

【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】	2021年1月21日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） アセットアロケーション・ファンド（成長型）
【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】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

（上記3ファンドの愛称として「らっぶちゃん」という名称を用いることがあります。）

以下、上記3ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「アセットアロケーション・ファンド（安定型）」を「安定型」、「アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）」を「安定成長型」、「アセットアロケーション・ファンド（成長型）」を「成長型」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

す。

(5) 【申込手数料】

原則として、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）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2021年1月22日から2021年7月20日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、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

(1 2) 【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 スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」(ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること)による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ お申込不可日

上記にかかわらず、ニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません(また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。)。

ホ 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。

ヘ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2015年4月17日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3)【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の各法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

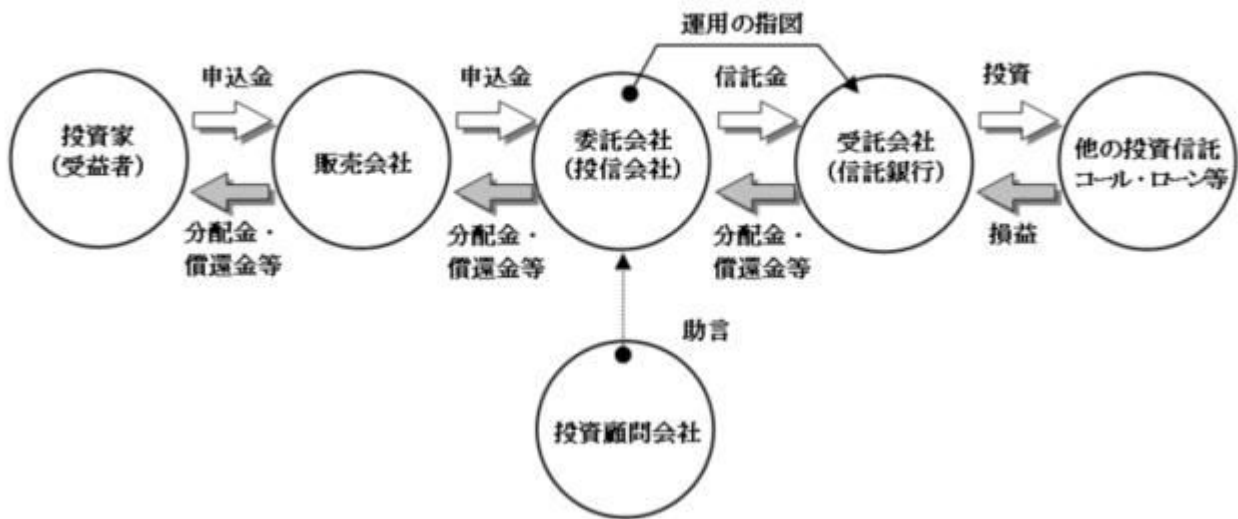
日興グローバルラップ株式会社

「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分に関する投資助言等を行います。

エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)

世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020年11月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

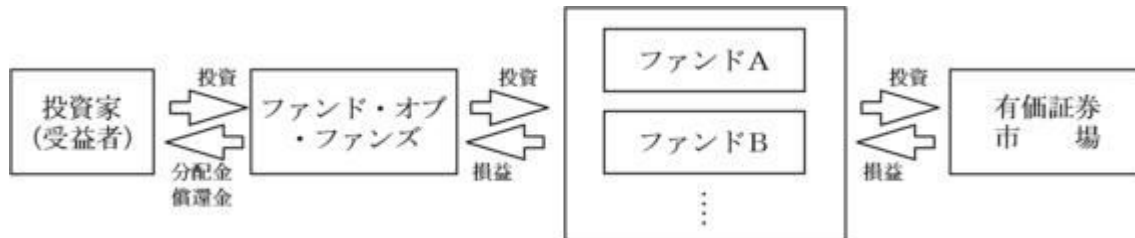
(2020年11月30日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、安定型は信託財産の安定性を、安定成長型は信託財産の安定性と収益性のバランスを、成長型は信託財産の収益性を重視した運用を行います。

（ ）主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券、為替ヘッジ付き新興国債券、ハイイールド債券、為替ヘッジ付きハイイールド債券に投資します。

（ ）投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。

（ロ）運用にあたっては、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、一定の範囲で資産配分を調整することにより、下方リスクを抑制しつつ、中長期的に収益の獲得を目指します。

（ハ）対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。また、投資対象とする投資信託証券の外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

（ニ）投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。

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

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

■投資対象とする投資信託の投資方針等

●すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

▶債券

国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

新興国債券…為替ヘッジなし*

ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・バークレイズ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.25%程度
購入の可否***	2020年11月末現在、日本において一般投資者の購入が可能です。

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

ハイイールド債券…為替ヘッジなし*

ファンド名	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	SSgA ファンズ・マネジメント・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド・ベリリー・リキッド・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。 ベンチマークの値動きと利回りに、経費控除前で、概ね連動する投資成果を上げることがを目標とします。
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.40%程度
購入の可否***	日本において一般投資者の購入が可能です。

*上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。

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

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

▶ 株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として新興国の株式(預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きと連動する投資成果を目指します。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

▶ リート

国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)などを主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

ファンドの特色

1 投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資します。

- 主として、インデックスファンドや上場投資信託証券(ETF)への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

債券

国内債券

先進国債券(除く日本)*1

新興国債券*2

ハイイールド債券*2

株式

国内株式

先進国株式(除く日本)

新興国株式

リート

国内リート

外国リート

*1 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。

*2 当該資産を投資対象とする外貨建投資信託証券に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

2 資産配分比率は、ラップ口座の投資助言に実績を持つ日興グローバルラップおよびエドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)からの投資助言を基に決定します。

- 日興グローバルラップから、「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの3つの基本資産配分(「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分)に関する投資助言を受けます。また、エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から、世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を受けます。
- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、委託会社独自のリスク態度指数を使用します。

3

目標リスク水準の異なる「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の3つのファンドからお選びいただけます。
各ファンド間でのスイッチングが可能です。

安定型 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

安定成長型 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

成長型 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

□ 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行え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。

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

ファンドのしくみ

□ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

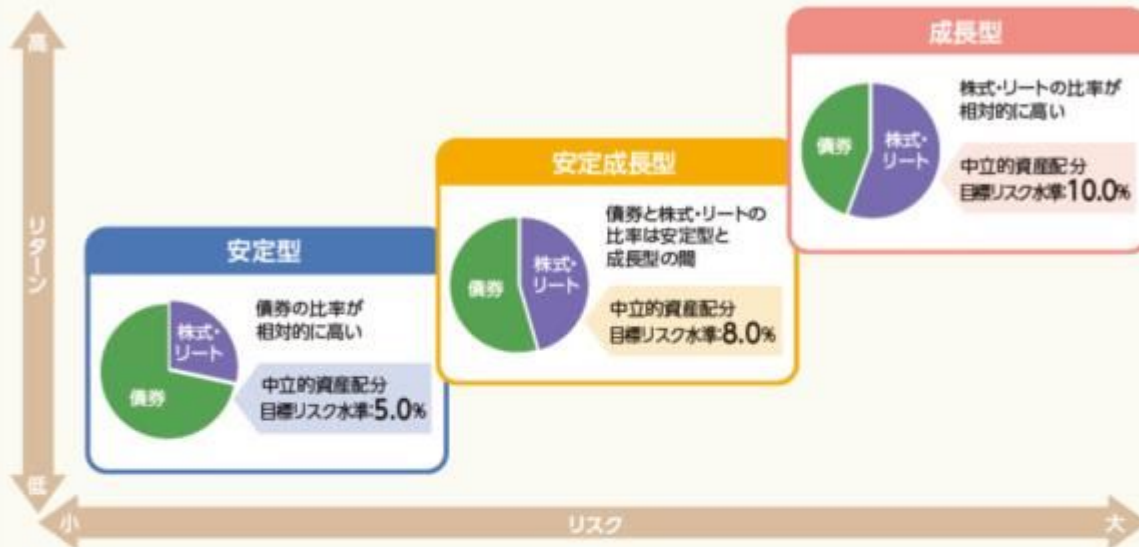


※日興グローバルラップは委託会社の子会社です(100%出資)。

お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンドから選択

■お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）からお選びいただけます。

〔 3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）のリスク・リターン特性のイメージ 〕



〔 各ファンドの3つの基本資産配分の目標リスク水準について 〕

各ファンドの目標リスク水準

	安定型	安定成長型	成長型
保守的資産配分	3.0%	5.5%	7.1%
中立的資産配分	5.0%	8.0%	10.0%
積極的資産配分	7.1%	10.5%	13.0%

- 中立的資産配分の目標リスク水準は、現時点で想定される各ファンドの中長期的な騰落率の変動率（年率標準偏差）を示します。
- 当ファンドでは、市場のリスク選好状況に応じて一定の範囲内で資産配分を調整するため、年1回（原則として毎年2月）、中立的資産配分に加えて、保守的資産配分、積極的資産配分の3つの基本資産配分を策定します。

（出所）日興グローバルラップ

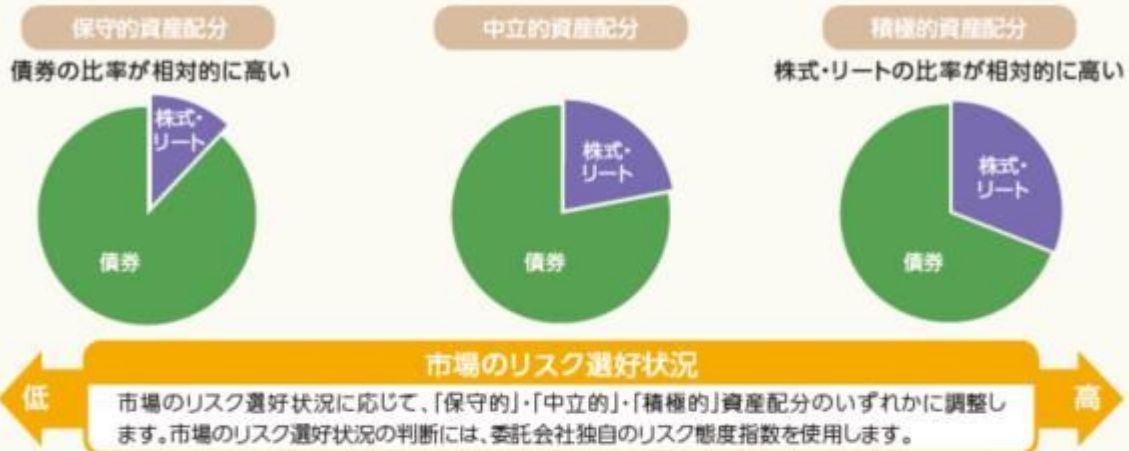
※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。各ファンドの基準価額の騰落率の変動率（年率標準偏差）が目標リスク水準通りになるとは限りません。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※上記の目標リスク水準は2020年2月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

資産配分の調整について

■市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに資産配分を調整することで、中長期的な収益の獲得を目指します。

〔市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整〕

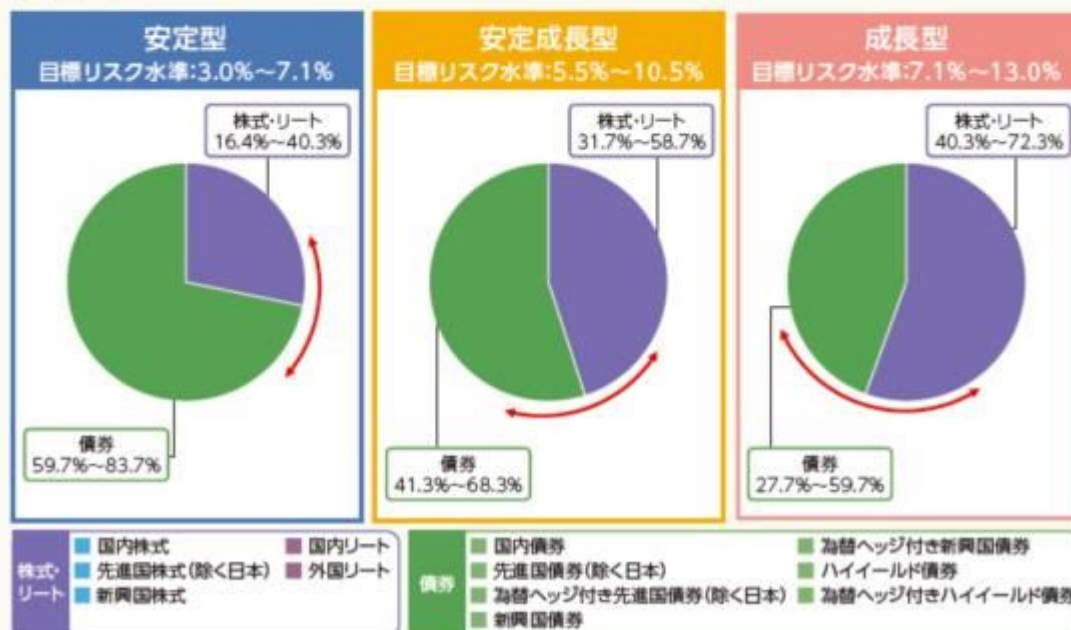


※資産配分の決定にあたっては、エドモンドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

※上記は、安定型を例にした資産配分の調整のイメージであり、実際とは異なる場合があります。

ポートフォリオのイメージ

▶ 資産配分



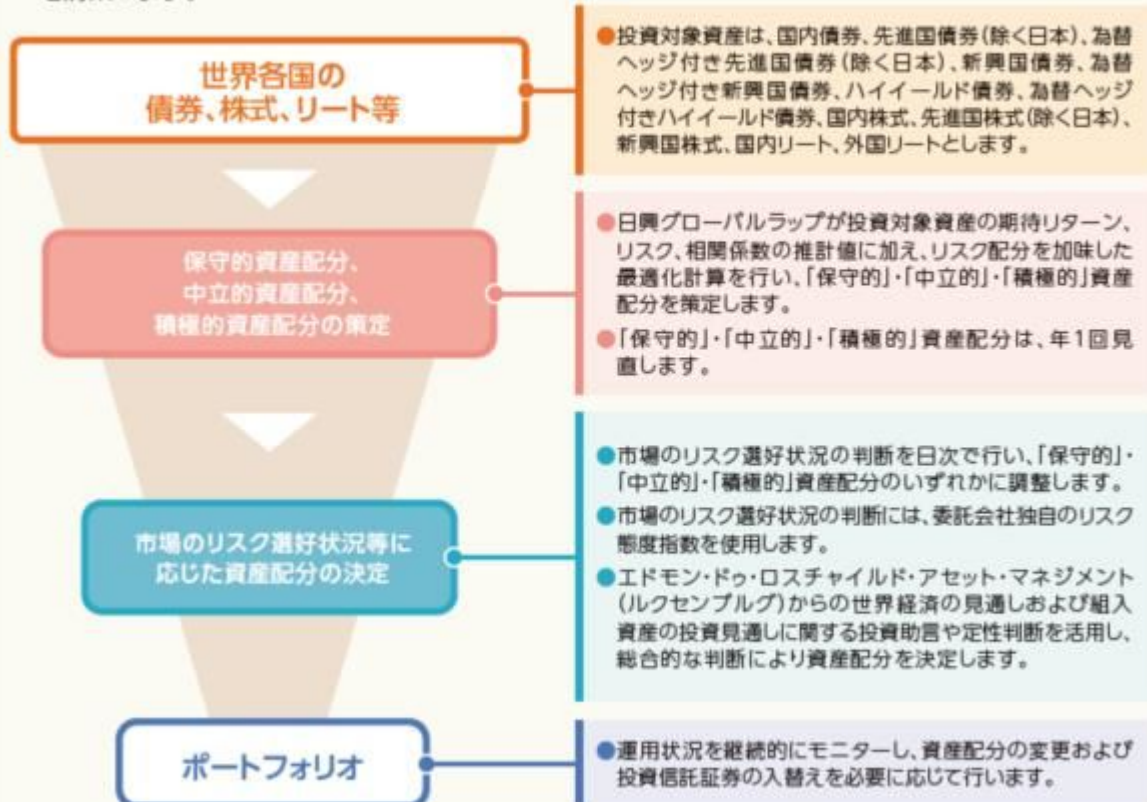
(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※上記は2020年2月に日興グローバルラップから受けた投資助言に基づく資産配分であり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象資産とし、各ファンドについて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分を策定します。市場のリスク選好状況等に応じて資産配分を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2020年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

