768.90	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	42.55	1,233,950.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	34.30	943,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	13.42	3,507,088.86	
	SINO LAND CO	124,200	14.42	1,790,964.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	70,000	136.00	9,520,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	18,000	100.20	1,803,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	32.55	1,725,150.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	22.95	1,354,050.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	57.40	2,755,200.00	
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	56.45	1,862,850.00	
	PCCW LIMITED	194,000	4.78	927,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	63.00	1,890,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	74,100	89.90	6,661,590.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.82	868,020.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	419,286	18.92	7,932,891.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	54.25	3,255,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	94.50	1,162,350.00	
	香港ドル 小計	4,021,509		170,962,387.48 (2,441,342,893)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.62	387,932.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.73	119,355.60	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.82	260,906.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.61	144,900.00	

	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	2.62	305,754.00
	SATS LTD	26,800	5.31	142,308.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.87	247,401.42
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	0.96	270,875.50
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	86,650	2.43	210,559.50
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	34.39	161,633.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.32	113,152.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.59	250,941.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	26.98	2,074,762.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,700	11.74	1,581,378.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	60,500	26.68	1,614,140.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.39	263,084.00
	CAPITALAND LTD	104,500	3.65	381,425.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	9.32	150,052.00
	UOL GROUP LIMITED	21,700	7.28	157,976.00
	VENTURE CORP LTD	11,900	18.66	222,054.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	366,915	3.16	1,159,451.40
	シンガポールドル 小計	2,053,551		10,220,040.42 (846,014,945)
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	19.35	555,557.85
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	522.50	420,612.50
	BANK HAPOLIM BM	44,062	25.98	1,144,730.76
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	24.57	1,611,153.18
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	78.29	426,054.18
	AZRIELI GROUP	2,140	223.00	477,220.00
	NICE LTD	2,768	451.30	1,249,198.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	2.59	259,305.62
	イスラエルシュケル 小計	249,620		6,143,832.49 (192,854,901)
	合 計	48,945,615		179,938,443,589 (179,938,443,589)

(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 600銘柄	64.9%	68.1%
カナダドル	株式 89銘柄	3.7%	3.8%
ユーロ	株式 239銘柄	11.4%	12.0%
英ポンド	株式 92銘柄	6.1%	6.4%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.1%	3.3%
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 11銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.6%	0.7%

オーストラリアドル	株式	58銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式	39銘柄	1.3%	1.4%
シンガポールドル	株式	21銘柄	0.4%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	25,432	462,608.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,988	720,017.80	
		AMERICAN TOWER CORP	19,039	3,768,960.44	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	65,636	658,329.08	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,160	1,257,132.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,984	963,023.76	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	8,328	174,305.04	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	435,314.04	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,492	1,164,953.16	
		DUKE REALTY CORP	17,308	534,124.88	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,404	1,270,489.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,077	892,822.32	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	552,336.95	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	445,266.64	
		HCP, INC.	20,162	622,199.32	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	616,346.96	
		INVITATION HOMES INC	14,734	366,581.92	
		IRON MOUNTAIN INC	12,165	444,387.45	
		KIMCO REALTY CORPORATION	15,666	285,747.84	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	342,081.00	
		MACERICH COMPANY/THE	3,806	165,637.12	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	524,251.44	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	343,576.80	
		PROLOGIS INC	27,735	2,064,316.05	
		PUBLIC STORAGE	6,909	1,532,139.84	
		REALTY INCOME CORPORATION	13,440	958,406.40	
REGENCY CENTERS CORP	6,080	418,668.80			
SIMON PROPERTY GROUP INC	13,474	2,499,696.48			
SL GREEN REALTY CORP	3,945	356,983.05			
UDR INC	10,651	487,815.80			
VENTAS INC	16,435	1,019,463.05			

	VEREIT INC	44,740	373,579.00
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	519,589.02
	WELLTOWER INC	16,526	1,263,743.22
	WEYERHAEUSER CO	31,375	852,458.75
	WP CAREY INC	6,694	531,302.78
	米ドル 小計	517,978	29,888,656.88 (3,347,828,457)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,825	89,887.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	196,740.04
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	125,152.35
	カナダドル 小計	14,851	411,779.89 (34,593,628)
ユーロ	COVIVIO	2,388	227,576.40
	GECINA SA	1,738	227,156.60
	ICADE	1,265	96,772.50
	KLEPIERRE	9,305	298,039.15
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	917,266.50
	ユーロ 小計	20,633	1,766,811.15 (223,678,291)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	273,009.26
	HAMMERSON PLC	34,414	115,631.04
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	302,829.78
	SEGRO PLC	40,873	277,445.92
	英ポンド 小計	152,952	968,916.00 (142,120,598)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	465,482.94
	DEXUS	43,102	546,964.38
	GOODMAN GROUP	75,399	989,234.88
	GPT GROUP	68,818	414,972.54
	LENDLEASE GROUP	25,262	321,837.88
	MIRVAC GROUP	140,993	400,420.12
	SCENTRE GROUP	234,290	927,788.40
	STOCKLAND	103,417	406,428.81
	SYDNEY AIRPORT	49,760	368,721.60
	TRANSURBAN GROUP	120,613	1,619,832.59
	VICINITY CENTRES	146,656	371,039.68
	オーストラリアドル 小計	1,056,697	6,832,723.82 (548,667,722)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	136,000	1,713,600.00
	LINK REIT	92,500	8,542,375.00

香港ドル 小計		228,500	10,255,975.00 (146,455,323)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	345,436.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	252,976.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	245,692.00
	SUNTEC REIT	118,000	228,920.00
シンガポールドル 小計		469,500	1,073,024.00 (88,824,926)
合計			4,532,168,945 (4,532,168,945)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 36銘柄	1.8%	73.9%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	4.9%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	3.1%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.3%	12.1%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	3.2%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 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 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	279,357,946	166,448,781
金銭信託	265,009,262	205,805,781
コール・ローン	80,331,784	17,472,436
国債証券	180,700,350,119	165,139,623,462
派生商品評価勘定	53,964	-
未収入金	38,590,000	-
未収利息	1,610,127,707	1,415,982,651
前払費用	41,085,598	50,568,010
流動資産合計	183,014,906,380	166,995,901,121
資産合計	183,014,906,380	166,995,901,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,012	-

	（平成30年 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
未払解約金	379,000,804	167,798,612
未払利息	235	50
その他未払費用	38,814	13,633
流動負債合計	379,070,865	167,812,295
負債合計	379,070,865	167,812,295
純資産の部		
元本等		
元本	105,069,479,839	93,585,617,520
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,566,355,676	73,242,471,306
元本等合計	182,635,835,515	166,828,088,826
純資産合計	182,635,835,515	166,828,088,826
負債純資産合計	183,014,906,380	166,995,901,121

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,069,479,839口	93,585,617,520口
2. 1単位当たり純資産の額	1.7382円	1.7826円

額	(10,000口当たりの純資産額	17,382円)	(10,000口当たりの純資産額	17,826円)
---	------------------	----------	------------------	----------

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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	(平成31年 4月15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 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	740,408,652	-	740,385,700	22,952
	米ドル	413,167,506	-	413,138,071	29,435
	カナダドル	8,401,693	-	8,403,166	1,473
	ユーロ	263,807,489	-	263,815,738	8,249
	英ポンド	26,696,388	-	26,714,005	17,617
	オーストラリアドル	19,494,925	-	19,470,396	24,529
	南アフリカランド	8,840,651	-	8,844,324	3,673
合計		740,408,652	-	740,385,700	22,952

（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。

（平成31年 4月15日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年 4月14日

至 平成31年 4月15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 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,951,607,749円
同期中における追加設定元本額	5,714,674,001円
同期中における一部解約元本額	26,596,801,911円
平成30年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	9,683,114,666円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	496,733,438円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,387,380,953円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	715,051,428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)	22,197,297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)	9,847,725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)	32,425,458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)	80,647,575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)	74,257,225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)	37,838,418円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	98,716,884円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	12,375,668円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,402,108円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	232,152,798円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	376,245,574円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,123,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	872,720円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,400,130円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,398,762円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	8,265,261円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	9,448,668円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	6,751,925円
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,814,572,362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>	732,328,307円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	14,280,488,490円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	6,545,080,511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>	14,627,123,390円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	43,495,798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>	117,273,174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>	953,417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>	909,532,934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>	134,073,743円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,413,798,037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>	1,712,577,611円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,719,742,501円

S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	7,696,849,134円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	90,449,750円
S M A M ・ 外国債券バッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	12,533,173,156円
三井住友 ・ 外国債券インデックスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,111,219,982円
三井住友 ・ 5 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,276,903,513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 >	221,148,580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 >	702,294,439円
三井住友 ・ 7 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,660,961,718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 >	170,058,697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 >	45,728,304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 >	14,667,943円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	171,087,626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 >	629,568,293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 >	191,711,885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 >	185,753,722円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	55,155,762円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,151,827円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,573,385,690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 >	24,063,953円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	4,486,876,371円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	2,081,595,073円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	7,274,876,655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 >	1,757,740,314円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	29,486,396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 >	265,457,486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 >	127,190,307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 >	257,215,943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 >	19,211円
合計	105,069,479,839円

(平成31年 4月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,069,479,839円
同期中における追加設定元本額	8,099,962,176円
同期中における一部解約元本額	19,583,824,495円
平成31年 4月15日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 外国債券インデックスファンドS	11,021,480,564円
三井住友 ・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	591,416,375円
三井住友 ・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	1,617,781,954円
三井住友 ・ D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	814,098,767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 )	95,754,367円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	9,428,957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)	33,808,342円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	88,960,450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)	104,480,752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)	54,396,352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)	129,190,063円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,379,266円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	542,375,605円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	503,674,596円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	451,944,331円
イオン・バランス戦略ファンド	51,896,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,457,849円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	52,161,177円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,492,093円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	74,985,318円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,290,016円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,751,100円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,974,112円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,737,705,491円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,656,536,009円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,806,225,886円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,090,969,135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>	106,870,983円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,437円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	762,181,383円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,280,990,905円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,583,991,812円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,066,370,289円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,711,878,991円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,272,452円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,146,218,597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)	567,678,098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)	1,335,742,996円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	190,341,823円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	270,520,585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)	1,697,062,565円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	154,601,447円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,886,445円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	149,017,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	563,081,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	177,236,275円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	170,901,923円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	53,384,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,651,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,365,424,865円

SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,153,877円
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>	3,715,575,678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>	1,636,072,898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>	704,570,800円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	44,399,157円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,044,700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>	410,598,751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>	196,656,702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>	484,437,893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>	824,402,719円
合計	93,585,617,520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	2,800,000.00	2,765,437.50	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,959,218.75	
		US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,709,750.00	
		US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,920,078.14	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,373,789.08	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,621,953.12	
		US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,397,187.50	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,968,593.75	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,521,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,403,476.58	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,862,656.25	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	990,859.38	
		US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,951,562.50	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,958,750.00	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,955,312.52	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,963,906.25	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,944,375.00	

US TREASURY N/B 1.375	3,300,000.00	3,251,015.62
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,954,531.25
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,639,585.95
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,944,687.50
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,351,250.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,915,625.00
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,360,000.00
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,396,093.75
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,872,734.39
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,968,125.00
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	989,140.63
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,976,406.26
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,929,921.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,903,203.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,900,859.39
US TREASURY N/B 1.5	4,800,000.00	4,482,750.00
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,984,687.50
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,465,546.87
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,967,890.64
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,454,335.95
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,928,984.39
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,904,375.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,410,859.37
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,914,218.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,911,640.64
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,902,500.00
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,272,500.00
US TREASURY N/B 1.625	4,500,000.00	4,251,445.33
US TREASURY N/B 1.75	3,700,000.00	3,662,421.87
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,977,031.26
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,952,656.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,948,906.25
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,768,781.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,945,390.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,945,625.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,944,453.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,944,218.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,938,125.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,931,093.75
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,560,617.21
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,979,609.39
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,367,937.51

US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,972,812.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,956,875.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,955,937.50
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,673,437.50
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,935,312.52
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,949,140.64
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,752,750.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,982,421.89
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,285,445.32
US TREASURY N/B 2	5,300,000.00	5,262,734.37
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,977,968.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,977,265.64
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,975,625.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,973,984.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,972,343.75
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,261,031.25
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,467,734.37
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,070,695.32
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,965,078.14
US TREASURY N/B 2	500,000.00	493,750.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,960,859.39
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,424,804.71
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,963,125.00
US TREASURY N/B 2	4,200,000.00	4,121,250.00
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,451,367.20
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,470,500.00
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,185,445.33
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,987,843.75
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,986,406.25
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,685,656.25
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,690,570.32
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,976,562.52
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,981,953.14
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,981,015.64
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,978,203.14
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,964,687.52
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,065,851.57
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,976,093.76
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,952,812.52
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,452,148.45
US TREASURY N/B 2.125	4,400,000.00	4,336,750.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,772,578.13
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	4,812,718.75



US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,987,500.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,991,093.75	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,993,906.26	
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,791,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,982,187.50	
US TREASURY N/B 2.25	7,500,000.00	7,453,710.97	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,487,578.12	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,245,859.37	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,072,632.82	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,947,500.00	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,104,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	5,200,000.00	5,093,968.77	
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	6,063,890.65	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,632,343.75	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,998,281.26	
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000.00	4,996,484.40	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,998,906.26	
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,602,250.00	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,199,906.25	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	5,592,125.00	
US TREASURY N/B 2.375	6,900,000.00	6,835,851.59	
US TREASURY N/B 2.5	4,200,000.00	4,215,421.89	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,024,609.40	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,728,945.34	
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,619,406.25	
US TREASURY N/B 2.5	4,000,000.00	4,007,812.52	
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,674,468.75	
US TREASURY N/B 2.5	4,400,000.00	4,020,843.77	
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,473,546.87	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,008,437.52	
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,515,039.09	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	502,226.56	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,020,937.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,020,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,020,390.64	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,036,562.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,346,359.37	
US TREASURY N/B 2.625	5,800,000.00	5,857,546.90	
US TREASURY N/B 2.625	3,800,000.00	3,820,781.24	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,033,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,412,359.38	
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000.00	6,085,312.50	