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

八 投資対象とする金融商品

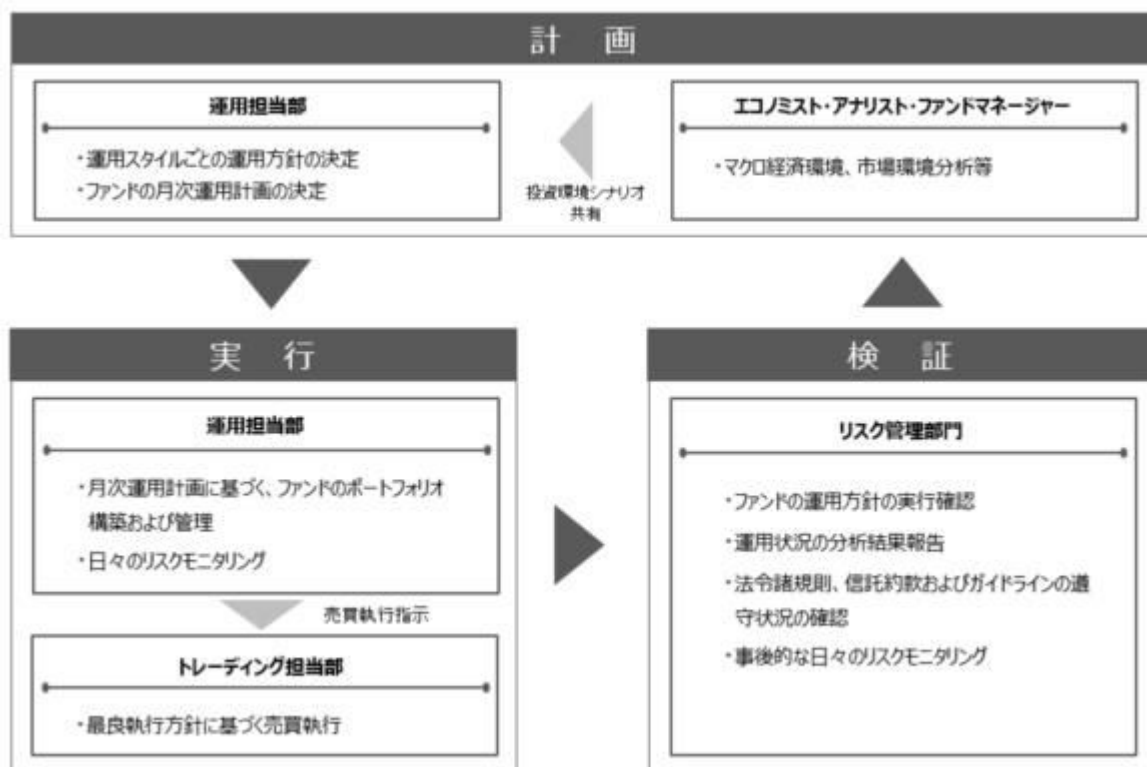
委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

(4) 【配分方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- ロ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、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。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

(5) 【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 外国為替予約取引の指図
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- ト 資金の借入れ
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
 - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 - (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

- イ ファンドのもつリスクの特性
当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。
投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。
当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。
- （イ）株式市場リスク
内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。
- （ロ）債券市場リスク
内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。
- （ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク
リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度（税制、建築規制、会計制度等）の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何

によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 信用リスク

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

(ホ) 為替変動リスク

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

実質外貨建資産の一部に対し、原則として対円で為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。なお、対円で為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。

(ヘ) カントリーリスク

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

(ト) 市場流動性リスク

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 換金制限等に関する留意点

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。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

率を示すものではありません。

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

□ 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。

■安定型



〔 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。



■安定成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

原則として、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)に、1.1%(税抜き1.0%)を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年1.023%（税抜き0.93%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分（税抜き） >		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.47%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
	販売会社	年0.43%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。			
投資対象とする投資信託	各ETFの配分比率の変動幅を加味した場合、管理報酬等の概算値は以下の通りとなります。		
	安定型	年0.00637%～年0.07414%*	
	安定成長型	年0.01957%～年0.09815%*	
	成長型	年0.02479%～年0.11569%*	
	管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して		
	安定型	年1.02937%（税抜き0.93637%）～年1.09714%（税抜き1.00414%）程度*	
	安定成長型	年1.04257%（税抜き0.94957%）～年1.12115%（税抜き1.02815%）程度*	
	成長型	年1.04779%（税抜き0.95479%）～年1.13869%（税抜き1.04569%）程度*	
	上記は直近の基本資産配分および管理報酬率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の見直しおよび実際の組入れ状況等により変動します。 新興国債券の費用は、管理報酬がより高いETFの数値を用いて試算しています。		

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

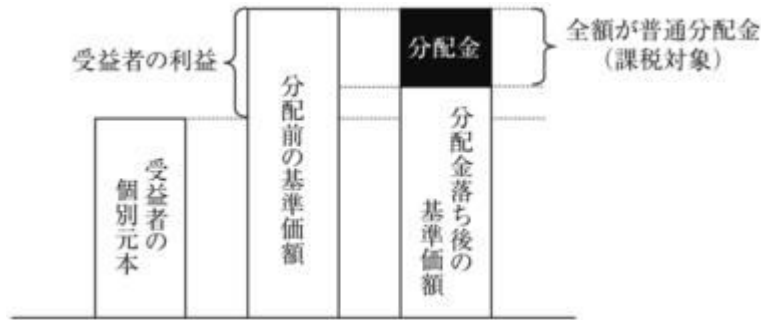
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

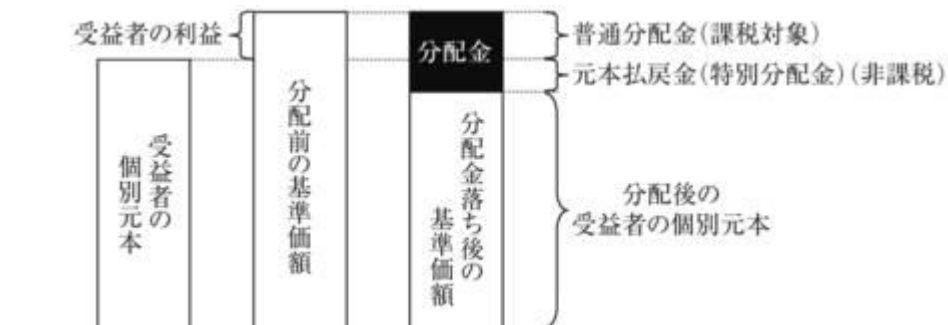
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2020年11月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
投資証券	アメリカ	1,060,702,153	9.12
親投資信託受益証券	日本	10,346,071,327	88.98
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		221,239,983	1.90
合計（純資産総額）		11,628,013,463	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。

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	売建		832,924,260	7.16

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	1,264,796,426	15.03
親投資信託受益証券	日本	6,995,766,284	83.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		153,395,196	1.83
合計(純資産総額)		8,413,957,906	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		1,014,211,440	12.05

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	851,632,335	18.96
親投資信託受益証券	日本	3,546,408,277	78.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		94,804,417	2.11
合計(純資産総額)		4,492,845,029	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		689,950,350	15.35

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

イ 主要投資銘柄

2020年11月30日現在

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

日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,959,241,685	1.5313	4,531,564,890	1.5472	4,578,538,735	39.38
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	1,722,560,539	1.2855	2,214,351,573	1.2802	2,205,222,002	18.96
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	275,982,943	3.7241	1,027,795,117	4.2581	1,175,162,969	10.11
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)	373,453,945	2.4485	914,401,985	2.8704	1,071,962,203	9.22
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	75,830	8,004.72	606,998,258	8,435.86	639,691,870	5.50
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	390,895,787	1.2567	491,238,736	1.5253	596,233,343	5.13
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	275,972,773	2.0627	569,249,039	2.1427	591,326,860	5.09
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	36,342	10,410.81	378,349,908	11,184.79	406,477,907	3.50
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	36,249,708	1.7892	64,857,978	1.9722	71,491,674	0.61
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	29,488,097	1.8725	55,216,462	1.9036	56,133,541	0.48
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,222	10,176.02	12,435,103	11,892.28	14,532,376	0.12

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	9.12
親投資信託受益証券	88.98
合計	98.10

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

イ 主要投資銘柄

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	1,280,244,493	1.5373	1,968,166,742	1.5472	1,980,794,279	23.54
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	280,503,009	3.6578	1,026,046,169	4.2581	1,194,409,862	14.20
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）	408,583,033	2.4346	994,736,253	2.8704	1,172,796,737	13.94
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	772,834,639	1.2831	991,661,611	1.2802	989,382,904	11.76
日本	親投資信託受 益証券	Jリート・インデックス・マザー ファンド	394,587,446	2.0281	800,262,800	2.1427	845,482,520	10.05
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府 債券ETF	94,618	7,809.41	738,910,878	8,435.86	798,184,958	9.49
日本	親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	430,924,258	1.1986	516,505,816	1.5253	657,288,770	7.81
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・バーク レイズ・ハイ・イールド債券ETF	40,939	10,385.88	425,187,677	11,184.79	457,894,421	5.44
日本	親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	42,417,687	1.7743	75,261,703	1.9722	83,656,162	0.99
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	37,799,459	1.8674	70,586,710	1.9036	71,955,050	0.86
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米 ドル建てエマージング・マーケット 債券ETF	733	10,176.02	7,459,026	11,892.28	8,717,047	0.10

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	15.03
親投資信託受益証券	83.14
合計	98.18

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

イ 主要投資銘柄

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	266,224,089	2.4344	648,095,923	2.8704	764,169,625	17.01
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	177,883,661	3.6345	646,522,824	4.2581	757,446,416	16.86
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	399,436,461	1.5464	617,703,630	1.5472	618,008,092	13.76
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	64,888	7,639.03	495,681,489	8,435.86	547,386,603	12.18
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	253,746,070	2.0213	512,896,932	2.1427	543,701,704	12.10
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	280,878,303	1.2029	337,868,511	1.5253	428,423,675	9.54
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	239,570,737	1.2801	306,686,518	1.2802	306,698,457	6.83
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	26,803	10,319.39	276,590,709	11,184.79	299,786,124	6.67
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	37,927,173	1.8656	70,756,934	1.9036	72,198,166	1.61
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	28,274,081	1.7704	50,056,434	1.9722	55,762,142	1.24
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	375	10,176.02	3,816,009	11,892.28	4,459,608	0.10

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	18.96
親投資信託受益証券	78.93
合計	97.89

【投資不動産物件】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	8,022,000.00	843,072,892	832,924,260	7.16

(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。

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	9,768,000.00	1,026,568,936	1,014,211,440	12.05

(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。

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	6,645,000.00	698,356,939	689,950,350	15.35

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
第2期 (2017年 4月26日)	48,551,937,727	48,551,937,727	9,992	9,992
第3期 (2018年 4月26日)	30,744,053,222	30,744,053,222	9,815	9,815
第4期 (2019年 4月26日)	21,753,606,702	21,753,606,702	10,029	10,029
第5期 (2020年 4月27日)	13,719,895,964	13,719,895,964	9,846	9,846
2019年11月末日	16,562,757,693		10,370	
12月末日	16,131,978,864		10,436	
2020年 1月末日	15,799,764,293		10,469	
2月末日	15,025,315,509		10,236	
3月末日	13,814,370,960		9,745	
4月末日	13,666,480,910		9,895	
5月末日	13,660,583,466		9,967	
6月末日	12,915,382,232		9,982	
7月末日	12,658,250,683		10,068	
8月末日	12,529,132,109		10,257	
9月末日	11,866,323,346		10,190	
10月末日	11,505,907,701		10,078	
11月末日	11,628,013,463		10,373	

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
第2期 (2017年 4月26日)	32,241,957,798	32,241,957,798	10,040	10,040
第3期 (2018年 4月26日)	20,024,628,165	20,024,628,165	10,020	10,020
第4期 (2019年 4月26日)	14,199,914,498	14,199,914,498	10,254	10,254
第5期 (2020年 4月27日)	9,390,219,478	9,390,219,478	9,662	9,662
2019年11月末日	11,488,847,507		10,672	
12月末日	11,371,232,394		10,803	
2020年 1月末日	11,151,676,022		10,792	
2月末日	10,327,816,611		10,362	
3月末日	9,266,907,255		9,514	
4月末日	9,472,474,795		9,751	
5月末日	9,530,974,161		9,931	
6月末日	9,303,860,145		9,979	
7月末日	9,126,523,618		10,085	
8月末日	9,243,649,357		10,418	

9月末日	8,939,758,439		10,282	
10月末日	8,282,710,922		10,131	
11月末日	8,413,957,906		10,594	

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
第2期 (2017年 4月26日)	27,043,239,176	27,043,239,176	10,069	10,069
第3期 (2018年 4月26日)	14,776,735,458	14,776,735,458	10,111	10,111
第4期 (2019年 4月26日)	10,908,544,788	10,908,544,788	10,362	10,362
第5期 (2020年 4月27日)	5,612,179,736	5,612,179,736	9,482	9,482
2019年11月末日	7,216,556,747		10,792	
12月末日	6,983,742,823		10,962	
2020年 1月末日	6,770,284,197		10,918	
2月末日	6,317,991,526		10,362	
3月末日	5,565,594,061		9,306	
4月末日	5,669,903,393		9,590	
5月末日	5,722,581,017		9,828	
6月末日	5,528,617,548		9,884	
7月末日	5,300,088,665		10,001	
8月末日	5,379,456,520		10,438	
9月末日	4,698,339,170		10,264	
10月末日	4,440,587,885		10,080	
11月末日	4,492,845,029		10,649	

【分配の推移】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0

【収益率の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	収益率（％）
第1期	4.9
第2期	5.0
第3期	1.8
第4期	2.2
第5期	1.8
第6期（中間期）	3.3

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

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第1期	7.0
第2期	8.0
第3期	0.2
第4期	2.3
第5期	5.8
第6期（中間期）	6.3

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

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	収益率(%)
第1期	8.4
第2期	9.9
第3期	0.4
第4期	2.5
第5期	8.5
第6期(中間期)	8.2

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

(4)【設定及び解約の実績】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	14,471,203,211	430,595,693
第2期	39,440,607,065	4,888,096,644
第3期	3,005,688,776	20,274,975,700
第4期	913,665,451	10,547,332,018
第5期	258,180,741	8,014,561,766
第6期(中間期)	144,267,083	2,615,306,524

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,473,777,867	144,788,717
第2期	22,569,690,166	3,786,328,653
第3期	1,994,684,295	14,122,473,521
第4期	758,923,595	6,895,231,238
第5期	498,733,066	4,628,274,076
第6期(中間期)	148,411,806	1,608,702,327

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,883,023,089	225,050,831
第2期	19,324,709,567	6,124,106,042
第3期	2,148,349,345	14,391,885,041
第4期	1,008,692,045	5,095,880,106
第5期	306,069,242	4,915,238,211
第6期(中間期)	83,763,931	1,567,354,104

(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)

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	176,346,813,610	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,139,194,650	2.29
合計(純資産総額)		180,486,008,260	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	3,616,330,000	2.00
合計	買建	-	3,616,330,000	2.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	169,302,719,154	66.63
	イギリス	11,185,498,550	4.40
	スイス	8,885,337,837	3.50

	フランス	8,780,771,470	3.46
	カナダ	8,605,061,143	3.39
	ドイツ	7,592,020,357	2.99
	オーストラリア	5,085,780,875	2.00
	アイルランド	4,591,314,365	1.81
	オランダ	4,527,431,406	1.78
	スウェーデン	2,683,458,529	1.06
	スペイン	2,132,339,946	0.84
	デンマーク	2,045,589,837	0.81
	香港	2,015,760,802	0.79
	イタリア	1,620,002,562	0.64
	フィンランド	1,018,981,626	0.40
	バミューダ	849,014,984	0.33
	ジャージー	822,310,787	0.32
	シンガポール	802,518,157	0.32
	ベルギー	796,293,034	0.31
	ケイマン諸島	508,007,059	0.20
	イスラエル	493,915,926	0.19
	ノルウェー	486,500,133	0.19
	ニュージーランド	258,856,228	0.10
	ルクセンブルグ	216,570,533	0.09
	キュラソー	166,946,526	0.07
	オーストリア	156,025,327	0.06
	ポルトガル	140,222,323	0.06
	リベリア	76,489,353	0.03
	マン島	41,692,136	0.02
	パプアニューギニア	29,649,243	0.01
	小計	245,917,080,208	96.78
新株予約権証券	スイス	1,409,095	0.00
投資証券	アメリカ	4,585,385,097	1.80
	オーストラリア	670,473,008	0.26
	フランス	161,571,299	0.06
	イギリス	140,792,584	0.06
	香港	128,409,118	0.05
	シンガポール	124,282,333	0.05
	カナダ	42,223,830	0.02