US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,030,156.26
US TREASURY N/B 2.75	6,100,000.00	6,194,359.37
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,296,390.65
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,186,859.37
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,035,468.76
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,087,890.65
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	610,406.25
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	4,880,250.00
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,940,937.50
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	2,714,031.26
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,296,500.00
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,434,960.94
US TREASURY N/B 2.875	7,200,000.00	7,289,437.53
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,043,750.00
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,254,312.50
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,126,898.44
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,562,695.32
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,619,882.83
US TREASURY N/B 2.875	7,300,000.00	7,493,335.97
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,969,062.50
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,942,187.52
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,540,656.26
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,129,062.52
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,201,234.37
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,827,000.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,034,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,035,625.00
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,943,640.62
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,521,093.75
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,215,125.00
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,114,046.87
US TREASURY N/B 3	1,500,000.00	1,507,031.25
US TREASURY N/B 3	3,200,000.00	3,217,750.01
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,043,593.75
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	5,972,085.95
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,142,367.19
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,074,375.00
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,447,140.63
US TREASURY N/B 3.125	5,100,000.00	5,260,171.87
US TREASURY N/B 3.125	1,200,000.00	1,235,062.50
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,305,312.52
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,350,179.68
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,549,570.33

US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	887,437.50	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,105,859.40	
US TREASURY N/B 3.625	3,800,000.00	4,257,187.50	
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,034,812.50	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,714,570.32	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,571,562.52	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,746,328.12	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,224,609.38	
US TREASURY N/B 4.25	1,800,000.00	2,206,265.63	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	620,000.00	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,867,265.62	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,742,671.88	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,245,218.75	
US TREASURY N/B 4.5	900,000.00	1,118,742.19	
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	252,062.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,264,531.25	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,698,500.00	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,963,125.00	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	662,968.75	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	613,984.37	
US TREASURY N/B 5.375	720,000.00	923,118.75	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	622,265.62	
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,221,328.13	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,276,406.25	
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	927,062.50	
US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	637,851.56	
US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,482,000.00	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,081,875.00	
米ドル 小計	684,020,000.00	685,544,291.92 (76,787,816,137)	
カナダドル			
CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,935,840.00	
CANADA-GOV'T 0.75	1,900,000.00	1,875,148.00	
CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,968,102.00	
CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,960,000.00	
CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	941,870.00	
CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,995,500.00	
CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,987,560.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,181,040.00	
CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,103,751.00	
CANADA-GOV'T 2	900,000.00	916,290.00	
CANADA-GOV'T 2.25	400,000.00	411,280.00	
CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,445,472.00	

	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,394,254.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,300,000.00	1,345,890.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,600,000.00	1,840,800.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	607,110.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,033,480.00
	CANADA-GOV'T 3.5	3,900,000.00	3,975,816.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,934,850.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,011,485.00
	CANADA-GOV'T 5	1,200,000.00	1,739,580.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	816,618.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,000,000.00	1,472,020.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	734,740.00
	カナダドル 小計	34,800,000.00	37,628,496.00 (3,161,169,948)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	36,000,000.00	39,621,240.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,753,400.00
	MEXICAN BONOS 6.5	5,000,000.00	4,819,700.00
	MEXICAN BONOS 7.5	21,000,000.00	20,484,450.00
	MEXICAN BONOS 8	47,000,000.00	47,084,600.00
	MEXICAN BONOS 8	22,000,000.00	22,179,080.00
	MEXICAN BONOS 8.5	36,000,000.00	37,339,560.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	40,627,600.00
	メキシコペソ 小計	227,000,000.00	229,909,630.00 (1,372,560,491)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	983,304.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,365,416.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	730,786.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	519,250.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,911,880.00
	BELGIAN 0304 5	1,800,000.00	2,872,566.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,697,910.00
	BELGIAN 0318 3.75	1,600,000.00	1,699,600.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,670,173.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,300,000.00	1,452,087.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,308,050.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,975,672.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,663,530.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	572,065.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	648,200.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,033,770.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	572,340.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	420,924.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,488,396.00

BELGIAN 1	1,300,000.00	1,346,787.00
BELGIAN 1.25	400,000.00	421,832.00
BELGIAN 1.6	800,000.00	824,952.00
BELGIAN 1.9	700,000.00	787,024.00
BELGIAN 2.15	500,000.00	553,090.00
BELGIAN 3.75	900,000.00	1,368,225.00
BTPS 0.05	1,000,000.00	992,190.00
BTPS 0.35	500,000.00	501,445.00
BTPS 0.35	1,500,000.00	1,487,565.00
BTPS 0.45	1,500,000.00	1,499,115.00
BTPS 0.65	1,600,000.00	1,610,208.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,940,600.00
BTPS 0.7	2,000,000.00	2,012,480.00
BTPS 0.9	800,000.00	796,144.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,979,760.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	1,007,910.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,899,540.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,022,940.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,026,280.00
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,777,662.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	979,410.00
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,655,018.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,955,780.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,785,780.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,013,800.00
BTPS 2	2,300,000.00	2,319,596.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,574,336.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,486,740.00
BTPS 2.15	500,000.00	517,880.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,005,030.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,093,356.00
BTPS 2.3	600,000.00	623,202.00
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,054,955.00
BTPS 2.5	600,000.00	625,680.00
BTPS 2.5	500,000.00	517,985.00
BTPS 2.7	1,700,000.00	1,538,381.00
BTPS 2.8	300,000.00	310,875.00
BTPS 2.8	900,000.00	771,336.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	975,000.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,493,430.00
BTPS 3.35	300,000.00	314,115.00
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,428,490.00
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,499,042.00

BTPS 3.75	2,500,000.00	2,656,575.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,132,320.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,426,592.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,211,060.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,630,750.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,827,650.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,589,409.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,412,380.00	
BTPS 4.5	1,700,000.00	1,976,165.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,848,430.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,854,775.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,533,650.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	1,975,728.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,231,640.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,179,060.00	
BTPS 5	2,070,000.00	2,594,103.30	
BTPS 5	2,000,000.00	2,522,860.00	
BTPS 5	1,900,000.00	2,389,307.00	
BTPS 5.25	1,900,000.00	2,376,140.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,291,820.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,301,240.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	2,922,744.00	
BTPS 6	2,700,000.00	3,616,299.00	
BTPS 6.5	3,000,000.00	3,991,950.00	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,361,090.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,333,460.00	
BUNDESOBL-171 0	2,000,000.00	2,011,360.00	
BUNDESOBL-172 0.25	2,000,000.00	2,024,860.00	
BUNDESOBL-173 0	2,500,000.00	2,529,100.00	
BUNDESOBL-174 0	3,000,000.00	3,042,240.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,318,837.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,500,000.00	2,579,225.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,450,000.00	3,529,212.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	900,000.00	917,262.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,600,000.00	3,776,040.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	946,080.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,576,140.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,097,880.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,395,927.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,650,000.00	2,868,519.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	400,000.00	457,764.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,673,425.00	

DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,693,400.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,163,120.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,194,100.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,363,768.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,211,560.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,661,550.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,559,010.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,494,738.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,581,570.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,156,164.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,059,364.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,130,890.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	1,900,956.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,500,000.00	4,033,425.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,585,970.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,100,000.00	1,588,015.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,159,149.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	3,151,885.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,467,396.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,501,910.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,581,384.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	700,000.00	1,166,487.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,549,450.00
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	405,192.00
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	408,640.00
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	515,090.00
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	214,144.00
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,074,470.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,070,200.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,112,770.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	691,480.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	738,726.00
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	727,440.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,080,510.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,258,580.00
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,017,520.00
FRANCE O.A.T. 0	4,200,000.00	4,244,646.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,012,900.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,026,480.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,010,370.00
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,328,681.00
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	3,036,540.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,005,067.00

FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,100,800.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,300,000.00	3,439,722.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,766,164.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,671,850.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,669,925.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,807,287.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	2,101,160.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,400,000.00	3,767,642.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,344,240.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,100,000.00	3,433,932.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,576,218.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	1,035,730.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,302,440.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,900,000.00	3,171,005.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000.00	4,845,541.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,662,330.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,300,000.00	4,022,370.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,800,000.00	4,631,478.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,522,000.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,724,020.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	2,300,000.00	3,317,106.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	3,000,000.00	3,124,320.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,800,000.00	3,495,128.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,695,052.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,536,204.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,987,245.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,615,145.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000.00	4,589,830.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,100,000.00	5,173,435.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,300,000.00	3,670,984.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,530,450.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000.00	4,660,768.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,188,180.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	815,364.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	404,180.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	723,863.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	728,126.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,056,030.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	324,462.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,128,780.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	709,146.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,172,930.00	



IRISH GOVT 3.9	500,000.00	582,305.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,039,757.40
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,083,340.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,972,260.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,500,000.00	1,520,985.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,746,206.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,563,765.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,481,508.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	422,684.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,745,936.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,120,420.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,634,625.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,300,000.00	1,662,882.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,600,000.00	2,408,624.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	869,360.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,576,680.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,159,810.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,483,970.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,221,576.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,034,110.00
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,114,850.00
REP OF AUSTRIA 0.5	2,000,000.00	2,059,440.00
REP OF AUSTRIA 0.5	600,000.00	609,582.00
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,472,338.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	209,160.00
REP OF AUSTRIA 1.2	400,000.00	433,788.00
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	202,622.00
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	546,085.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,212,145.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,094,050.00
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	745,716.00
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	884,592.00
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	682,662.00
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,097,730.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,123,750.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	919,315.00
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,583,085.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,030,132.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,339,550.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,505,240.00
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,106,765.00
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,036,680.00
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,047,680.00

	SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,038,840.00	
	SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,097,780.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	1,200,000.00	1,254,984.00	
	SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,665,776.00	
	SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,053,050.00	
	SPANISH GOV'T 1.45	800,000.00	830,560.00	
	SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,588,065.00	
	SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,367,574.00	
	SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	410,384.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	1,400,000.00	1,534,708.00	
	SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,162,260.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,220,420.00	
	SPANISH GOV'T 2.35	1,400,000.00	1,553,342.00	
	SPANISH GOV'T 2.7	400,000.00	443,964.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,391,627.00	
	SPANISH GOV'T 2.9	1,800,000.00	2,090,970.00	
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,384,867.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,248,213.00	
	SPANISH GOV'T 4	1,800,000.00	1,881,990.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,292,543.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,395,080.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,277,216.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,800,000.00	2,707,326.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,449,720.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,160,860.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,600,000.00	2,452,144.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,074,680.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,940,496.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,022,075.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,019,356.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	1,900,000.00	2,923,549.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,575,012.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,445,125.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,239,324.00	
	ユーロ 小計	434,780,000.00	505,670,882.70 (64,017,933,749)	
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,188,504.00	
	UK TSY GILT 0.75	300,000.00	298,521.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,700,000.00	1,719,363.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,936,888.00	
	UK TSY GILT 1.5	2,250,000.00	2,324,722.50	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,615,374.00	

	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	459,130.50
	UK TSY GILT 1.625	1,400,000.00	1,452,136.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,093,690.00
	UK TSY GILT 1.75	1,300,000.00	1,321,307.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	302,025.00
	UK TSY GILT 2	600,000.00	609,126.00
	UK TSY GILT 2	1,800,000.00	1,916,226.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,861,028.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,071,376.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,863,778.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,088,656.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	2,733,160.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,297,940.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,081,960.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	535,395.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,453,408.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,638,495.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,910,213.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,386,264.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	1,877,428.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,373,132.00
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,521,943.50
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	1,907,685.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,639,386.00
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,250,108.00
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,924,068.00
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	1,903,203.00
	UK TSY GILT 4.5	1,700,000.00	2,628,438.00
	UK TSY GILT 4.75	1,250,000.00	1,714,275.00
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,983,111.00
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,971,104.00
	UK TSY GILT 6	1,200,000.00	1,726,644.00
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,870,273.80
	英債券 小計	59,170,000.00	74,449,485.30 (10,920,250,503)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	10,100,000.00	10,752,965.00
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,547,470.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,767,300.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,965,440.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	5,000,000.00	7,376,350.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	8,600,000.00	9,370,560.00
	スウェーデンクローナ 小計	43,700,000.00	49,780,085.00 (601,841,227)

ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,964,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,057,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,500,000.00	6,643,975.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,110,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,282,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,296,400.00	
ノルウェークローネ 小計		30,500,000.00	31,354,575.00	(413,566,844)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,500,000.00	3,545,850.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	1,900,000.00	1,991,010.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,442,500.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	9,500,000.00	10,755,900.00	
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,653,800.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	11,700,000.00	20,978,100.00	
デンマーククローネ 小計		38,600,000.00	50,367,160.00	(854,227,033)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,000,000.00	1,999,800.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,003,600.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,009,000.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,466,250.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	2,931,000.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,900,000.00	6,136,000.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	2,915,730.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,107,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,392,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,734,786.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,250,000.00	
ポーランドズロチ 小計		34,300,000.00	35,945,166.00	(1,063,258,010)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	3,007,410.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,013,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	410,300.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,300,000.00	2,359,340.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	800,000.00	840,080.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,648,212.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,200,000.00	2,346,740.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	1,937,044.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,610,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	856,720.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,100,000.00	1,207,765.90	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,071,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,123,060.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,134,000.00	