	小計	5,853,137,269	2.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,325,527,439	0.92
合計(純資産総額)		254,097,154,011	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,718,971,731	0.67
	買建	ドイツ	382,199,839	0.15
	買建	イギリス	105,766,299	0.04
	買建	オーストラリア	88,871,427	0.03
合計	買建	-	2,295,809,296	0.89

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		287,194,200	0.11
	売建		587,500	0.00

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	2,016,112,611	18.24
	韓国	992,298,380	8.98
	台湾	953,680,869	8.63
	インド	612,305,788	5.54
	中国	515,336,231	4.66
	ブラジル	374,950,374	3.39
	南アフリカ	267,449,044	2.42
	香港	213,924,348	1.94
	タイ	149,757,601	1.35
	メキシコ	132,056,788	1.19

	マレーシア	125,474,600	1.14
	インドネシア	109,498,706	0.99
	フィリピン	57,342,151	0.52
	バミューダ	55,111,378	0.50
	ポーランド	49,174,389	0.44
	チリ	40,534,338	0.37
	アメリカ	30,158,415	0.27
	トルコ	25,943,624	0.23
	ルクセンブルグ	15,992,150	0.14
	ハンガリー	14,618,750	0.13
	コロンビア	13,343,189	0.12
	ギリシャ	9,581,748	0.09
	チェコ	7,770,452	0.07
	エジプト	7,147,651	0.06
	ペルー	2,503,623	0.02
	シンガポール	1,740,191	0.02
	マン島	1,722,002	0.02
	アルゼンチン	1,540,788	0.01
	小計	6,797,070,179	61.48
投資信託受益証券	香港	372,311,081	3.37
投資証券	アメリカ	528,254,566	4.78
	ブラジル	9,320,609	0.08
	メキシコ	3,752,868	0.03
	南アフリカ	2,163,555	0.02
	小計	543,491,598	4.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,342,038,169	30.23
合計(純資産総額)		11,054,911,027	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	3,361,568,730	30.40
合計	買建	-	3,361,568,730	30.40

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		2,553,705,508	23.10
	売建		1,599,033,187	14.46

Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	5,830,352,640	98.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		96,945,752	1.64
合計(純資産総額)		5,927,298,392	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 (%)
REIT指数先物取引	買建	日本	50,640,000	0.85
合計	買建	-	50,640,000	0.85

外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	6,112,248,677	72.42
	オーストラリア	650,295,839	7.70
	イギリス	465,663,823	5.52
	シンガポール	345,282,724	4.09
	フランス	212,254,202	2.51
	カナダ	162,843,388	1.93
	香港	145,411,574	1.72
	ベルギー	125,385,212	1.49
	ニュージーランド	41,952,002	0.50
	スペイン	40,558,239	0.48
	ドイツ	24,691,348	0.29

	オランダ	18,096,221	0.21
	ガーンジー	11,770,900	0.14
	アイルランド	10,386,019	0.12
	韓国	5,726,229	0.07
	イスラエル	3,963,883	0.05
	イタリア	1,519,635	0.02
	マン島	1,050,057	0.01
	小計	8,379,099,972	99.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		61,354,651	0.73
合計(純資産総額)		8,440,454,623	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		9,000,127	0.10

国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	106,488,005,120	78.49
地方債証券	日本	8,788,609,360	6.48
特殊債券	日本	14,977,644,424	11.04
社債券	日本	4,357,284,000	3.21
	オーストラリア	200,054,000	0.15
	フランス	199,132,000	0.15
	小計	4,756,470,000	3.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		658,581,246	0.48
合計(純資産総額)		135,669,310,150	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	69,368,436,162	42.56
	フランス	16,917,891,813	10.38
	イタリア	15,620,100,506	9.58
	ドイツ	12,103,391,866	7.43

	イギリス	10,712,297,852	6.57
	スペイン	9,959,487,141	6.11
	オーストラリア	4,334,292,468	2.66
	ベルギー	4,157,058,085	2.55
	オランダ	3,287,951,343	2.02
	カナダ	3,236,726,141	1.99
	オーストリア	2,631,427,870	1.61
	アイルランド	1,318,579,122	0.81
	メキシコ	1,316,859,524	0.81
	フィンランド	1,145,380,347	0.70
	ポーランド	1,047,456,269	0.64
	デンマーク	883,130,351	0.54
	マレーシア	815,775,090	0.50
	シンガポール	698,621,886	0.43
	イスラエル	652,300,919	0.40
	スウェーデン	539,559,484	0.33
	ノルウェー	379,615,152	0.23
	小計	161,126,339,391	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,871,272,102	1.15
合計(純資産総額)		162,997,611,493	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	11,253,593,161	42.48
	フランス	2,803,357,757	10.58
	イタリア	2,446,284,274	9.23
	ドイツ	1,964,398,193	7.42
	イギリス	1,737,160,987	6.56
	スペイン	1,617,904,739	6.11
	オーストラリア	704,069,260	2.66
	ベルギー	680,167,293	2.57
	オランダ	526,735,056	1.99
	カナダ	523,895,456	1.98
	オーストリア	454,708,890	1.72
	シンガポール	242,198,275	0.91
	アイルランド	213,984,758	0.81
	メキシコ	212,797,178	0.80
	フィンランド	181,186,449	0.68
	ポーランド	165,371,973	0.62

	デンマーク	146,934,622	0.55
	イスラエル	112,947,131	0.43
	スウェーデン	84,239,460	0.32
	ノルウェー	57,995,439	0.22
	小計	26,129,930,351	98.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		359,773,410	1.36
合計(純資産総額)		26,489,703,761	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		26,253,543,400	99.10

(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)

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	807,100	7,594.31	6,129,367,601	6,999.00	5,648,892,900	3.13
日本	株式	ソニー	電気機器	453,100	6,942.72	3,145,746,432	9,704.00	4,396,882,400	2.44
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	563,200	4,251.00	2,394,163,200	7,272.00	4,095,590,400	2.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	65,500	37,580.46	2,461,520,130	53,290.00	3,490,495,000	1.93
日本	株式	任天堂	その他製品	44,400	42,821.93	1,901,293,692	59,260.00	2,631,144,000	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	948,900	2,752.00	2,611,372,800	2,465.00	2,339,038,500	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	174,100	7,961.68	1,386,128,488	13,305.00	2,316,400,500	1.28
日本	株式	第一三共	医薬品	621,100	2,326.61	1,445,057,471	3,694.00	2,294,343,400	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	601,800	4,368.89	2,629,198,002	3,745.00	2,253,741,000	1.25
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,879,900	563.24	2,748,554,876	448.50	2,188,635,150	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	92,200	15,583.12	1,436,763,664	23,665.00	2,181,913,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	495,300	3,890.72	1,927,073,616	4,400.00	2,179,320,000	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	121,600	11,757.25	1,429,681,600	17,135.00	2,083,616,000	1.15
日本	株式	HOYA	精密機器	143,600	9,943.75	1,427,922,500	13,910.00	1,997,476,000	1.11
日本	株式	村田製作所	電気機器	212,500	6,407.05	1,361,498,125	9,129.00	1,939,912,500	1.07
日本	株式	ファナック	電気機器	68,000	20,628.11	1,402,711,480	25,365.00	1,724,820,000	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	569,400	3,032.67	1,726,802,298	2,871.50	1,635,032,100	0.91

日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	45,900	22,457.36	1,030,792,824	35,470.00	1,628,073,000	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	517,300	3,132.08	1,620,224,984	2,982.50	1,542,847,250	0.85
日本	株式	S M C	機械	22,700	49,332.58	1,119,849,566	66,320.00	1,505,464,000	0.83
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	493,200	3,875.89	1,911,588,948	3,032.00	1,495,382,400	0.83
日本	株式	エムスリー	サービス業	152,400	3,094.30	471,571,320	9,622.00	1,466,392,800	0.81
日本	株式	日立製作所	電気機器	347,700	4,175.44	1,451,800,488	3,966.00	1,378,978,200	0.76
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	498,400	2,410.40	1,201,343,360	2,758.50	1,374,836,400	0.76
日本	株式	花王	化学	173,200	8,612.02	1,491,601,864	7,808.00	1,352,345,600	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	252,200	5,862.33	1,478,479,626	5,190.00	1,308,918,000	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	73,500	14,967.98	1,100,146,530	17,765.00	1,305,727,500	0.72
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	969,100	1,644.70	1,593,878,770	1,327.50	1,286,480,250	0.71
日本	株式	中外製薬	医薬品	226,200	3,356.97	759,346,614	5,044.00	1,140,952,800	0.63
日本	株式	三菱商事	卸売業	467,200	2,844.26	1,328,838,272	2,433.00	1,136,697,600	0.63

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.31
		食料品	3.46
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20
		化学	7.42
		医薬品	5.94
		石油・石炭製品	0.35
		ゴム製品	0.53
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.59
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.60
		機械	5.62
		電気機器	16.57
		輸送用機器	6.85
		精密機器	2.74
		その他製品	2.64
		電気・ガス業	1.29
陸運業	3.42		
海運業	0.17		
空運業	0.34		

	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	9.19
	卸売業	4.35
	小売業	4.71
	銀行業	4.45
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.89
	その他金融業	1.09
	不動産業	1.99
	サービス業	5.96
合計		97.71

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）

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	924,000	7,279.55	6,726,305,731	12,112.53	11,191,982,432	4.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	384,036	16,343.07	6,276,329,598	22,360.24	8,587,138,934	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	22,603	202,495.48	4,577,005,555	331,963.87	7,503,379,412	2.95
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	128,326	21,286.57	2,731,620,804	28,861.68	3,703,704,063	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,154	136,895.61	2,211,411,797	186,294.50	3,009,401,500	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,021	137,221.30	2,198,422,503	185,653.50	2,974,354,848	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	39,514	11,130.65	439,816,542	60,854.60	2,404,608,917	0.95
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,794	14,320.39	2,016,225,347	14,960.15	2,106,300,767	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	162,889	13,080.20	2,130,622,142	12,593.54	2,051,350,082	0.81
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	90,186	19,149.78	1,727,042,260	21,920.79	1,976,948,367	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	131,920	12,669.88	1,671,411,437	14,400.19	1,899,673,447	0.75
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	159,099	11,901.31	1,893,487,741	11,761.43	1,871,231,911	0.74
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	32,893	26,870.60	883,854,734	55,108.45	1,812,682,262	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	74,186	22,201.93	1,647,072,501	24,055.72	1,784,598,349	0.70

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	50,511	29,227.31	1,476,300,925	35,108.58	1,773,369,818	0.70
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	47,811	30,298.86	1,448,618,884	35,225.98	1,684,189,440	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	57,538	23,231.32	1,336,684,106	28,672.60	1,649,764,122	0.65
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	96,203	15,028.93	1,445,828,918	15,285.33	1,470,495,150	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	220,886	6,165.19	1,361,805,534	6,293.65	1,390,180,543	0.55
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	59,793	12,117.53	724,543,586	21,961.30	1,313,132,435	0.52
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	244,057	4,512.18	1,101,229,638	5,376.30	1,312,125,480	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	37,419	35,480.75	1,327,654,412	34,778.42	1,301,373,885	0.51
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	25,816	33,964.70	876,832,734	49,558.64	1,279,406,023	0.50
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	418,401	3,272.62	1,369,270,280	3,011.77	1,260,128,040	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM, INC.	ソフトウェア・サービス	48,187	18,315.64	882,576,100	25,726.28	1,239,672,288	0.49
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	23,571	35,421.53	834,920,955	51,047.39	1,203,238,039	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	218,612	5,418.20	1,184,484,018	5,475.00	1,196,901,356	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品 小売り	75,945	12,523.24	951,077,521	15,749.72	1,196,112,789	0.47
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	381,917	3,735.45	1,426,631,870	3,015.92	1,151,833,677	0.45
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	297,670	3,700.98	1,101,673,581	3,867.82	1,151,335,378	0.45

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.05
		素材	4.37
		資本財	6.53
		商業・専門サービス	1.15
		運輸	2.02
		自動車・自動車部品	1.86
		耐久消費財・アパレル	1.97
		消費者サービス	1.57
		メディア・娯楽	6.88

	小売	5.93
	食品・生活必需品小売り	1.50
	食品・飲料・タバコ	4.17
	家庭用品・パーソナル用品	2.05
	ヘルスケア機器・サービス	5.20
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
	銀行	5.67
	各種金融	4.33
	保険	3.14
	不動産	0.49
	ソフトウェア・サービス	11.85
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.85
	電気通信サービス	1.95
	公益事業	3.32
	半導体・半導体製造装置	4.12
新株予約権証券		0.00
投資証券		2.30
合計		99.08

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR	小売	19,221	22,471.80	431,930,527	28,723.50	552,094,532	4.99
ケイマン 諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・ 娯楽	58,600	5,040.41	295,368,312	7,812.20	457,794,920	4.14
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半 導体製造装 置	252,000	1,190.51	300,009,623	1,779.96	448,549,920	4.06
香港	投資信託受 益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		463,200	650.42	301,276,119	803.78	372,311,081	3.37
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	48,873	4,856.06	237,330,590	6,424.43	313,981,656	2.84
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		60,624	4,100.53	248,591,034	3,783.67	229,381,440	2.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		61,356	2,989.95	183,451,630	3,251.75	199,514,803	1.80
ケイマン 諸島	株式	MEITUAN-B	小売	36,500	2,049.64	74,812,166	4,180.80	152,599,200	1.38
南アフリ カ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	4,471	15,908.71	71,127,859	21,579.23	96,480,738	0.87
ケイマン 諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	8,747	4,712.13	41,217,040	9,288.80	81,249,176	0.73
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	983,000	82.30	80,907,611	81.74	80,350,420	0.73
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	29,286	2,286.08	66,950,216	2,721.01	79,687,733	0.72

中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	61,000	1,158.49	70,667,943	1,228.78	74,955,580	0.68
ケイマン諸島	株式	NIO INC-ADR	自動車・自動車部品	10,908	826.70	9,017,694	5,610.06	61,194,535	0.55
ブラジル	株式	VALE SA	素材	37,800	1,014.22	38,337,557	1,526.44	57,699,523	0.52
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		30,028	1,811.71	54,402,287	1,854.43	55,685,019	0.50
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	34,841	1,045.16	36,414,767	1,551.00	54,038,391	0.49
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	16,825	3,080.88	51,835,892	3,181.31	53,525,583	0.48
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	5,633	7,645.12	43,065,014	9,306.96	52,426,106	0.47
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,414	4,008.48	33,727,424	5,821.56	48,982,606	0.44
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF		35,000	1,296.78	45,387,370	1,197.57	41,914,992	0.38
ケイマン諸島	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	2,788	5,698.75	15,888,137	14,965.35	41,723,408	0.38
ケイマン諸島	株式	NETEASE.COM INC -ADR	メディア・娯楽	4,210	7,596.54	31,981,461	9,697.09	40,824,760	0.37
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	621,000	72.18	44,825,559	65.25	40,525,218	0.37
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,788	12,416.57	34,617,421	14,484.34	40,382,351	0.37
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	63,000	782.95	49,325,918	637.17	40,141,710	0.36
台湾	株式	MEDIATEK INCORPORATION	半導体・半導体製造装置	15,000	1,587.50	23,812,542	2,639.00	39,585,000	0.36
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	127,800	311.32	39,786,994	300.66	38,424,859	0.35
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	107,600	166.92	17,961,350	349.07	37,559,932	0.34
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	474	36,766.46	17,427,303	76,302.00	36,167,148	0.33

□ 種別・業種別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.47
		素材	3.93
		資本財	1.51
		商業・専門サービス	0.17
		運輸	0.87
		自動車・自動車部品	2.22
		耐久消費財・アパレル	0.86
		消費者サービス	1.13
		メディア・娯楽	6.17
		小売	9.38