	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,471,284.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,831,630.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	900,000.00	926,139.33	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,804,180.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,600,000.00	3,175,640.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,200,000.00	2,540,010.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,800,000.00	3,039,540.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,402,750.00	
	オーストラリアドル 小計	39,600,000.00	43,756,446.53 (3,513,642,656)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,108,910.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,033,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	417,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	727,457.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	427,280.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	737,450.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,041,100.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	800,000.00	815,128.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	566,460.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,200,000.00	1,326,600.00	
	シンガポールドル 小計	7,800,000.00	8,201,785.50 (678,943,803)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	5,000,000.00	4,989,828.35	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,100,000.00	8,880,593.08	
	MALAYSIA GOVT 3.955	1,000,000.00	1,014,585.50	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,500,000.00	5,536,230.70	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,263,827.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,075,136.20	
	マレーシアリングgit 小計	28,600,000.00	28,760,200.83 (783,427,870)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	63,000,000.00	45,000,900.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	16,000,000.00	15,956,800.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	60,000,000.00	50,676,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	9,286,000.00	
	南アフリカランド 小計	149,000,000.00	120,919,700.00 (970,985,191)	
	合計		165,139,623,462 (165,139,623,462)	

(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 215銘柄	46.0%	46.5%

カナダドル	国債証券	24銘柄	1.9%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	8銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券	266銘柄	38.4%	38.8%
英ポンド	国債証券	39銘柄	6.5%	6.6%
スウェーデンクローナ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	11銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	6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

該当事項はありません。

### マネーインカム・マザーファンド

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成30年 4月13日現在）	（平成31年 4月15日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	470,935,467	628,838,769
コール・ローン	142,753,826	53,386,960
特殊債券	1,815,562,060	1,809,408,010
未収入金	1,040,000	-
未収利息	4,904,930	3,743,916
前払費用	299,178	442,132
流動資産合計	2,435,495,461	2,495,819,787
資産合計	2,435,495,461	2,495,819,787
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,718,962	70,000
未払利息	418	155
その他未払費用	57,925	17,530
流動負債合計	13,777,305	87,685
負債合計	13,777,305	87,685
純資産の部		
元本等		
元本	2,395,913,189	2,470,784,621
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	25,804,967	24,947,481
元本等合計	2,421,718,156	2,495,732,102
純資産合計	2,421,718,156	2,495,732,102
負債純資産合計	2,435,495,461	2,495,819,787

#### 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在)	(平成31年 4月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,395,913,189口	2,470,784,621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) 1.0108円 10,108円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.0101円 10,101円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15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。
	(1)金融商品の内容

項目	自 平成30年 4月14日 至 平成31年 4月15日
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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せん。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</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	(平成31年 4月15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30年 4月14日 至 平成31年 4月15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 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,308,650,457円
同期中における追加設定元本額	2,291,651,696円
同期中における一部解約元本額	1,204,388,964円
平成30年 4月13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）	64,196,678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）	60,612,220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）	39,269,806円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	12,867,654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）	12,031,132円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	5,975,540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）	15,944,434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

（平成30年 4月13日現在）	
S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	592,794,406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＞	477,799,755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＞	1,114,025,052円
合計	2,395,913,189円

（平成31年 4月15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	2,164,761,637円
同期中における一部解約元本額	2,089,890,205円
平成31年 4月15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）	14,875,223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）	79,155,853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）	56,665,796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）	14,490,786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）	16,880,283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）	8,805,949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）	20,734,392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＞	699,943,772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＞	492,643,108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＞	1,066,192,947円
合計	2,470,784,621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6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,835,000	
	第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	131,000,000	131,408,720	

第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,423,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,619,000	
第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,034,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	201,000,000	202,813,020	
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	100,873,000	
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	101,072,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,560,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,031,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,226,000	
第5回政府保証阪神高速道路株式会社債券	64,600,000	65,404,270	
第203回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,109,000	
合計	1,796,600,000	1,809,408,010	

#### 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12期中間計算期間(平成31年4月16日から令和1年10月15日まで)の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第12期中間計算期間 (令和1年10月15日現在)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	9,313,718
親投資信託受益証券	1,305,683,235
流動資産合計	1,314,996,953
資産合計	1,314,996,953
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	510
未払受託者報酬	197,388
未払委託者報酬	2,566,027
未払利息	18
その他未払費用	32,901
流動負債合計	2,796,844
負債合計	2,796,844
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	812,318,194
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	499,881,915
元本等合計	1,312,200,109
純資産合計	1,312,200,109
負債純資産合計	1,314,996,953

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期中間計算期間 自 平成31年 4月16日 至 令和 1年10月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	11,777,519
営業収益合計	11,777,519
営業費用	
支払利息	2,750
受託者報酬	197,388
委託者報酬	2,566,027
その他費用	34,386
営業費用合計	2,800,551
営業利益又は営業損失（ ）	8,976,968
経常利益又は経常損失（ ）	8,976,968
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,976,968
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（ ）	905,970
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	441,204,658
剰余金増加額又は欠損金減少額	72,979,054
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	72,979,054
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,184,735
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,184,735
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（ ）	499,881,915

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第12期中間計算期間 自 平成31年 4月16日 至 令和 1年10月15日
1. 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>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成31年 4月16日から令和 1年10月15日までとなっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第12期中間計算期間 (令和 1年10月15日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		812,318,194口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6154円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,154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12期中間計算期間 (令和 1年10月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第12期中間計算期間 (令和 1年10月15日現在)
期首元本額	725,517,767円
期中追加設定元本額	126,721,643円
期中一部解約元本額	39,921,216円

## (参考)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年10月15日現在)

## 資産の部

## 流動資産

コール・ローン

2,115,068,249

株式

164,849,727,040

派生商品評価勘定

31,343,060



(令和 1年10月15日現在)

未収入金	221,700
未収配当金	1,620,367,523
差入委託証拠金	51,215,000
流動資産合計	168,667,942,572
資産合計	168,667,942,572
負債の部	
流動負債	
前受金	31,485,000
未払解約金	230,155,430
未払利息	4,288
その他未払費用	16,240
流動負債合計	261,660,958
負債合計	261,660,958
純資産の部	
元本等	
元本	65,158,684,957
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	103,247,596,657
元本等合計	168,406,281,614
純資産合計	168,406,281,614
負債純資産合計	168,667,942,572

## 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10月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（令和 1年10月15日現在）	
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	株式	2,954,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		65,158,684,957口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.5846円
	(10,000口当たりの純資産額	25,846円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（令和 1年10月15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）

（令和 1年10月15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	3,466,776,940	-	3,498,120,000	31,343,060
	東証株価指数先物	3,466,776,940	-	3,498,120,000	31,343,060
合計		3,466,776,940	-	3,498,120,000	31,343,060

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(令和 1年10月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,243,723,709円
同期中における追加設定元本額	5,447,954,122円
同期中における一部解約元本額	9,532,992,874円
令和 1年10月15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	10,219,030,750円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	899,616,160円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,213,913,597円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,003,614,097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)	101,329,557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)	7,168,709円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	25,144,708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)	66,927,984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)	110,849,918円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	70,851,746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)	157,568,422円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,812,283,166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	11,048,331,185円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	624,385,631円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	650,938,401円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	529,073,120円
イオン・バランス戦略ファンド	47,714,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,874,302円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	49,840,831円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,765,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	122,970,110円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	70,654,897円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,939,445円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	12,219,859円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	80,525円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	141,272円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	202,283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)	4,064,528,804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>	23,808,163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>	222,305,218円
S M A M ・バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	3,250,926,659円

S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,409,053,393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 >	8,834,785,438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 >	60,158,003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 >	222,053,327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 >	794,882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 >	912,438,081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 >	58,078,019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 >	378,569,673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 >	1,106,018,298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 >	895,878,403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 >	2,937,069,966円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,158,682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 >	61,962,847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 >	95,087,464円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	48,118,306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 >	22,678,789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 >	195,330,953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 >	367,776,457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 >	53,358,501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 >	116,882,285円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	60,142,141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 >	9,576,114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 >	74,791,010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 >	925,873,046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 )	195,800,627円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	20,874,254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 >	1,275,659,056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 >	204,692,490円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	114,936,447円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	13,800,187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 >	87,168,514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 >	125,175,129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 >	139,630,462円
合計	65,158,684,957円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年10月15日現在)

## 資産の部

## 流動資産

コール・ローン

469,934,321

国債証券

105,284,578,970

地方債証券

10,012,711,980

(令和 1年10月15日現在)

特殊債券	15,907,698,387
社債券	7,076,489,000
未収入金	116,604,100
未収利息	275,670,492
前払費用	2,701,983
流動資産合計	139,146,389,233
資産合計	139,146,389,233
負債の部	
流動負債	
未払解約金	175,886,000
未払利息	952
その他未払費用	6,222
流動負債合計	175,893,174
負債合計	175,893,174
純資産の部	
元本等	
元本	106,908,788,156
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,061,707,903
元本等合計	138,970,496,059
純資産合計	138,970,496,059
負債純資産合計	139,146,389,233

## 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10月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年10月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	106,908,788,156口

項目	(令和 1年10月15日現在)	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,2999円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,999円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年10月15日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(令和 1年10月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	135,164,231,551円
同期中における追加設定元本額	9,162,929,188円
同期中における一部解約元本額	37,418,372,583円
令和 1年10月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,793,635,263円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,224,117,516円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,755,676,341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)	728,073,950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)	49,533,505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)	175,533,278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)	333,408,086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)	317,738,625円

(令和 1年10月15日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	122,351,090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)	233,927,116円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	96,004,390円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,490,702,130円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,024,214,279円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	364,333,811円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	11,316,474円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	702,800,255円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	244,008,288円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	303,330,834円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	61,201,295円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,898,404円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	35,866,739円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	424,416円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	271,637円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	118,060円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,793,124,662円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	16,965,985,262円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,002,152,543円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,097,097,588円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	344,591,281円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	574,619,653円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,673,610円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	254,801,592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>	112,447,687円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,939,775,338円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,118,069,751円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,617,641,404円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,006,653,910円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,241,258円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,459,595,324円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	482,254,878円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	804,694,624円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	185,676,881円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,533,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,847,121,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,378,215,357円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	761,452,849円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	996,703,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	236,676,654円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,229,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	342,228,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,967,320,873円

(令和 1年10月15日現在)	
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 >	290,439,860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>	153,215,984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 >	699,339,354円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,001,925,029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>	2,333,801,822円
合計	106,908,788,156円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年10月15日現在)

### 資産の部

#### 流動資産

預金	5,757,350,640
コール・ローン	299,204,914
株式	201,927,163,761
投資証券	5,738,483,871
派生商品評価勘定	26,320,512
未収入金	4,305,015
未収配当金	224,613,338
前払金	14,774,520
差入委託証拠金	1,376,256,686

流動資産合計	215,368,473,257
--------	-----------------

資産合計	215,368,473,257
------	-----------------

### 負債の部

#### 流動負債

派生商品評価勘定	41,095,032
未払解約金	190,484,468
未払利息	606
その他未払費用	4,507

流動負債合計	231,584,613
--------	-------------

負債合計	231,584,613
------	-------------

### 純資産の部

#### 元本等

元本	59,221,160,693
----	----------------

#### 剰余金

剰余金又は欠損金( )	155,915,727,951
-------------	-----------------

元本等合計	215,136,888,644
-------	-----------------

純資産合計	215,136,888,644
-------	-----------------

負債純資産合計	215,368,473,257
---------	-----------------

## 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10月15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	(令和 1年10月15日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,221,160,693口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.6328円
	(10,000口当たりの純資産額)	36,328円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年10月15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)

(令和 1年10月15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	7,421,610,642	-	7,406,836,122	14,774,520	
	SPMINI 1912	5,375,116,656	-	5,353,299,841	21,816,815	
	DJ EUR 1912	1,269,572,356	-	1,283,551,389	13,979,033	
	FTSE 1912	448,145,034	-	441,758,947	6,386,087	
	SPI200 1912	328,776,596	-	328,225,945	550,651	
合計		7,421,610,642	-	7,406,836,122	14,774,520	

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(令和 1年10月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	51,227,388,044円
同期中における追加設定元本額	17,032,155,521円
同期中における一部解約元本額	9,038,382,872円
令和 1年10月15日現在における元本の内訳	

(令和1年10月15日現在)	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	24,036,869,611円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	319,518,417円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,281,419,623円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	854,932,215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)	81,274,299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)	2,235,595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)	8,813,712円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	24,250,262円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	50,064,204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)	35,961,857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)	84,765,274円
外国株式指数ファンド	519,912,079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	4,458,093,869円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	387,179,883円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	400,756,510円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	324,705,691円
イオン・バランス戦略ファンド	14,934,063円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,554,136円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	36,272,187円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,400,907円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	87,664,446円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	50,457,637円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	68,347,371円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	17,526,290円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	56,291円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,542,929,830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>	8,528,434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>	73,969,974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>	1,527,631,686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>	1,460,709,925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>	6,139,461,309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>	20,735,530円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	103,934,006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>	416,205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>	731,851,301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>	61,064,211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>	171,173,908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>	767,803,553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>	632,441,685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>	1,551,780,968円

（令和 1年10月15日現在）	
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	807,485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）	301,615,053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 >	130,007,149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 >	22,361,547円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	13,453,501円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	6,751,404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 >	45,345,947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 >	110,670,335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 >	38,693,046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 >	901,177,843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 >	143,279,352円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	5,931,185,734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 >	274,521,844円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	2,996,230,271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 >	9,674,740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 >	54,990,620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 >	79,129,569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 >	181,514,844円
合計	59,221,160,693円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（令和 1年10月15日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	163,597,816
コール・ローン	318,532,386
国債証券	167,661,971,809
未収利息	1,195,677,583
前払費用	104,985,797
流動資産合計	169,444,765,391

##### 資産合計

	169,444,765,391
--	-----------------

#### 負債の部

##### 流動負債

未払解約金	171,762,273
未払利息	645
その他未払費用	53,631
流動負債合計	171,816,549

##### 負債合計

	171,816,549
--	-------------

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	93,560,066,510
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	75,712,882,332