	食品・生活必需品小売り	0.76
	食品・飲料・タバコ	1.74
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.73
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.78
	銀行	6.78
	各種金融	1.17
	保険	1.99
	不動産	1.32
	ソフトウェア・サービス	1.37
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.72
	電気通信サービス	1.81
	公益事業	1.19
	半導体・半導体製造装置	5.68
投資信託受益証券		3.37
投資証券		4.92
合計		69.77

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	730	632,943.45	462,048,719	577,000	421,210,000	7.11
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	649	584,067.51	379,059,820	542,000	351,758,000	5.93
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	981	350,956.62	344,288,451	327,500	321,277,500	5.42
日本	投資証券	GLP投資法人	1,865	172,613.89	321,924,910	157,900	294,483,500	4.97
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	2,099	142,660.53	299,444,472	136,000	285,464,000	4.82
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	926	283,069.12	262,122,007	251,300	232,703,800	3.93
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	1,220	150,740.33	183,903,211	166,500	203,130,000	3.43
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,294	156,778.96	202,871,987	156,000	201,864,000	3.41
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	617	316,280.85	195,145,287	301,500	186,025,500	3.14
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,388	116,166.37	161,238,924	118,000	163,784,000	2.76
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	918	187,208.34	171,857,262	176,000	161,568,000	2.73
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	1,911	73,519.52	140,495,815	74,600	142,560,600	2.41
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	201	606,513.41	121,909,197	662,000	133,062,000	2.24
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	325	405,305.07	131,724,148	390,000	126,750,000	2.14
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	424	285,985.76	121,257,965	295,000	125,080,000	2.11
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	216	668,097.99	144,309,166	577,000	124,632,000	2.10
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	404	313,181.63	126,525,380	306,500	123,826,000	2.09
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	724	182,533	132,153,897	156,200	113,088,800	1.91

日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	226	538,452.26	121,690,211	496,000	112,096,000	1.89
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,091	46,178.05	96,558,315	51,400	107,477,400	1.81
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	762	135,334.07	103,124,562	137,900	105,079,800	1.77
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	2,715	27,106.95	73,595,371	30,950	84,029,250	1.42
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	139	598,898.14	83,246,842	599,000	83,261,000	1.40
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	283	327,078.93	92,563,340	289,300	81,871,900	1.38
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	215	353,297.8	75,959,029	375,000	80,625,000	1.36
日本	投資証券	イオンリート投資法人	659	113,319.33	74,677,445	122,100	80,463,900	1.36
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	423	191,614.06	81,052,748	178,100	75,336,300	1.27
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	603	122,132.2	73,645,720	124,200	74,892,600	1.26
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	522	138,520.32	72,307,608	141,800	74,019,600	1.25
日本	投資証券	日本リート投資法人	211	361,005.51	76,172,164	350,500	73,955,500	1.25

ロ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.36
合計	98.36

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	48,951	10,608.26	519,285,390	10,451.33	511,603,251	6.06
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5,845	80,278.84	469,229,878	72,777.02	425,381,698	5.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,909	15,848.48	283,830,511	14,204.87	254,395,191	3.01
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	10,121	21,667.16	219,293,330	22,858.91	231,355,096	2.74
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	21,330	7,171.95	152,977,877	8,887.78	189,576,550	2.25
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	27,502	5,967.59	164,120,748	6,705.06	184,402,577	2.18
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,479	16,229.79	153,842,247	17,440.01	165,313,896	1.96
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	109,939	1,409.65	154,975,583	1,431.29	157,355,152	1.86
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	22,780	6,499.64	148,061,888	6,403.77	145,878,099	1.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	22,351	5,808.48	129,825,558	6,150.28	137,465,087	1.63
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	7,777	17,703.84	137,682,764	16,844.72	131,001,423	1.55
香港	投資証券	LINK REIT	137,300	843.01	115,745,790	917.90	126,027,670	1.49
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	25,284	4,456.66	112,682,331	4,976.33	125,821,553	1.49
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,227	22,350.89	94,477,232	25,973.53	109,790,149	1.30
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	35,186	2,907.82	102,314,698	3,104.23	109,225,549	1.29
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	36,362	3,024.86	109,990,106	2,987.87	108,645,162	1.29
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	9,401	9,050.89	85,087,481	10,641.45	100,040,297	1.19

アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,494	11,076.85	94,086,846	11,427.90	97,068,583	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	7,499	12,043.21	90,312,054	12,882.36	96,604,818	1.14
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	23,879	3,975.87	94,939,807	3,988.33	95,237,502	1.13
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	75,977	1,332.85	101,266,021	1,248.88	94,886,892	1.12
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	35,155	2,392.21	84,098,172	2,667.89	93,789,856	1.11
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	6,417	15,334.51	98,401,606	14,400.19	92,406,038	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	11,394	7,408.39	84,411,263	7,260.87	82,730,377	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	19,575	3,589.42	70,262,969	4,074.56	79,759,626	0.94
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	331,601	155.35	51,516,935	221.50	73,449,887	0.87
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	46,412	1,151.96	53,464,783	1,518.87	70,493,878	0.84
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	8,932	5,057.43	45,172,989	7,855.84	70,168,370	0.83
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	33,664	1,953.13	65,750,235	2,033.12	68,443,197	0.81
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,613	9,274.54	61,332,590	10,154.20	67,149,781	0.80

ロ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.27
合計	99.27

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)

2020年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	103.02	2,091,366,900	102.38	2,078,314,000	0.800	2023/6/20	1.53
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,890,000,000	101.01	1,909,157,800	100.98	1,908,692,100	0.100	2025/9/20	1.41
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,850,000,000	101.00	1,868,540,200	101.00	1,868,611,000	0.100	2025/6/20	1.38
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,760,000,000	100.67	1,771,911,600	100.73	1,772,900,800	0.100	2030/9/20	1.31
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	104.85	1,525,611,150	103.76	1,509,780,750	1.700	2022/12/20	1.11
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,325,000,000	101.05	1,338,912,500	101.04	1,338,806,500	0.100	2029/12/20	0.99
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	103.23	1,326,621,150	102.63	1,318,795,500	0.800	2023/9/20	0.97
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	103.34	1,255,581,000	102.61	1,246,796,550	1.000	2023/3/20	0.92
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	108.65	1,108,301,400	107.40	1,095,531,000	2.100	2024/3/20	0.81
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	1,080,000,000	100.92	1,089,936,000	100.97	1,090,540,800	0.100	2030/3/20	0.80
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	106.89	1,095,663,500	105.72	1,083,681,250	1.900	2023/9/20	0.80
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	107.39	1,095,439,200	106.23	1,083,607,200	1.900	2023/12/20	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	101.36	1,013,620,000	100.70	1,007,050,000	1.200	2021/6/30	0.74
日本	国債証券	第418回利付国債(2年)	1,000,000,000	100.45	1,004,564,900	100.47	1,004,710,000	0.100	2022/11/1	0.74
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	965,000,000	101.36	978,192,200	101.24	977,052,850	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	742,000,000	130.27	966,670,180	129.25	959,049,840	2.400	2034/3/20	0.71
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	938,000,000	101.52	952,295,120	101.21	949,415,460	0.100	2026/12/20	0.70
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	111.98	951,838,500	110.66	940,635,500	2.000	2025/12/20	0.69
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	890,000,000	101.43	902,727,000	101.11	899,932,400	0.100	2026/6/20	0.66
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	890,000,000	101.37	902,255,300	101.06	899,478,500	0.100	2026/3/20	0.66
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	770,000,000	114.27	879,879,000	114.13	878,801,000	1.200	2035/9/20	0.65
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	770,000,000	114.21	879,440,000	113.90	877,037,700	1.200	2034/12/20	0.65
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	850,000,000	101.16	859,919,500	101.14	859,749,500	0.100	2029/9/20	0.63
日本	国債証券	第70回利付国債(20年)	780,000,000	110.43	861,416,400	109.02	850,387,200	2.400	2024/6/20	0.63
日本	国債証券	第88回利付国債(20年)	742,000,000	114.86	852,283,460	113.39	841,398,320	2.300	2026/6/20	0.62
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	815,000,000	102.91	838,781,700	102.43	834,845,250	0.600	2024/3/20	0.62
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	734,000,000	114.73	842,176,920	113.39	832,319,300	2.100	2026/12/20	0.61
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	805,000,000	102.61	826,074,900	102.29	823,442,550	0.400	2025/3/20	0.61
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	811,000,000	101.49	823,095,500	101.16	820,464,370	0.100	2026/9/20	0.60
日本	国債証券	第72回利付国債(20年)	753,000,000	109.76	826,492,800	108.50	817,012,530	2.100	2024/9/20	0.60

□ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.49
地方債証券	6.48
特殊債券	11.04
社債券	3.51
合計	99.51

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)

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	11,800,000	10,397.11	1,226,859,736	10,946.59	1,291,698,465	1.750	2024/6/30	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	8,000,000	10,382.66	830,613,017	10,372.76	829,821,375	0.125	2023/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	7,700,000	10,429.20	803,048,818	10,406.85	801,327,919	0.250	2023/6/15	0.49
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	4,900,000	14,646.94	717,700,461	15,849.37	776,619,143	3.500	2030/3/1	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,500,000	10,396.47	779,735,487	10,212.87	765,965,553	0.625	2030/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	6,300,000	11,034.25	695,158,024	11,976.56	754,523,851	2.625	2029/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	11,886.05	641,846,964	13,870.12	748,986,841	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	10,558.63	686,311,140	11,043.99	717,859,612	2.125	2024/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,633.30	669,898,144	11,187.65	704,822,226	2.250	2024/11/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000	22,401.95	649,656,765	23,693.76	687,119,275	4.500	2041/4/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,050,000	10,269.68	621,316,177	11,056.16	668,898,199	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,500,000	11,220.12	617,106,600	12,110.48	666,076,939	2.875	2028/8/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,510.77	675,538,875	13,087.38	654,369,399	3.000	2022/4/25	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.25	4,900,000	12,895.53	631,881,246	13,084.52	641,141,835	0.250	2026/11/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,724.20	611,279,835	11,199.01	638,343,988	2.500	2024/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,679.56	598,055,771	11,200.64	627,235,875	2.375	2024/8/15	0.38
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	6,400,000	9,777.38	625,752,450	9,767.57	625,124,480	4.750	2027/4/21	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,200,000	10,821.18	562,701,485	11,786.64	612,905,548	2.375	2029/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	5,450,000	10,141.74	552,724,928	11,160.87	608,267,430	1.625	2029/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	5,000,000	11,489.68	574,484,105	12,078.02	603,901,210	2.875	2028/5/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000	13,130.09	590,854,130	13,222.71	595,022,103	0.500	2026/5/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	4,500,000	12,513.59	563,111,793	12,918.60	581,337,194	0.000	2029/11/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	11,090.25	532,332,360	11,949.78	573,589,678	2.750	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	10,813.48	551,487,892	11,230.67	572,764,240	2.750	2024/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.5	3,850,000	14,474.03	557,250,261	14,876.59	572,748,880	1.500	2031/5/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	14,650.75	586,030,052	14,259.42	570,376,829	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	10,781.02	528,270,101	11,602.40	568,517,736	2.375	2027/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	10,503.27	525,163,950	11,302.90	565,145,367	2.000	2026/11/15	0.35
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 2.5	2,600,000	20,123.62	523,214,296	21,543.48	560,130,653	2.500	2046/8/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000	15,635.93	547,257,696	15,935.68	557,749,149	2.500	2030/5/25	0.34

□ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
----	----------

国債証券	98.85
合計	98.85

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2020年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	1,500,000	11,383.25	170,748,897	11,173.85	167,607,848	8.000	2021/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	1,580,000	10,279.58	162,417,371	10,188.52	160,978,691	0.625	2030/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,460,000	10,782.71	157,427,601	10,754.23	157,011,879	2.000	2022/10/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,300,000	10,725.83	139,435,801	10,684.43	138,897,683	1.625	2022/11/15	0.52
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	850,000	15,325.48	130,266,594	15,272.49	129,816,214	3.500	2026/4/25	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,200,000	10,746.12	128,953,462	10,710.40	128,524,916	1.500	2023/3/31	0.49
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	970,000	13,142.62	127,483,442	13,087.38	126,947,663	3.000	2022/4/25	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	1,200,000	10,369.88	124,438,610	10,367.08	124,405,028	0.125	2023/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,100,000	11,088.63	121,974,976	11,026.13	121,287,517	2.125	2024/2/29	0.46
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	760,000	15,358.40	116,723,863	15,348.36	116,647,594	2.750	2027/10/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,000,000	11,651.91	116,519,128	11,550.45	115,504,578	2.875	2025/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,150,000	9,915.53	114,028,677	9,890.65	113,742,503	1.375	2050/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	990,000	11,156.69	110,451,312	11,048.86	109,383,752	1.500	2030/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	10,854.88	108,548,817	10,806.18	108,061,833	2.000	2023/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	1,080,000	9,890.22	106,814,420	9,975.06	107,730,683	1.125	2040/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	10,806.18	108,061,833	10,762.35	107,623,547	1.625	2023/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,000,000	10,792.38	107,923,854	10,750.99	107,509,917	1.625	2023/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	10,787.51	107,875,156	10,745.31	107,453,103	1.750	2023/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	10,746.12	107,461,218	10,698.23	106,982,351	1.875	2022/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,000,000	10,687.68	106,876,837	10,638.98	106,389,853	1.875	2022/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,000,000	10,656.84	106,568,414	10,623.56	106,235,642	1.375	2022/10/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	10,623.56	106,235,642	10,574.86	105,748,658	2.000	2021/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	860,000	12,207.61	104,985,512	12,110.48	104,150,210	2.875	2028/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	1,000,000	10,383.59	103,835,977	10,380.07	103,800,720	0.125	2022/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	900,000	11,624.31	104,618,853	11,526.92	103,742,281	2.500	2026/2/28	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	430,000	23,251.66	99,982,165	23,693.76	101,883,202	4.500	2041/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	950,000	10,744.49	102,072,736	10,707.97	101,725,760	1.375	2023/6/30	0.38

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	900,000	11,296.41	101,667,727	11,220.12	100,981,080	2.875	2023/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	900,000	11,266.38	101,397,451	11,187.65	100,688,889	2.250	2024/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	900,000	11,246.90	101,222,137	11,167.36	100,506,270	2.750	2023/11/15	0.38

□ 種類別の投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.64
合計	98.64

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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）

2020年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	206	日本円	3,599,468,600	3,616,330,000	2.00

(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。

外国株式インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMINI 2012	買建	91	米ドル	16,112,110.5	1,673,887,159	16,546,075	1,718,971,731	0.67
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 2012	買建	87	ユーロ	2,908,114	361,711,219	3,072,840	382,199,839	0.15
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 2012	買建	7	オーストラリアドル	1,103,006.5	84,832,229	1,155,525	88,871,427	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 2012	買建	12	英ポンド	735,764	101,940,102	763,380	105,766,299	0.04

(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。

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,430,000.00	253,060,200	252,428,400	0.09
	カナダドル	買建	150,000.00	11,997,000	11,991,000	0.00
	スイスフラン	買建	70,000.00	8,043,490	8,047,900	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	440,000.00	5,370,200	5,376,800	0.00
	デンマーククローネ	買建	210,000.00	3,499,440	3,509,100	0.00
	香港ドル	買建	250,000.00	3,359,000	3,347,500	0.00
	シンガポールドル	買建	20,000.00	1,555,960	1,553,600	0.00
	イスラエルシェケル	買建	30,000.00	941,040	939,900	0.00
	ノルウェークローネ	売建	50,000.00	586,500	587,500	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 2012	買建	524	米ドル	28,891,049	3,001,491,081	32,357,000	3,361,568,730	30.40

(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。

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	24,592,695.57	2,599,610,528	2,553,705,508	23.10
	米ドル	売建	15,398,908.54	1,605,000,000	1,599,022,659	14.46
	フィリピンペソ	売建	4,874.31	10,528	10,528	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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数 先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	30	日本円	51,117,600	50,640,000	0.85

(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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	57,758.95	6,000,000	5,999,999	0.07
	ユーロ	買建	8,040.85	1,000,000	1,000,120	0.01
	英ポンド	買建	7,218.39	1,000,000	1,000,035	0.01
	オーストラリアドル	買建	13,003.56	1,000,000	999,973	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	108,650,000.00	11,362,668,288	11,284,389,000	42.59
	カナダドル	売建	6,590,000.00	517,065,369	526,738,700	1.98
	メキシコペソ	売建	41,350,000.00	202,698,622	214,193,000	0.80
	ユーロ	売建	88,000,000.00	10,725,212,896	10,945,440,000	41.31
	英ポンド	売建	12,630,000.00	1,708,794,606	1,749,633,900	6.60
	スウェーデンクローナ	売建	7,000,000.00	82,289,900	85,540,000	0.32
	ノルウェークローネ	売建	5,020,000.00	54,930,346	58,985,000	0.22
	デンマーククローネ	売建	9,000,000.00	147,359,555	150,390,000	0.56
	ポーランドズロチ	売建	6,020,000.00	158,973,471	166,754,000	0.62
	オーストラリアドル	売建	9,260,000.00	680,060,377	712,001,400	2.68
	シンガポールドル	売建	3,160,000.00	241,862,231	245,437,200	0.92
	イスラエルシェケル	売建	3,640,000.00	111,702,332	114,041,200	0.43

(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。

参考情報

基準日:2020年11月30日

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

基準価額・純資産の推移

■安定型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4月	0円
2016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。

■安定成長型

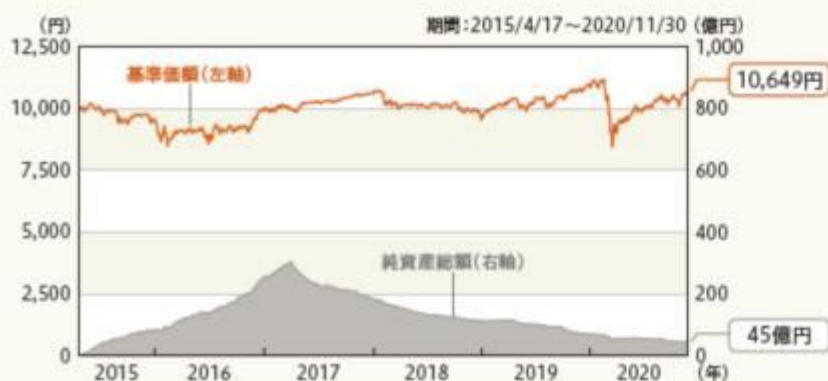


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4月	0円
2016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。

■成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
2017年4月	0円
2016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。

主要な資産の状況

■安定型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	88.98
投資証券	アメリカ	9.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.90
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	39.38
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	18.96
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	10.11
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)	9.22
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	5.50
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	5.13
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	5.09
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	3.50
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	0.61
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	0.48

■安定成長型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	83.14
投資証券	アメリカ	15.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.83
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	23.54
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	14.20
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)	13.94
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	11.76
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	10.05
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	9.49
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	7.81
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	5.44
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	0.99
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	0.86

■成長型

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	78.93
投資証券	アメリカ	18.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.11
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	17.01
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	16.86
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	13.76
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	12.18
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	12.10
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.54
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	6.83
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	6.67
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1.61
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.24

*比率は、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。

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.53
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	0.100	2025/09/20	1.41
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	0.100	2025/06/20	1.38
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	0.100	2030/09/20	1.31
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	1.11
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	0.100	2029/12/20	0.99
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.97
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1.000	2023/03/20	0.92
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	2.100	2024/03/20	0.81
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	0.100	2030/03/20	0.80

■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2024/06/30	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	0.125	2023/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	0.250	2023/06/15	0.49
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	3.500	2030/03/01	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2029/02/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2048/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/03/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.42

■ ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 8	8.000	2021/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/08/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2022/10/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2022/11/15	0.52
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	3.500	2026/04/25	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2023/03/31	0.49
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	0.125	2023/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2024/02/29	0.46
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	2.750	2027/10/25	0.44

※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。

■バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

主要投資銘柄(上位10銘柄)(2020年10月30日現在)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) 4.817% 03/14/2049	4.817	2049/03/14	0.75
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) 5.103% 04/23/2048	5.103	2048/04/23	0.72
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION 5.25% 06/23/2047	5.250	2047/06/23	0.72
サウジアラビア	国債証券	SAUDI ARABIA (KINGDOM OF) 4.5% 10/26/2046	4.500	2046/10/26	0.68
アルゼンチン	国債証券	ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT 0.125% 07/09/2035	0.125	2035/07/09	0.59
メキシコ	政府機関債	Petroleos Mexicanos 7.69% 01/23/2050	7.690	2050/01/23	0.58
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) 4.4% 04/16/2050	4.400	2050/04/16	0.56
アルゼンチン	国債証券	ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT 0.125% 07/09/2030	0.125	2030/07/09	0.53
サウジアラビア	国債証券	SAUDI ARABIA (KINGDOM OF) 4.625% 10/04/2047	4.625	2047/10/04	0.49
サウジアラビア	政府機関債	KSA SUKUK Ltd. 3.628% 04/20/2027	3.628	2027/04/20	0.49

*国・地域は発行国基準です。

*比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

*[バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF]の公開情報を基に委託会社作成

■iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

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(%)
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25% 06/23/47	5.250	2047/06/23	0.89
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1% 06/18/50	5.100	2050/06/18	0.82
クウェート	国債証券	KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) MTN RegS 3.5% 03/20/27	3.500	2027/03/20	0.77
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 5.103% 04/23/48	5.103	2048/04/23	0.67
エクアドル	国債証券	EQUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 144A 0.5% 07/31/35	0.500	2035/07/31	0.64
カタール	国債証券	QATAR (STATE OF) RegS 4.817% 03/14/49	4.817	2049/03/14	0.63
コロンビア	国債証券	COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5% 06/15/45	5.000	2045/06/15	0.59
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.625% 11/18/50	5.625	2050/11/18	0.58
マレーシア	政府機関債	PETRONAS CAPITAL LTD MTN RegS 4.55% 04/21/50	4.550	2050/04/21	0.56
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 4.975% 04/20/55	4.975	2055/04/20	0.54

*国・地域は発行国基準です。

*比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

*[iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF]の公開情報を基に委託会社作成

■SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF

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(%)
フランス	社債券	ALTICE FRANCE SA 7.375% 05/01/2026	7.375	2026/05/01	0.56
アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC 6.25% 03/15/2026	6.250	2026/03/15	0.47
パナマ	社債券	CARNIVAL CORP 11.5% 04/01/2023	11.500	2023/04/01	0.46
アメリカ	社債券	CENTENE CORP 4.625% 12/15/2029	4.625	2029/12/15	0.38
アメリカ	社債券	CAESARS ENTERTAIN INC 6.25% 07/01/2025	6.250	2025/07/01	0.36
アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125% 05/01/2027	5.125	2027/05/01	0.31
ルクセンブルグ	社債券	ALTICE FINANCING SA 7.5% 05/15/2026	7.500	2026/05/15	0.30
アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 4.75% 03/01/2030	4.750	2030/03/01	0.29
アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 4.25% 02/01/2031	4.250	2031/02/01	0.29
リベリア	社債券	ROYAL CARIBBEAN CRUISES 11.5% 06/01/2025	11.500	2025/06/01	0.29

*国・地域は発行国基準です。

*比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

*[SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF]の公開情報を基に委託会社作成

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.13
日本	株式	ソニー	電気機器	2.44
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.93
日本	株式	任天堂	その他製品	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	1.28
日本	株式	第一三共	医薬品	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.25
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.21

※上記のほか、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)において、株価指数先物取引の買建て(2.00%)を行っています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.95
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	0.95
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.81
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	0.78

※上記のほか、外国株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(0.89%)を行っています。

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	4.99
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	4.14
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	4.06
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	—	3.37
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.84
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	2.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	1.80
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-B	小売	1.38
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	0.87
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-ADR	小売	0.73

※上記のほか、エマージング株式インデックス・マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(30.40%)を行っています。

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.11
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.93
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5.42
日本	投資証券	GLP投資法人	4.97
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.82
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.93
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3.43
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.41
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.14
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2.76

※上記のほか、Jリート・インデックス・マザーファンドにおいて、リート指数先物取引の買建て(0.85%)を行っています。

■外国リート・インデックス・マザーファンド

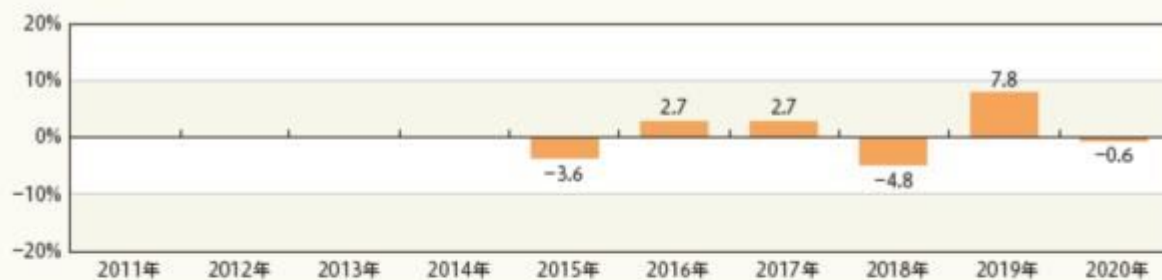
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.06
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.01
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.74
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.25
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.18
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.96
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.86
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	1.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	1.63

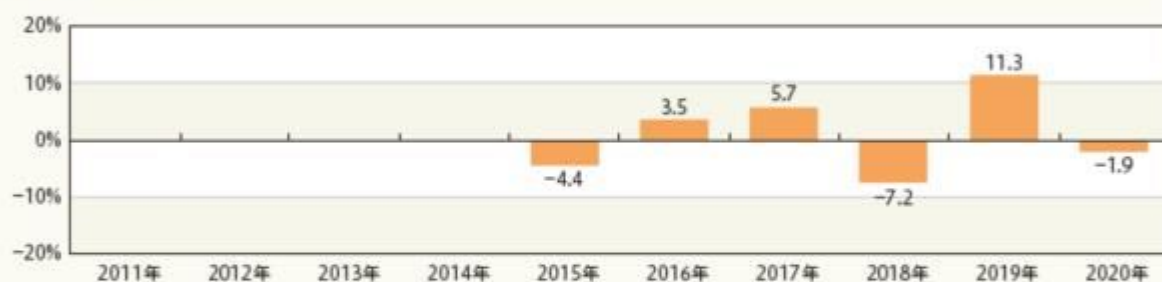
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

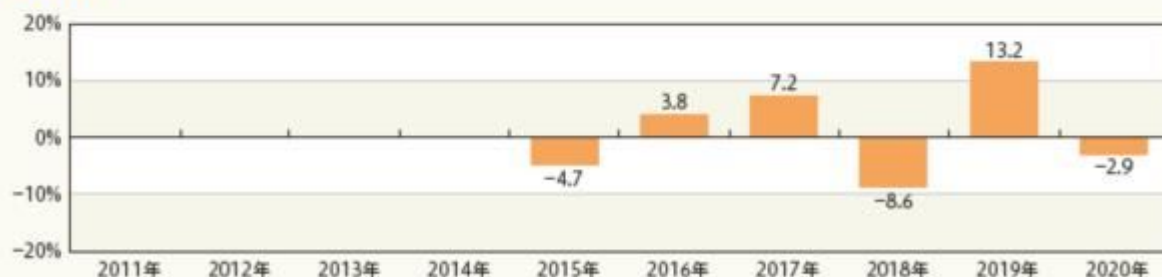
■安定型



■安定成長型



■成長型



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・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利回りとは異なります。

※2015年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2015年4月17日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2020年のファンドの収益率は、年初から2020年11月30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。

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

ていただく場合があります。

- (八) 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。

- (二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

原則として、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）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、ニューヨークの取引所または銀行の休業日のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付

けは行いません。

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産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、「安定型」は「らっぴ安定」、「安定成長型」は「らっぴ安成」、「成長型」は「らっぴ成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2015年4月17日から2028年4月26日まで、もしくは下記「(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。

なお、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議の上、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知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

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

- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任しません。
- 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て)に支払われます。

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

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

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

- (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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

(ヘ)上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっては、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、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。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）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5期(2019年4月27日から2020年4月27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】

【アセットアロケーション・ファンド(安定型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,704,937	11,886,497
金銭信託	423,210,355	162,706,738
コール・ローン	136,721,241	166,803,673
投資信託受益証券	2,822,292,951	608,173,950
親投資信託受益証券	18,406,344,760	12,859,219,945
派生商品評価勘定	-	12,005,018
未収入金	418,987,598	-
流動資産合計	22,210,261,842	13,820,795,821
資産合計		
22,210,261,842		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,550,708	-
未払解約金	336,856,092	20,633,630
未払受託者報酬	3,725,103	2,571,734
未払委託者報酬	111,752,796	77,151,935
未払利息	400	481
その他未払費用	770,041	542,077
流動負債合計	456,655,140	100,899,857
負債合計		
456,655,140		
純資産の部		
元本等		
元本	21,690,164,448	13,933,783,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	63,442,254	213,887,459
元本等合計	21,753,606,702	13,719,895,964
純資産合計		
21,753,606,702		
負債純資産合計		
22,210,261,842		

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第4期		第5期	
	自 至	2018年 4月27日 2019年 4月26日	自 至	2019年 4月27日 2020年 4月27日
営業収益				
受取配当金		183,783,719		101,499,153
受取利息		44,185		38,295
有価証券売買等損益		637,389,525		21,000,841
為替差損益		88,810,899		54,759,222
その他収益		-		624,048
営業収益合計		732,406,530		26,401,433
営業費用				
支払利息		302,622		253,248
受託者報酬		8,162,832		5,739,972
委託者報酬		244,884,370		172,199,115
その他費用		2,538,537		1,746,437
営業費用合計		255,888,361		179,938,772
営業利益又は営業損失（ ）		476,518,169		153,537,339
経常利益又は経常損失（ ）		476,518,169		153,537,339
当期純利益又は当期純損失（ ）		476,518,169		153,537,339
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		13,486,231		105,299,200
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		579,777,793		63,442,254
剰余金増加額又は欠損金減少額		195,312,182		5,558,083
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		195,312,182		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		5,558,083
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,124,073		24,051,257
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		24,051,257
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,124,073		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		63,442,254		213,887,459

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第5期	
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2019年 4月27日から2020年 4月27日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第4期	第5期
	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	21,690,164,448口	13,933,783,423口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 213,887,459円

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)	1.0029円 (10,029円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	0.9846円 (9,846円)
----------------	--------------------------------	----------------------	--------------------------------	---------------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第4期	第5期
	自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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（376,547,903円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（257,117,651円）、および分配準備積立金（759,343,703円）より、分配対象収益は1,393,009,257円（1万口当たり642.22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（168,670,654円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（176,843,727円）、および分配準備積立金（718,584,081円）より、分配対象収益は1,064,098,462円（1万口当たり763.66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5期
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。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	第5期 (2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券、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4期（自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	19,328,079円
親投資信託受益証券	390,051,736円
合計	409,379,815円

第5期（自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	70,802,224円
親投資信託受益証券	8,979,358円
合計	61,822,866円

（デリバティブ取引に関する注記）

第4期（2019年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	92,901,265	-	92,619,700	281,565
	米ドル	92,901,265	-	92,619,700	281,565
	売建	2,388,885,687	-	2,392,154,830	3,269,143
	米ドル	2,388,885,687	-	2,392,154,830	3,269,143
	合計	2,481,786,952	-	2,484,774,530	3,550,708

第5期（2020年 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	549,882,850	-	550,061,840	178,990
	米ドル	549,882,850	-	550,061,840	178,990
	売建	988,040,588	-	976,214,560	11,826,028
	米ドル	988,040,588	-	976,214,560	11,826,028
	合計	1,537,923,438	-	1,526,276,400	12,005,018

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
期首元本額	31,323,831,015円	21,690,164,448円
期中追加設定元本額	913,665,451円	258,180,741円
期中一部解約元本額	10,547,332,018円	8,014,561,766円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	3,193	312,754.35	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	30,295	2,927,102.90	
		パンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	34,261	2,412,317.01	
		米ドル 小計	67,749	5,652,174.26 (608,173,950)	
投資信託受益証券合計				608,173,950 (608,173,950)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	348,878,578	817,527,171	
		外国株式インデックス・マザーファンド	243,195,509	810,740,868	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	3,835,598,494	5,849,671,263	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	71,914,897	132,150,814	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	3,623,380,687	4,668,363,677	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	152,382,989	298,228,747	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	37,376,988	61,761,734	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	198,129,473	220,775,671	
親投資信託受益証券合計			8,510,857,615	12,859,219,945	
				13,467,393,895	