(令和 1年10月15日現在)

元本等合計	169,272,948,842
純資産合計	169,272,948,842
負債純資産合計	169,444,765,391

## 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10月15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	(令和 1年10月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	93,560,066,510口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8092円
	(10,000口当たりの純資産額 18,092円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年10月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(令和 1年10月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	93,585,617,520円
同期中における追加設定元本額	12,912,712,113円
同期中における一部解約元本額	12,938,263,123円
令和 1年10月15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	21,222,791,904円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	632,548,159円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,712,421,647円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	851,531,522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)	61,971,088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)	8,916,951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)	31,677,757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)	89,319,612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)	125,268,897円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	67,153,713円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	144,721,418円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	18,634,042円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	158,512,146円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	181,619,505円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	153,088,164円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,209,152円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,773,025円

(令和1年10月15日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,995,909円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	78,551,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,200,929円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,668,865円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	34,515,320円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635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)	56,364円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,364円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,715,287,390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>	68,956,145円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,777,101,415円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,510,421,632円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,414,191,630円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,984,328円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	550,315円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	730,535,239円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,538,130,778円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,902,337,637円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,219,042,780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>	10,375,720,969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)	393,318,555円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	174,618,277円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	133,618,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,602,622円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,553,191円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	136,604,926円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	521,741,480円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	55,958,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,962,548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>	5,611,476円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,306,591,090円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928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>	2,919,368,254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>	1,449,466,319円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,881,122,801円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	628,558,255円

（令和 1年10月15日現在）	
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>	14,860,487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>	42,055,806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>	214,675,367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>	308,384,760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>	611,828,881円
合計	93,560,066,510円

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（令和 1年10月15日現在）

## 資産の部

## 流動資産

コール・ローン

669,800,931

特殊債券

1,918,463,120

未収利息

3,944,507

前払費用

1,851,559

流動資産合計

2,594,060,117

## 資産合計

2,594,060,117

## 負債の部

## 流動負債

未払解約金

1,559,999

未払利息

1,357

その他未払費用

5,147

流動負債合計

1,566,503

## 負債合計

1,566,503

## 純資産の部

## 元本等

元本

2,567,483,529

剰余金

剰余金又は欠損金（ ）

25,010,085

元本等合計

2,592,493,614

## 純資産合計

2,592,493,614

## 負債純資産合計

2,594,060,117

## 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10月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年10月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,567,483,529口
2. 1単位当たり純資産の額	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)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年10月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(特殊債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(令和 1年10月15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	586,313,789円
同期中における一部解約元本額	489,614,881円
令和 1年10月15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)	94,036,083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)	74,595,659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)	21,405,330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)	11,400,200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)	24,348,577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>	687,528,243円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0<適格機関投資家限定>	498,583,702円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	1,138,896,267円
合計	2,567,483,529円

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）

2019年10月31日現在

資産総額	1,356,020,798円
負債総額	372,889円
純資産総額（ - ）	1,355,647,909円
発行済口数	824,837,711口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6435円
（1万口当たり純資産額）	（16,435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。

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2019年10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。

###### ハ 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

###### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年10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	757	8,268,036
単位型株式投資信託	118	650,266
追加型公社債投資信託	1	28,871
単位型公社債投資信託	187	515,521
合計	1,063	9,462,696

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第34期（平成30年4月1日から平成31年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第35期中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

### (1)【貸借対照表】

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
(単位：千円)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548

未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	185,371	173,517
器具備品	300,694	751,471
有形固定資産合計	486,065	924,988
無形固定資産		
ソフトウェア	409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定	5,755	183,528
電話加入権	56	44
商標権	-	60
無形固定資産合計	415,576	663,501
投資その他の資産		
投資有価証券	10,616,594	10,829,628
関係会社株式	10,412,523	10,252,067
長期差入保証金	658,505	2,004,451
長期前払費用	69,423	97,107
会員権	7,819	7,819
繰延税金資産	1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計	23,159,314	24,617,457
固定資産合計	24,060,956	26,205,946
資産合計	53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
固定負債		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751

負債合計	13,949,354	14,678,146
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
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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



諸会費	45,465	23,756
情報機器関連費	2,582,734	2,872,416
販売促進費	34,333	49,118
その他	136,669	148,307
営業費用合計	28,121,520	30,167,918
一般管理費		
給料		
役員報酬	196,529	190,951
給料・手当	6,190,716	6,308,066
賞与	601,375	514,259
賞与引当金繰入額	1,566,810	1,235,936
交際費	25,709	27,802
寄付金	-	82
事務委託費	256,413	286,905
旅費交通費	220,569	228,538
租税公課	282,036	285,369
不動産賃借料	654,286	612,410
退職給付費用	419,884	463,553
固定資産減価償却費	329,756	378,530
諸経費	285,490	290,243
一般管理費合計	11,029,580	10,822,651
営業利益	7,379,378	6,008,044

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(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)	
営業外収益				
受取配当金	51,335		-	
受取利息	520		623	
時効成立分配金・償還金	2,622		72	
原稿・講演料	894		1,951	
雑収入	10,669		36,408	
営業外収益合計	66,042		39,055	
営業外費用				
為替差損	5,125		15,760	
雑損失	913		7,027	
営業外費用合計	6,038		22,787	
経常利益	7,439,383		6,024,312	
特別利益				
投資有価証券償還益	61,842		289,451	
投資有価証券売却益	30,980		7,247	
過去勤務費用償却益	1	-	79,850	
特別利益合計	92,822		376,549	
特別損失				
固定資産除却損	2	354,695	1,462	
投資有価証券償還損		141,666	13,668	
投資有価証券売却損		9,634	14,605	
関係会社株式評価損	3	-	160,455	
合併関連費用	4	-	187,140	

特別損失合計	505,996	377,331
税引前当期純利益	7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税	2,350,891	1,750,031
法人税等調整額	280,166	90,084
法人税等合計	2,070,725	1,840,116
当期純利益	4,955,483	4,183,413

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額					
剰余金の配当	1,887,480	1,887,480			1,887,480
当期純利益	4,955,483	4,955,483			4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413

株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本		評価・換算差額等		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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

#### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

##### (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

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

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

##### (貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

#### 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

#### 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

##### (損益計算書関係)

#### 1 過去勤務費用償却益

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

#### 2 固定資産除却損

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

#### 3 関係会社株式評価損

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

#### 4 合併関連費用

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000.00	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	17,622,360株	-	17,640,000株

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。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及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

前事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

当事業年度（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

#### 負債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

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であることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成30年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成31年3月31日)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

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

当事業年度(平成31年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
728,127	7,247	14,605

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、有価証券について160,455千円(関係会社株式160,455千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した



上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額（注）	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

（注）評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

（セグメント情報等）

前事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	------------	-----	-------------	-----------	----------------	-----------	-------	------	----	------

親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又は 職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