合計	(608,173,950)
----	---------------

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	4.4%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	13,451,932	13,456,406
金銭信託	312,346,695	122,043,262
コール・ローン	100,905,914	125,116,295
投資信託受益証券	2,801,819,742	910,037,155
親投資信託受益証券	11,069,855,417	8,279,331,664
派生商品評価勘定	-	13,583,308
未収入金	198,000,000	-
流動資産合計	14,496,379,700	9,463,568,090
資産合計		
14,496,379,700		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,483,743	-
未払解約金	216,361,818	17,718,833
未払受託者報酬	2,455,249	1,782,376
未払委託者報酬	73,657,518	53,471,260
未払利息	295	360
その他未払費用	506,579	375,783
流動負債合計	296,465,202	73,348,612
負債合計		
296,465,202		
純資産の部		
元本等		
元本	13,848,253,794	9,718,712,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	351,660,704	328,493,306
元本等合計	14,199,914,498	9,390,219,478
純資産合計		
14,199,914,498		
負債純資産合計		
14,496,379,700		
9,463,568,090		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自 至	2018年 4月27日 2019年 4月26日	自 至	2019年 4月27日 2020年 4月27日
営業収益				
受取配当金		192,100,566		102,620,501
受取利息		47,622		36,253
有価証券売買等損益		393,041,873		448,832,069
為替差損益		92,815,972		58,900,152
営業収益合計		492,374,089		405,075,467
営業費用				
支払利息		208,452		178,152
受託者報酬		5,366,375		3,878,684
委託者報酬		160,991,334		116,360,492
その他費用		1,952,699		1,339,174
営業費用合計		168,518,860		121,756,502
営業利益又は営業損失（ ）		323,855,229		526,831,969
経常利益又は経常損失（ ）		323,855,229		526,831,969
当期純利益又は当期純損失（ ）		323,855,229		526,831,969
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,212,712		56,511,119
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		40,066,728		351,660,704
剰余金増加額又は欠損金減少額		50,359		21,625,368
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		50,359		21,625,368
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,524,324		118,436,290
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,524,324		118,436,290
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（ ）		351,660,704		328,493,306

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第5期	
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2019年 4月27日から2020年 4月27日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第4期	第5期
	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	13,848,253,794口	9,718,712,784口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 328,493,306円

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)	1.0254円 (10,254円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	0.9662円 (9,662円)
----------------	--------------------------------	----------------------	--------------------------------	---------------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第4期	第5期
	自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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（290,618,971円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（223,264,426円）、および分配準備積立金（687,649,621円）より、分配対象収益は1,201,533,018円（1万口当たり867.62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（153,774,162円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（187,589,695円）、および分配準備積立金（656,715,677円）より、分配対象収益は998,079,534円（1万口当たり1,026.95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5期
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。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	第5期 (2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券、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4期(自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	21,176,956円
親投資信託受益証券	246,069,243円
合計	267,246,199円

第5期(自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	101,670,996円
親投資信託受益証券	315,329,164円
合計	417,000,160円

(デリバティブ取引に関する注記)

第4期(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建	91,529,685	-	91,280,620	249,065
	米ドル	91,529,685	-	91,280,620	249,065
	売建	2,363,700,812	-	2,366,935,490	3,234,678
	米ドル	2,363,700,812	-	2,366,935,490	3,234,678
	合計	2,455,230,497	-	2,458,216,110	3,483,743

第5期(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	354,832,500	-	354,948,000	115,500
	米ドル	354,832,500	-	354,948,000	115,500
	売建	1,125,207,968	-	1,111,740,160	13,467,808
	米ドル	1,125,207,968	-	1,111,740,160	13,467,808
合計		1,480,040,468	-	1,466,688,160	13,583,308

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
期首元本額	19,984,561,437円	13,848,253,794円
期中追加設定元本額	758,923,595円	498,733,066円
期中一部解約元本額	6,895,231,238円	4,628,274,076円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	816	79,927.20	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	32,551	3,145,077.62	
		パンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	74,316	5,232,589.56	
		米ドル 小計	107,683	8,457,594.38 (910,037,155)	
投資信託受益証券合計				910,037,155 (910,037,155)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	402,912,826	944,145,625	
		外国株式インデックス・マザーファンド	245,763,764	819,302,660	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,261,229,504	3,448,601,116	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	92,768,309	170,471,044	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	1,332,579,445	1,716,895,356	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	310,073,497	606,844,840	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	37,514,775	61,989,414	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	458,657,103	511,081,609	
親投資信託受益証券合計			5,141,499,223	8,279,331,664	
				9,189,368,819	

合計	(910,037,155)
----	---------------

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	9.7%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

【アセットアロケーション・ファンド(成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	11,417,331	10,637,861
金銭信託	245,418,042	77,878,660
コール・ローン	79,284,117	79,839,634
投資信託受益証券	2,370,281,005	705,371,350
親投資信託受益証券	8,281,795,201	4,774,097,617
派生商品評価勘定	-	10,290,410
未収入金	155,000,000	-
流動資産合計	11,143,195,696	5,658,115,532
資産合計		
11,143,195,696		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,698,602	-
未払解約金	174,274,464	11,530,413
未払受託者報酬	1,848,267	1,102,304
未払委託者報酬	55,447,896	33,069,002
未払利息	232	230
その他未払費用	381,447	233,847
流動負債合計	234,650,908	45,935,796
負債合計		
234,650,908		
純資産の部		
元本等		
元本	10,527,852,026	5,918,683,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	380,692,762	306,503,321
元本等合計	10,908,544,788	5,612,179,736
純資産合計		
10,908,544,788		
負債純資産合計		
11,143,195,696		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日		自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	
営業収益				
受取配当金		178,083,696		81,848,714
受取利息		42,599		31,174
有価証券売買等損益		296,992,826		419,653,213
為替差損益		84,370,247		62,825,830
営業収益合計		390,748,874		400,599,155
営業費用				
支払利息		161,022		125,696
受託者報酬		3,985,517		2,680,196
委託者報酬		119,565,262		80,405,892
その他費用		1,603,344		1,007,561
営業費用合計		125,315,145		84,219,345
営業利益又は営業損失()		265,433,729		484,818,500
経常利益又は経常損失()		265,433,729		484,818,500
当期純利益又は当期純損失()		265,433,729		484,818,500
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()		678,815		36,990,406
期首剰余金又は期首欠損金()		161,695,371		380,692,762
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,041,389		12,547,828
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		9,041,389		12,547,828
剰余金減少額又は欠損金増加額		56,156,542		177,935,005
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		56,156,542		177,935,005
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()		380,692,762		306,503,321

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第5期	
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 (2) 計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2019年 4月27日から2020年 4月27日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第4期		第5期	
	(2019年 4月26日現在)		(2020年 4月27日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,527,852,026口		5,918,683,057口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損		元本の欠損	306,503,321円

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)	1.0362円 (10,362円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	0.9482円 (9,482円)
----------------	--------------------------------	----------------------	--------------------------------	---------------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第4期	第5期
	自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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（237,566,161円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（219,589,995円）、および分配準備積立金（606,768,437円）より、分配対象収益は1,063,924,593円（1万口当たり1,010.57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（104,507,562円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（142,843,792円）、および分配準備積立金（455,902,445円）より、分配対象収益は703,253,799円（1万口当たり1,188.18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5期
	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。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	第5期 (2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券、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4期(自 2018年 4月27日 至 2019年 4月26日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	20,057,608円
親投資信託受益証券	187,643,150円
合計	207,700,758円

第5期(自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	79,013,487円
親投資信託受益証券	293,196,631円
合計	372,210,118円

(デリバティブ取引に関する注記)

第4期(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	86,708,369	-	86,482,250	226,119
	米ドル	86,708,369	-	86,482,250	226,119
	売建	1,806,736,187	-	1,809,208,670	2,472,483
	米ドル	1,806,736,187	-	1,809,208,670	2,472,483
	合計	1,893,444,556	-	1,895,690,920	2,698,602

第5期(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	249,458,000	-	249,539,200	81,200
	米ドル	249,458,000	-	249,539,200	81,200
	売建	865,203,650	-	854,994,440	10,209,210
	米ドル	865,203,650	-	854,994,440	10,209,210
合計		1,114,661,650	-	1,104,533,640	10,290,410

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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4期 (2019年 4月26日現在)	第5期 (2020年 4月27日現在)
期首元本額	14,615,040,087円	10,527,852,026円
期中追加設定元本額	1,008,692,045円	306,069,242円
期中一部解約元本額	5,095,880,106円	4,915,238,211円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,322	129,489.90	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	24,383	2,355,885.46	
		パンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	57,806	4,070,120.46	
		米ドル 小計	83,511	6,555,495.82 (705,371,350)	
投資信託受益証券合計				705,371,350 (705,371,350)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	297,633,454	697,444,472	
		外国株式インデックス・マザーファンド	180,873,346	602,977,473	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,053,241,195	1,606,298,146	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	72,967,241	134,084,602	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	618,268,109	796,576,631	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	261,721,272	512,214,701	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	28,930,639	47,804,987	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	338,056,722	376,696,605	
親投資信託受益証券合計			2,851,691,978	4,774,097,617	
				5,479,468,967	

合計	(705,371,350)
----	---------------

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	12.6%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,409,744,393	652,035,892
コール・ローン	455,428,374	667,623,445
株式	172,267,269,170	152,354,149,040
派生商品評価勘定	17,550,320	128,163,700
未収入金	263,476,160	-
未収配当金	1,934,662,457	1,981,191,957
差入委託証拠金	-	62,380,000
流動資産合計	176,348,130,874	155,845,544,034
資産合計	176,348,130,874	155,845,544,034
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	714,840	1,797,600
前受金	17,045,000	126,530,000
未払金	442,124,980	-
未払解約金	412,800,909	75,208,007

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
未払利息	1,335	1,925
その他未払費用	110,085	132,811
流動負債合計	872,797,149	203,670,343
負債合計	872,797,149	203,670,343
純資産の部		
元本等		
元本	68,808,381,443	66,420,614,464
剰余金		
剰余金又は欠損金()	106,666,952,282	89,221,259,227
元本等合計	175,475,333,725	155,641,873,691
純資産合計	175,475,333,725	155,641,873,691
負債純資産合計	176,348,130,874	155,845,544,034

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27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	2,762,000,000円	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	株式	2,663,600,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数			68,808,381,443口			66,420,614,464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)		2.5502円 25,502円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)		2.3433円 23,433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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券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	(2020年 4月27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、新株予約権証券) 「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)

(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
	東証株価指数先物	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
合計		3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480

（2020年 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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）

（2019年 4月26日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	67,579,087,442円
同期中における追加設定元本額	14,060,784,008円
同期中における一部解約元本額	12,831,490,007円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,172,824,380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)	3,969,466,510円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,853,749,898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)	120,162,198円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,965,080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)	23,612,948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)	60,915,863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)	92,315,517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)	140,545,819円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,825,003,426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	9,109,742,427円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,115,979,600円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,063,599,557円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,001,707,943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)	20,652,117円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	23,010,329円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,832,051円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	47,010,703円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,649,500円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	8,358,236円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,361,347,730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>	26,386,178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>	225,151,325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>	3,414,383,364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>	2,479,883,434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>	9,233,009,781円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	59,588,186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>	223,472,980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>	796,449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>	942,907,444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>	57,187,516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>	382,097,522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>	1,109,499,058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>	964,779,994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>	3,101,038,753円
S M A M・バランスV A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・V A S(適格機関投資家専用)	880,282,695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>	65,177,660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>	41,425,659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)	1,045,609,939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 >	107,829,530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 >	48,426,618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 >	22,746,684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 >	208,991,050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 >	391,095,028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 >	162,209,912円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	119,503,474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 >	62,251,723円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,591,895円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	77,314,903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 >	945,660,284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)	204,123,008円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	20,958,549円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,618,468,794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 >	224,746,577円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	133,073,322円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	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	68,808,381,443円

(2020年 4月27日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,808,381,443円
同期中における追加設定元本額	16,957,041,638円
同期中における一部解約元本額	19,344,808,617円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,930,085,411円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	1,002,421,458円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	4,651,519,341円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	3,204,800,316円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	82,255,976円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4 資産タイプ)	7,056,016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)	25,925,290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)	71,999,208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)	121,550,280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)	84,468,752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)	183,080,997円
国内株式指数ファンド (T O P I X)	1,807,172,658円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	12,989,825,879円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	348,878,578円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	402,912,826円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	297,633,454円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	14,913,973円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	90,110,330円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	73,374,401円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	225,263,505円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	109,513,205円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	133,932,515円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,244,259円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	20,155,703円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	628,342円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	2,812,060円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	1,964,032円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,752,764円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,916,736,716円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	22,951,358円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	220,267,664円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,203,480,644円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,413,624,299円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	8,994,664,617円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	57,396,433円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	218,485,657円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	657,085円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	898,124,937円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	58,124,475円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	405,907,028円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,106,480,802円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	936,340,998円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,882,119,746円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,225,167円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	66,011,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	80,438,386円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	48,200,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	23,412,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	209,289,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	402,959,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	115,926,629円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	55,415,739円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	10,193,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	71,756,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	968,188,755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)	191,083,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	22,115,210円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	929,127,958円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	189,817,826円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	1,542,313,109円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	112,200,588円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	10,043,124円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	14,237,375円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	15,653,159円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	101,389,039円
合計	66,420,614,464円

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	3,700	2,532.00	9,368,400	
日本水産	101,000	471.00	47,571,000	
マルハニチロ	14,500	2,278.00	33,031,000	
カネコ種苗	4,600	1,485.00	6,831,000	
サカタのタネ	11,900	3,570.00	42,483,000	
ホクト	8,300	1,947.00	16,160,100	
日鉄鉱業	2,300	4,500.00	10,350,000	
三井松島ホールディングス	5,600	834.00	4,670,400	
国際石油開発帝石	410,300	665.80	273,177,740	
石油資源開発	13,000	1,861.00	24,193,000	
K & O エナジーグループ	5,600	1,587.00	8,887,200	
ヒノキヤグループ	3,600	1,406.00	5,061,600	
ショーボンドホールディングス	15,600	4,370.00	68,172,000	
ミライト・ホールディングス	29,300	1,375.00	40,287,500	
タマホーム	6,500	1,178.00	7,657,000	
スペースバリューホールディングス	17,900	333.00	5,960,700	
安藤・間	61,200	660.00	40,392,000	
東急建設	30,200	543.00	16,398,600	
コムシスホールディングス	36,000	2,959.00	106,524,000	
ビーアールホールディングス	13,400	483.00	6,472,200	
高松コンストラクショングループ	6,600	2,209.00	14,579,400	
東建コーポレーション	3,100	7,380.00	22,878,000	
大成建設	78,100	3,300.00	257,730,000	
大林組	231,700	922.00	213,627,400	
清水建設	236,200	825.00	194,865,000	
飛島建設	8,500	1,049.00	8,916,500	

長谷工コーポレーション	89,900	1,145.00	102,935,500
松井建設	11,800	643.00	7,587,400
銭高組	1,600	3,665.00	5,864,000
鹿島建設	183,200	1,098.00	201,153,600
不動テトラ	7,600	1,338.00	10,168,800
大末建設	6,100	727.00	4,434,700
鉄建建設	5,700	2,121.00	12,089,700
西松建設	18,600	2,036.00	37,869,600
三井住友建設	59,400	426.00	25,304,400
大豊建設	6,000	2,225.00	13,350,000
前田建設工業	60,500	836.00	50,578,000
奥村組	13,800	2,262.00	31,215,600
東鉄工業	9,600	2,786.00	26,745,600
浅沼組	3,000	3,445.00	10,335,000
戸田建設	97,400	615.00	59,901,000
熊谷組	10,900	2,250.00	24,525,000
北野建設	2,200	2,419.00	5,321,800
矢作建設工業	12,100	800.00	9,680,000
ピーエス三菱	10,600	520.00	5,512,000
日本ハウスホールディングス	22,500	291.00	6,547,500
大東建託	28,400	10,445.00	296,638,000
新日本建設	10,000	778.00	7,780,000
N I P P O	18,900	2,406.00	45,473,400
東亜道路工業	2,000	2,866.00	5,732,000
前田道路	21,300	1,959.00	41,726,700
日本道路	2,500	6,450.00	16,125,000
東亜建設工業	8,300	1,365.00	11,329,500
日本国土開発	18,500	530.00	9,805,000
若築建設	5,800	1,193.00	6,919,400
東洋建設	27,700	415.00	11,495,500
五洋建設	93,800	537.00	50,370,600
世紀東急工業	14,000	784.00	10,976,000
福田組	2,800	4,220.00	11,816,000
住友林業	59,400	1,292.00	76,744,800
日本基礎技術	13,700	394.00	5,397,800
巴コーポレーション	16,200	340.00	5,508,000
大和ハウス工業	232,700	2,716.50	632,129,550
ライト工業	13,000	1,318.00	17,134,000
積水ハウス	257,300	1,808.50	465,327,050
ユアテック	15,200	590.00	8,968,000
中電工	8,100	2,184.00	17,690,400
関電工	30,600	864.00	26,438,400

きんでん	55,700	1,682.00	93,687,400
東京エネシス	9,800	724.00	7,095,200
トーエネック	2,900	3,300.00	9,570,000
住友電設	6,400	2,221.00	14,214,400
日本電設工業	11,900	2,184.00	25,989,600
協和エクシオ	35,300	2,626.00	92,697,800
新日本空調	6,800	2,151.00	14,626,800
九電工	16,300	2,687.00	43,798,100
三機工業	16,900	1,217.00	20,567,300
日揮ホールディングス	73,200	981.00	71,809,200
中外炉工業	4,100	1,505.00	6,170,500
ヤマト	9,400	688.00	6,467,200
太平電業	6,100	2,129.00	12,986,900
高砂熱学工業	19,500	1,661.00	32,389,500
朝日工業社	2,200	3,045.00	6,699,000
明星工業	15,300	784.00	11,995,200
大気社	11,400	3,020.00	34,428,000
ダイダン	5,700	2,732.00	15,572,400
日比谷総合設備	8,100	1,876.00	15,195,600
O S J Bホールディングス	42,500	233.00	9,902,500
レイズネクスト	13,600	1,203.00	16,360,800
日本製粉	20,400	1,707.00	34,822,800
日清製粉グループ本社	84,500	1,682.00	142,129,000
昭和産業	6,800	3,315.00	22,542,000
鳥越製粉	8,500	905.00	7,692,500
中部飼料	8,700	1,639.00	14,259,300
フィード・ワン	55,900	164.00	9,167,600
日本甜菜製糖	4,700	1,690.00	7,943,000
三井製糖	5,900	2,183.00	12,879,700
日新製糖	3,600	1,928.00	6,940,800
森永製菓	17,600	4,555.00	80,168,000
中村屋	2,600	3,885.00	10,101,000
江崎グリコ	22,400	4,940.00	110,656,000
名糖産業	6,100	1,304.00	7,954,400
井村屋グループ	4,000	1,960.00	7,840,000
不二家	4,600	2,086.00	9,595,600
山崎製パン	56,400	2,324.00	131,073,600
モロゾフ	1,700	5,290.00	8,993,000
亀田製菓	4,300	5,250.00	22,575,000
寿スピリッツ	7,100	4,360.00	30,956,000
カルビー	34,400	3,370.00	115,928,000
森永乳業	14,000	4,195.00	58,730,000

六甲バター	5,800	1,448.00	8,398,400
ヤクルト本社	51,700	6,660.00	344,322,000
明治ホールディングス	49,600	7,650.00	379,440,000
雪印メグミルク	17,800	2,477.00	44,090,600
プリマハム	11,200	2,500.00	28,000,000
日本ハム	28,600	3,675.00	105,105,000
丸大食品	8,100	1,983.00	16,062,300
S Foods	5,800	2,299.00	13,334,200
柿安本店	3,200	2,217.00	7,094,400
伊藤ハム米久ホールディングス	42,300	631.00	26,691,300
サッポロホールディングス	25,900	2,030.00	52,577,000
アサヒグループホールディングス	157,500	3,732.00	587,790,000
キリンホールディングス	318,600	2,077.00	661,732,200
宝ホールディングス	56,300	785.00	44,195,500
オエノンホールディングス	22,200	398.00	8,835,600
養命酒製造	3,500	1,900.00	6,650,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	52,900	1,994.00	105,482,600
サントリー食品インターナショナル	50,100	4,110.00	205,911,000
ダイドーグループホールディングス	3,800	4,160.00	15,808,000
伊藤園	22,700	6,160.00	139,832,000
キーコーヒー	7,400	2,240.00	16,576,000
日清オイリオグループ	9,400	3,570.00	33,558,000
不二製油グループ本社	18,400	2,549.00	46,901,600
かどや製油	1,300	3,685.00	4,790,500
J - オイルミルズ	4,000	4,145.00	16,580,000
キッコーマン	53,800	4,830.00	259,854,000
味の素	166,100	1,914.00	317,915,400
キューピー	41,900	2,192.00	91,844,800
ハウス食品グループ本社	28,100	3,405.00	95,680,500
カゴメ	28,400	2,742.00	77,872,800
焼津水産化学工業	6,400	907.00	5,804,800
アリアケジャパン	7,000	6,370.00	44,590,000
ニチレイ	35,800	2,787.00	99,774,600
東洋水産	38,500	5,470.00	210,595,000
イトアンド	3,700	1,716.00	6,349,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,100	899.00	4,584,900
日清食品ホールディングス	31,900	9,130.00	291,247,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,259.00	9,487,800
一正蒲鉾	5,900	999.00	5,894,100
フジッコ	8,200	1,988.00	16,301,600
ロック・フィールド	8,200	1,321.00	10,832,200
日本たばこ産業	433,800	2,016.00	874,540,800

ケンコーマヨネーズ	4,800	1,989.00	9,547,200
わらべや日洋ホールディングス	5,500	1,558.00	8,569,000
なとり	5,400	1,735.00	9,369,000
ピクルスコーポレーション	2,000	2,325.00	4,650,000
北の達人コーポレーション	26,400	470.00	12,408,000
ユーグレナ	33,800	630.00	21,294,000
ミヨシ油脂	4,300	1,069.00	4,596,700
理研ビタミン	7,300	2,140.00	15,622,000
片倉工業	12,400	1,002.00	12,424,800
ゲンゼ	5,500	3,685.00	20,267,500
東洋紡	30,000	1,231.00	36,930,000
ユニチカ	25,200	297.00	7,484,400
富士紡ホールディングス	4,000	2,818.00	11,272,000
倉敷紡績	7,500	2,476.00	18,570,000
日本毛織	23,900	938.00	22,418,200
ダイドーリミテッド	25,600	195.00	4,992,000
帝国繊維	8,600	2,178.00	18,730,800
帝人	59,400	1,744.00	103,593,600
東レ	533,100	489.40	260,899,140
住江織物	2,600	1,775.00	4,615,000
アツギ	10,600	622.00	6,593,200
ダイニック	6,400	733.00	4,691,200
セーレン	18,200	1,276.00	23,223,200
小松マテーレ	13,500	749.00	10,111,500
ワコールホールディングス	19,500	2,163.00	42,178,500
ホギメディカル	8,600	3,405.00	29,283,000
T S Iホールディングス	27,600	412.00	11,371,200
マツオカコーポレーション	3,200	1,772.00	5,670,400
ワールド	10,700	1,226.00	13,118,200
三陽商会	5,100	857.00	4,370,700
オンワードホールディングス	46,200	348.00	16,077,600
ゴールドウイン	13,400	5,630.00	75,442,000
デサント	15,100	1,340.00	20,234,000
特種東海製紙	4,600	4,180.00	19,228,000
王子ホールディングス	303,100	559.00	169,432,900
日本製紙	33,000	1,551.00	51,183,000
三菱製紙	12,500	340.00	4,250,000
北越コーポレーション	48,500	410.00	19,885,000
中越パルプ工業	4,800	1,371.00	6,580,800
大王製紙	32,200	1,465.00	47,173,000
レンゴー	70,300	851.00	59,825,300
トーモク	5,300	1,523.00	8,071,900

ザ・パックス	5,800	3,530.00	20,474,000
クラレ	114,400	1,069.00	122,293,600
旭化成	485,900	748.30	363,598,970
昭和電工	51,800	2,353.00	121,885,400
住友化学	527,700	322.00	169,919,400
住友精化	3,500	2,860.00	10,010,000
日産化学	40,900	4,005.00	163,804,500
ラサ工業	3,300	1,229.00	4,055,700
クレハ	6,000	4,230.00	25,380,000
多木化学	2,500	5,390.00	13,475,000
テイカ	5,800	1,515.00	8,787,000
石原産業	14,300	596.00	8,522,800
日本曹達	11,000	2,843.00	31,273,000
東ソー	112,600	1,322.00	148,857,200
トクヤマ	21,100	2,196.00	46,335,600
セントラル硝子	15,600	1,830.00	28,548,000
東亜合成	46,000	991.00	45,586,000
大阪ソーダ	7,300	2,462.00	17,972,600
関東電化工業	18,400	837.00	15,400,800
デンカ	26,500	2,555.00	67,707,500
信越化学工業	125,900	11,800.00	1,485,620,000
日本カーバイド工業	4,500	1,015.00	4,567,500
堺化学工業	5,300	1,739.00	9,216,700
第一稀元素化学工業	9,400	736.00	6,918,400
エア・ウォーター	68,100	1,467.00	99,902,700
大陽日酸	70,900	1,647.00	116,772,300
日本化学工業	2,800	2,195.00	6,146,000
日本パーカライズン	37,400	1,098.00	41,065,200
高压ガス工業	13,000	741.00	9,633,000
チタン工業	2,100	1,644.00	3,452,400
四国化成工業	10,700	1,079.00	11,545,300
ステラ ケミファ	4,200	2,267.00	9,521,400
保土谷化学工業	3,000	3,345.00	10,035,000
日本触媒	11,500	5,180.00	59,570,000
大日精化工業	6,300	2,243.00	14,130,900
カネカ	18,700	2,765.00	51,705,500
三菱瓦斯化学	68,000	1,312.00	89,216,000
三井化学	65,800	2,062.00	135,679,600
J S R	68,600	1,964.00	134,730,400
東京応化工業	12,600	4,410.00	55,566,000
大阪有機化学工業	6,700	1,693.00	11,343,100
三菱ケミカルホールディングス	489,400	650.50	318,354,700

K Hネオケム	13,200	1,781.00	23,509,200
ダイセル	100,100	847.00	84,784,700
住友ベークライト	11,900	2,648.00	31,511,200
積水化学工業	155,600	1,385.00	215,506,000
日本ゼオン	66,600	825.00	54,945,000
アイカ工業	22,000	3,005.00	66,110,000
宇部興産	36,000	1,812.00	65,232,000
積水樹脂	13,200	2,059.00	27,178,800
タキロンシーアイ	17,400	593.00	10,318,200
旭有機材	4,800	1,294.00	6,211,200
日立化成	34,100	4,610.00	157,201,000
ニチバン	4,600	1,496.00	6,881,600
リケンテクノス	19,800	447.00	8,850,600
大倉工業	3,900	1,556.00	6,068,400
積水化成成品工業	10,900	628.00	6,845,200
群栄化学工業	2,400	2,537.00	6,088,800
ミライアル	3,800	1,046.00	3,974,800
ダイキョーニシカワ	15,400	525.00	8,085,000
森六ホールディングス	5,300	1,450.00	7,685,000
日本化薬	46,500	1,021.00	47,476,500
カーリットホールディングス	11,500	500.00	5,750,000
日本精化	6,700	1,549.00	10,378,300
扶桑化学工業	7,300	3,150.00	22,995,000
トリケミカル研究所	1,700	9,680.00	16,456,000
A D E K A	33,600	1,350.00	45,360,000
日油	27,600	3,700.00	102,120,000
ハリマ化成グループ	6,500	994.00	6,461,000
花王	179,400	8,764.00	1,572,261,600
第一工業製薬	2,900	4,535.00	13,151,500
三洋化成工業	4,300	4,250.00	18,275,000
大日本塗料	9,100	954.00	8,681,400
日本ペイントホールディングス	60,600	6,150.00	372,690,000
関西ペイント	82,700	2,001.00	165,482,700
中国塗料	21,800	836.00	18,224,800
日本特殊塗料	6,100	870.00	5,307,000
藤倉化成	13,200	500.00	6,600,000
太陽ホールディングス	5,400	4,215.00	22,761,000
D I C	30,600	2,450.00	74,970,000
サカタインクス	15,800	934.00	14,757,200
東洋インキS Cホールディングス	13,800	2,074.00	28,621,200
T & K T O K A	7,600	740.00	5,624,000
富士フイルムホールディングス	143,800	5,226.00	751,498,800

資生堂	148,900	6,530.00	972,317,000
ライオン	97,300	2,379.00	231,476,700
高砂香料工業	5,200	2,143.00	11,143,600
マンダム	17,300	2,086.00	36,087,800
ミルボン	10,000	4,930.00	49,300,000
ファンケル	30,500	2,669.00	81,404,500
コーセー	14,100	14,300.00	201,630,000
コタ	5,700	1,228.00	6,999,600
ポーラ・オルビスホールディングス	31,900	2,115.00	67,468,500
ノエビアホールディングス	7,000	5,180.00	36,260,000
エステー	5,600	1,528.00	8,556,800
アグロ カネショウ	3,400	1,562.00	5,310,800
コニシ	12,100	1,406.00	17,012,600
長谷川香料	10,300	2,212.00	22,783,600
小林製薬	20,900	11,070.00	231,363,000
荒川化学工業	7,000	1,274.00	8,918,000
メック	5,800	1,602.00	9,291,600
タカラバイオ	19,800	2,441.00	48,331,800
JCU	9,200	2,374.00	21,840,800
デクセリアルズ	20,700	701.00	14,510,700
アース製薬	5,800	6,300.00	36,540,000
北興化学工業	9,100	575.00	5,232,500
大成ラミック	3,600	2,610.00	9,396,000
クミアイ化学工業	31,400	893.00	28,040,200
日本農薬	16,100	432.00	6,955,200
アキレス	5,800	1,682.00	9,755,600
有沢製作所	12,800	838.00	10,726,400
日東電工	51,300	5,060.00	259,578,000
レック	8,800	1,166.00	10,260,800
三光合成	13,900	263.00	3,655,700
藤森工業	6,200	3,105.00	19,251,000
前澤化成工業	7,500	1,052.00	7,890,000
未来工業	5,000	1,944.00	9,720,000
JSP	5,000	1,368.00	6,840,000
エフピコ	8,500	8,230.00	69,955,000
天馬	5,400	1,535.00	8,289,000
信越ポリマー	13,400	814.00	10,907,600
東リ	23,100	260.00	6,006,000
ニフコ	26,800	1,968.00	52,742,400
バルカー	6,200	1,770.00	10,974,000
ユニ・チャーム	144,800	4,071.00	589,480,800
協和キリン	75,100	2,446.00	183,694,600

武田薬品工業	623,400	3,986.00	2,484,872,400
アステラス製薬	648,600	1,798.00	1,166,182,800
大日本住友製薬	55,900	1,461.00	81,669,900
塩野義製薬	95,600	5,790.00	553,524,000
あすか製薬	9,800	1,120.00	10,976,000
日本新薬	19,700	7,640.00	150,508,000
中外製薬	78,000	13,215.00	1,030,770,000
科研製薬	12,900	5,800.00	74,820,000
エーザイ	89,600	7,182.00	643,507,200
ロート製薬	38,600	3,265.00	126,029,000
小野薬品工業	172,100	2,580.00	444,018,000
久光製薬	19,700	5,060.00	99,682,000
持田製薬	10,500	4,160.00	43,680,000
参天製薬	139,400	1,898.00	264,581,200
扶桑薬品工業	4,100	2,255.00	9,245,500
日本ケミファ	2,000	2,421.00	4,842,000
ツムラ	23,300	2,983.00	69,503,900
日医工	21,500	1,403.00	30,164,500
キッセイ薬品工業	13,500	2,569.00	34,681,500
生化学工業	14,900	1,099.00	16,375,100
栄研化学	13,400	2,003.00	26,840,200
鳥居薬品	5,000	2,964.00	14,820,000
JCRファーマ	5,300	10,790.00	57,187,000
東和薬品	9,600	2,222.00	21,331,200
富士製薬工業	5,900	1,185.00	6,991,500
沢井製薬	15,300	6,020.00	92,106,000
ゼリア新薬工業	13,900	2,104.00	29,245,600
第一三共	214,200	7,487.00	1,603,715,400
キョーリン製薬ホールディングス	16,800	2,335.00	39,228,000
大幸薬品	9,900	1,765.00	17,473,500
ダイト	4,700	3,595.00	16,896,500
大塚ホールディングス	142,600	4,274.00	609,472,400
大正製薬ホールディングス	15,700	6,760.00	106,132,000
ペプチドリーム	38,200	3,990.00	152,418,000
日本コークス工業	90,100	55.00	4,955,500
ニチレキ	9,400	1,419.00	13,338,600
ユシロ化学工業	6,400	1,181.00	7,558,400
富士石油	29,000	182.00	5,278,000
出光興産	83,700	2,411.00	201,800,700
JXTGホールディングス	1,131,100	376.10	425,406,710
コスモエネルギーホールディングス	22,100	1,553.00	34,321,300
横浜ゴム	43,000	1,362.00	58,566,000