### (1 株当たり情報)

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

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

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

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

### (重要な後発事象)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

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

当事業年度(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

取得による企業結合

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

## 1. 企業結合の概要

### (1) 被取得企業の名称及び事業の内容

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

### (2) 企業結合を行う主な理由

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

### (3) 企業結合日

平成31年4月1日

### (4) 企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

### (5) 結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

### (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

### (1) 合併比率

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

### (2) 合併比率の算定方法

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

### (3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

## 4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間  
(令和1年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		31,390,396
顧客分別金信託		120,015
前払費用		518,120
未収委託者報酬		9,224,857
未収運用受託報酬		2,518,829
未収投資助言報酬		300,807
未収収益		49,098
その他		251,169
流動資産合計		<u>44,373,295</u>
固定資産		
有形固定資産	1	1,165,925
無形固定資産		
のれん		35,720,818
顧客関連資産		18,841,803
その他		1,287,309
無形固定資産合計		<u>55,849,931</u>
投資その他の資産		
投資有価証券		19,980,993
関係会社株式		11,208,183
その他		2,725,272
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		<u>33,893,699</u>
固定資産合計		<u>90,909,555</u>
資産合計		<u>135,282,851</u>
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,568
顧客からの預り金		3,725
その他の預り金		117,464
未払金		4,558,058
未払費用		4,003,445
未払法人税等		1,108,639
前受収益		37,155
賞与引当金		1,620,047
資産除去債務		248,260
その他	2	262,615
流動負債合計		<u>11,960,980</u>
固定負債		
リース債務		1,045
退職給付引当金		5,317,984
賞与引当金		2,537
その他		218,125
繰延税金負債		3,515,376
固定負債合計		<u>9,055,069</u>
負債合計		<u>21,016,049</u>
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		<u>90,555,984</u>
利益剰余金		
利益準備金		284,245

その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	19,373,541
利益剰余金合計	21,194,745
株主資本合計	113,750,729
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	516,072
評価・換算差額等合計	516,072
純資産合計	114,266,801
負債純資産合計	135,282,851

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			28,593,570
運用受託報酬			4,633,054
投資助言報酬			661,581
その他の営業収益			118,885
営業収益計			34,007,092
営業費用			21,567,446
一般管理費	1		11,224,956
営業利益			1,214,689
営業外収益	2		258,897
営業外費用	3		41,920
経常利益			1,431,666
特別損失	4		11,471
税引前中間純利益			1,420,194
法人税、住民税及び事業税			950,377
法人税等調整額			118,269
法人税等合計			832,107
中間純利益			588,086

## (3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		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
当中間期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,881,513
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,373,541

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			77,989	77,989	77,989
当中間期変動額合計	1,881,513	80,045,486	77,989	77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．資産の評価基準及び評価方法

##### (1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

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）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 2～50年

器具備品 3～20年

##### (2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

##### (3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

#### 3．引当金の計上基準

##### (1)貸倒引当金

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

##### (2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

##### (3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間にお



いて発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

(中間損益計算書)

当社は当中間会計期間より、「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「特別利益」ではなく「営業外収益」として、「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「特別損失」ではなく「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、当中間会計期間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。

この結果、従来の方法に比較して、「特別利益」は23,677千円減少し、「営業外収益」は同額増加しており、「特別損失」は30,023千円減少し、「営業外費用」は同額増加しております。また、「経常利益」は6,346千円減少しております。

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,557,220千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5年6月までの賃借料総額150,945千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自平成31年4月1日至令和1年9月30日)	
1.のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	287,191千円
無形固定資産	1,187,351千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	209,815千円
投資有価証券償還益	5,197千円
投資有価証券売却益	18,480千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	11,810千円
投資有価証券償還損	22,585千円
投資有価証券売却損	7,437千円
4.特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	6,094千円
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であり。	
固定資産除却損	5,377千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

（変動事由の概要）

合併に伴う普通株式の発行による増加 16,230,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

（リース取引関係）

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,675,025千円
1年超	6,419,696千円
合計	8,094,721千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間（令和1年9月30日）

令和1年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。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、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	31,390,396	31,390,396	-
(2)顧客分別金信託	120,015	120,015	-
(3)未収委託者報酬	9,224,857	9,224,857	-
(4)未収運用受託報酬	2,518,829	2,518,829	-
(5)未収投資助言報酬	300,807	300,807	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	19,935,624	19,935,624	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,528,392	2,528,392	-
資産計	66,018,923	66,018,923	-
(1)顧客からの預り金	3,725	3,725	-
(2)未払金			
未払手数料	4,192,554	4,192,554	-
負債計	4,196,280	4,196,280	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

（6）投資有価証券

その他有価証券

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

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

(7) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 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

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	11,208,183
合計	11,208,183

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であることから、時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間（令和1年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 11,208,183千円）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、記載していません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,082,796	11,176,487	906,308
小計	12,082,796	11,176,487	906,308
(2) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,852,827	8,004,506	151,679
小計	7,852,827	8,004,506	151,679
合計	19,935,624	19,180,994	754,629

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 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、記載していません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

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

## 1. 企業結合の概要

## (1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

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

平成31年4月1日

## (4) 企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

## (5) 結合後企業の名称

三井住友D S アセットマネジメント株式会社

## (6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成31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 平成31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. 中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年4月1日から令和1年9月30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株を割当て交付いたしました。

## (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、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

## (3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

## 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) 発生したのれんの金額

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

## （資産除去債務関係）

当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

当中間会計期間 （自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）	
期首残高	-
合併による増加額（注）	248,260
中間期末残高	248,260

（注）合併に伴い主として霞ヶ関オフィスの不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、資産除去債務の金額を計上しております。

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。

## （セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,373円68銭
1株当たり中間純利益	17円36銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（参考）大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

**独立監査人の監査報告書**

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 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		その他利益剰余金	繰越利益剰余金
				別途積立金		
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 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

## 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

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

## 負債

## (1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(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) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

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

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期(平成30年3月31日)

(単位：千円)

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

第47期(平成31年3月31日)

(単位：千円)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期(平成30年3月31日)

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

第47期(平成31年3月31日)

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



## 2. 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的主要原因別の内訳

(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 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

**5【その他】****イ 定款の変更、その他の重要事項****(イ) 定款の変更**

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

**(ロ) その他の重要事項**

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

- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実該当ありません。

**第2【その他の関係法人の概況】****1【名称、資本金の額及び事業の内容】****イ 受託会社**

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2019年9月末現在)

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

## 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2019年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## □ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
エイチ・エス証券株式会社	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。
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

資本金の額は、2019年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載していません。

## 2【関係業務の概要】

## イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

## ロ 販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

## 第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

(2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

(3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。

(4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

(5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。

(6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

(7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合に

はその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。

- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
  - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
  - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
  - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。



## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤陽一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

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

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. 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1年5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ターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）の平成30年4月14日から平成31年4月15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ターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）の平成31年4月15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**

令和1年11月22日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

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平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 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な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DSアセットマネジメント株式会社の令和1年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年4月1日から令和1年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

令和1年11月26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ターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）の平成31年4月16日から令和1年10月15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ターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）の令和1年10月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年4月16日から令和1年10月15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。