TOYO TIRE	44,000	1,215.00	53,460,000
ブリヂストン	215,700	3,273.00	705,986,100
住友ゴム工業	66,900	1,014.00	67,836,600
オカモト	4,700	4,410.00	20,727,000
ニッタ	8,100	1,887.00	15,284,700
住友理工	16,100	570.00	9,177,000
三ツ星ベルト	10,200	1,450.00	14,790,000
バンドー化学	14,400	621.00	8,942,400
日東紡績	11,200	5,220.00	58,464,000
A G C	73,800	2,591.00	191,215,800
日本板硝子	11,500	318.00	3,657,000
日本山村硝子	5,400	848.00	4,579,200
日本電気硝子	30,600	1,466.00	44,859,600
オハラ	4,000	907.00	3,628,000
住友大阪セメント	14,700	3,590.00	52,773,000
太平洋セメント	47,500	2,110.00	100,225,000
日本ヒューム	10,600	630.00	6,678,000
日本コンクリート工業	22,200	250.00	5,550,000
三谷セキサン	3,600	4,895.00	17,622,000
アジアパイルホールディングス	15,000	407.00	6,105,000
東海カーボン	78,700	890.00	70,043,000
日本カーボン	3,900	3,300.00	12,870,000
東洋炭素	4,900	1,406.00	6,889,400
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	3,435.00	14,427,000
T O T O	53,500	3,640.00	194,740,000
日本碍子	91,000	1,336.00	121,576,000
日本特殊陶業	58,100	1,548.00	89,938,800
M A R U W A	2,900	6,710.00	19,459,000
品川リフラクトリーズ	2,400	2,154.00	5,169,600
黒崎播磨	1,700	3,745.00	6,366,500
ヨータイ	8,200	605.00	4,961,000
東京窯業	16,500	293.00	4,834,500
フジミインコーポレーテッド	6,900	2,905.00	20,044,500
ニチアス	20,100	2,061.00	41,426,100
ニチハ	10,400	1,913.00	19,895,200
日本製鉄	331,900	877.70	291,308,630
神戸製鋼所	137,400	350.00	48,090,000
中山製鋼所	13,000	380.00	4,940,000
合同製鐵	4,600	1,952.00	8,979,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,700	699.00	138,891,300
東京製鐵	36,600	686.00	25,107,600
共英製鋼	8,700	1,336.00	11,623,200

大和工業	16,300	2,114.00	34,458,200
東京鐵鋼	4,300	1,064.00	4,575,200
大阪製鐵	4,500	1,158.00	5,211,000
淀川製鋼所	9,700	1,691.00	16,402,700
丸一鋼管	24,000	2,444.00	58,656,000
モリ工業	2,600	2,296.00	5,969,600
大同特殊鋼	12,100	3,445.00	41,684,500
日本冶金工業	6,300	1,586.00	9,991,800
山陽特殊製鋼	6,300	898.00	5,657,400
愛知製鋼	4,200	2,814.00	11,818,800
日立金属	80,600	1,067.00	86,000,200
大平洋金属	5,500	1,720.00	9,460,000
新日本電工	53,400	147.00	7,849,800
栗本鐵工所	4,300	1,845.00	7,933,500
三菱製鋼	6,700	810.00	5,427,000
シンニッタン	15,600	247.00	3,853,200
大紀アルミニウム工業所	11,000	559.00	6,149,000
日本輕金属ホールディングス	191,100	169.00	32,295,900
三井金属鉱業	20,400	1,983.00	40,453,200
東邦亜鉛	4,600	1,267.00	5,828,200
三菱マテリアル	49,100	2,222.00	109,100,200
住友金属鉱山	94,900	2,680.00	254,332,000
D O W A ホールディングス	18,700	2,933.00	54,847,100
古河機械金属	13,100	1,065.00	13,951,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,100	911.00	8,290,100
東邦チタニウム	14,700	595.00	8,746,500
U A C J	11,400	1,707.00	19,459,800
C K サンエツ	2,000	2,758.00	5,516,000
古河電気工業	22,700	1,996.00	45,309,200
住友電気工業	276,100	1,079.50	298,049,950
フジクラ	92,900	304.00	28,241,600
昭和電線ホールディングス	9,600	1,061.00	10,185,600
タツタ電線	16,300	510.00	8,313,000
リョービ	8,800	1,216.00	10,700,800
アーレスティ	13,200	362.00	4,778,400
アサヒホールディングス	13,500	2,348.00	31,698,000
稲葉製作所	6,500	1,288.00	8,372,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,559.00	5,144,700
トーカロ	20,700	996.00	20,617,200
アルファC o	4,300	928.00	3,990,400
S U M C O	88,800	1,490.00	132,312,000
川田テクノロジーズ	1,800	4,870.00	8,766,000

RS Technologies	2,600	2,518.00	6,546,800
東洋製罐グループホールディングス	48,000	1,119.00	53,712,000
ホッカンホールディングス	4,800	1,571.00	7,540,800
コロナ	5,900	943.00	5,563,700
横河ブリッジホールディングス	14,000	1,879.00	26,306,000
三和ホールディングス	70,800	802.00	56,781,600
文化シャッター	22,500	769.00	17,302,500
三協立山	10,500	837.00	8,788,500
アルインコ	7,700	990.00	7,623,000
LIXILグループ	109,600	1,249.00	136,890,400
ノーリツ	15,700	1,196.00	18,777,200
長府製作所	7,300	2,337.00	17,060,100
リンナイ	14,600	8,140.00	118,844,000
日東精工	12,400	466.00	5,778,400
岡部	15,400	750.00	11,550,000
ジーテクト	8,900	1,067.00	9,496,300
東プレ	13,600	1,228.00	16,700,800
高周波熱錬	15,000	592.00	8,880,000
東京製網	7,900	541.00	4,273,900
パイオラックス	10,100	1,567.00	15,826,700
エイチワン	9,300	505.00	4,696,500
日本発條	79,600	705.00	56,118,000
三益半導体工業	5,700	2,065.00	11,770,500
日本製鋼所	23,300	1,265.00	29,474,500
三浦工業	32,200	4,440.00	142,968,000
タクマ	24,900	1,165.00	29,008,500
ツガミ	15,600	892.00	13,915,200
オークマ	8,500	3,670.00	31,195,000
芝浦機械	8,800	2,076.00	18,268,800
アマダ	92,700	934.00	86,581,800
アイダエンジニアリング	18,800	741.00	13,930,800
F U J I	30,600	1,756.00	53,733,600
牧野フライス製作所	8,600	2,894.00	24,888,400
オーエスジー	35,000	1,335.00	46,725,000
旭ダイヤモンド工業	20,300	480.00	9,744,000
D M G 森精機	46,600	1,017.00	47,392,200
ソディック	18,100	728.00	13,176,800
ディスコ	10,000	24,090.00	240,900,000
日東工器	4,500	1,849.00	8,320,500
日進工具	2,600	2,702.00	7,025,200
パンチ工業	10,100	345.00	3,484,500
豊和工業	5,700	745.00	4,246,500

島精機製作所	12,100	1,567.00	18,960,700
オプトラン	8,500	2,829.00	24,046,500
イワキポンプ	4,900	946.00	4,635,400
フリー	9,200	816.00	7,507,200
ヤマシンフィルタ	16,300	817.00	13,317,100
日阪製作所	10,600	751.00	7,960,600
やまびこ	14,000	822.00	11,508,000
平田機工	3,500	4,865.00	17,027,500
ペガサスミシン製造	13,700	324.00	4,438,800
マルマエ	4,200	868.00	3,645,600
タツモ	3,900	1,099.00	4,286,100
ナプテスコ	43,400	2,939.00	127,552,600
三井海洋開発	8,200	1,442.00	11,824,400
レオン自動機	7,700	1,166.00	8,978,200
S M C	23,500	48,900.00	1,149,150,000
ホソカワミクロン	2,600	4,950.00	12,870,000
ユニオンツール	3,000	2,758.00	8,274,000
オイレス工業	9,700	1,397.00	13,550,900
日精エー・エス・ピー機械	2,800	2,882.00	8,069,600
サトーホールディングス	10,800	2,143.00	23,144,400
技研製作所	6,800	3,965.00	26,962,000
日精樹脂工業	7,700	980.00	7,546,000
小松製作所	338,700	1,978.00	669,948,600
住友重機械工業	42,300	2,185.00	92,425,500
日立建機	29,400	2,459.00	72,294,600
日工	13,400	568.00	7,611,200
巴工業	4,200	1,993.00	8,370,600
井関農機	8,100	1,177.00	9,533,700
T O W A	8,800	883.00	7,770,400
北川鉄工所	3,700	1,533.00	5,672,100
ローツェ	3,400	4,300.00	14,620,000
クボタ	397,400	1,298.00	515,825,200
荏原実業	2,600	2,229.00	5,795,400
三菱化工機	3,700	1,595.00	5,901,500
月島機械	14,300	1,210.00	17,303,000
帝国電機製作所	7,300	1,252.00	9,139,600
新東工業	17,200	730.00	12,556,000
澁谷工業	6,600	2,639.00	17,417,400
アイチ コーポレーション	14,100	720.00	10,152,000
小森コーポレーション	19,000	748.00	14,212,000
鶴見製作所	6,000	1,993.00	11,958,000
住友精密工業	2,100	2,229.00	4,680,900

酒井重工業	1,900	2,026.00	3,849,400
荏原製作所	31,300	2,287.00	71,583,100
西島製作所	10,400	751.00	7,810,400
北越工業	9,300	993.00	9,234,900
ダイキン工業	95,400	13,455.00	1,283,607,000
オルガノ	2,700	5,570.00	15,039,000
トーヨーカネツ	4,200	1,910.00	8,022,000
栗田工業	40,200	2,884.00	115,936,800
椿本チエイン	9,800	2,462.00	24,127,600
大同工業	6,800	630.00	4,284,000
アネスト岩田	11,900	842.00	10,019,800
ダイフク	38,000	6,990.00	265,620,000
加藤製作所	6,000	1,252.00	7,512,000
タダノ	37,200	817.00	30,392,400
フジテック	26,300	1,536.00	40,396,800
C K D	21,000	1,736.00	36,456,000
キトー	7,500	1,035.00	7,762,500
平和	21,100	1,805.00	38,085,500
理想科学工業	6,900	1,481.00	10,218,900
S A N K Y O	17,100	2,961.00	50,633,100
日本金銭機械	10,700	544.00	5,820,800
マースグループホールディングス	5,900	1,655.00	9,764,500
フクシマガリレイ	4,500	3,160.00	14,220,000
ダイコク電機	5,300	1,127.00	5,973,100
竹内製作所	12,400	1,479.00	18,339,600
アマノ	19,700	2,210.00	43,537,000
J U K I	11,900	581.00	6,913,900
マックス	11,500	1,588.00	18,262,000
グローリー	19,300	2,349.00	45,335,700
新晃工業	7,200	1,371.00	9,871,200
大和冷機工業	11,200	913.00	10,225,600
セガサミーホールディングス	75,000	1,279.00	95,925,000
日本ピストンリング	4,400	1,202.00	5,288,800
リケン	3,700	2,965.00	10,970,500
T P R	9,000	1,236.00	11,124,000
ツバキ・ナカシマ	16,500	707.00	11,665,500
ホシザキ	21,900	8,040.00	176,076,000
大豊工業	8,200	533.00	4,370,600
日本精工	138,200	711.00	98,260,200
N T N	174,500	198.00	34,551,000
ジェイテクト	69,200	758.00	52,453,600
不二越	7,000	3,005.00	21,035,000

日本トムソン	24,300	363.00	8,820,900
THK	43,400	2,445.00	106,113,000
ユーシン精機	7,700	653.00	5,028,100
前澤給装工業	3,700	2,045.00	7,566,500
イーグル工業	9,600	668.00	6,412,800
日本ピラー工業	8,000	1,310.00	10,480,000
キッツ	31,300	659.00	20,626,700
マキタ	97,400	3,380.00	329,212,000
日立造船	60,300	346.00	20,863,800
三菱重工業	125,500	2,709.00	339,979,500
IHI	54,200	1,277.00	69,213,400
スター精密	11,800	1,128.00	13,310,400
日清紡ホールディングス	50,400	715.00	36,036,000
イビデン	45,800	2,444.00	111,935,200
コニカミノルタ	166,300	404.00	67,185,200
ブラザー工業	90,600	1,748.00	158,368,800
ミネベアミツミ	137,900	1,673.00	230,706,700
日立製作所	359,800	3,047.00	1,096,310,600
三菱電機	748,200	1,307.50	978,271,500
富士電機	44,900	2,484.00	111,531,600
東洋電機製造	4,200	1,240.00	5,208,000
安川電機	80,300	3,270.00	262,581,000
シンフォニアテクノロジー	11,000	943.00	10,373,000
明電舎	14,000	1,616.00	22,624,000
オリジン	3,400	1,433.00	4,872,200
山洋電気	3,700	4,500.00	16,650,000
デンヨー	6,700	2,014.00	13,493,800
東芝テック	9,500	3,420.00	32,490,000
芝浦メカトロニクス	1,700	2,537.00	4,312,900
マブチモーター	20,500	3,230.00	66,215,000
日本電産	180,300	5,686.00	1,025,185,800
トレックス・セミコンダクター	5,500	1,044.00	5,742,000
東光高岳	6,500	888.00	5,772,000
宮越ホールディングス	4,300	545.00	2,343,500
ダイヘン	8,000	2,917.00	23,336,000
ヤーマン	13,800	696.00	9,604,800
JVCケンウッド	65,300	176.00	11,492,800
ミマキエンジニアリング	11,300	404.00	4,565,200
第一精工	3,900	2,199.00	8,576,100
日新電機	18,100	989.00	17,900,900
大崎電気工業	18,000	527.00	9,486,000
オムロン	66,800	6,390.00	426,852,000

日東工業	10,900	1,795.00	19,565,500
I D E C	11,300	1,515.00	17,119,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,500	1,466.00	37,383,000
サクサホールディングス	3,000	1,740.00	5,220,000
メルコホールディングス	3,200	2,800.00	8,960,000
日本電気	90,800	4,195.00	380,906,000
富士通	72,300	10,350.00	748,305,000
沖電気工業	31,000	997.00	30,907,000
電気興業	4,000	2,460.00	9,840,000
サンケン電気	8,600	2,123.00	18,257,800
アイホン	5,100	1,533.00	7,818,300
ルネサスエレクトロニクス	360,100	480.00	172,848,000
セイコーエプソン	91,900	1,113.00	102,284,700
ワコム	54,900	377.00	20,697,300
アルバック	14,000	2,893.00	40,502,000
E I Z O	5,900	3,270.00	19,293,000
日本信号	19,400	995.00	19,303,000
京三製作所	19,700	494.00	9,731,800
能美防災	10,100	2,050.00	20,705,000
ホーチキ	5,800	1,352.00	7,841,600
エレコム	8,300	4,455.00	36,976,500
パナソニック	855,400	773.60	661,737,440
シャープ	86,600	1,153.00	99,849,800
アンリツ	48,400	2,165.00	104,786,000
富士通ゼネラル	20,700	1,691.00	35,003,700
ソニー	473,700	6,779.00	3,211,212,300
T D K	36,000	8,850.00	318,600,000
帝国通信工業	5,800	1,189.00	6,896,200
タムラ製作所	26,300	411.00	10,809,300
アルプスアルパイン	66,900	994.00	66,498,600
日本トリム	1,600	2,856.00	4,569,600
ローランド ディー・ジー	5,300	1,277.00	6,768,100
フォスター電機	8,700	1,151.00	10,013,700
S M K	2,400	2,413.00	5,791,200
ヨコオ	5,000	2,346.00	11,730,000
ホシデン	20,000	947.00	18,940,000
ヒロセ電機	11,500	11,250.00	129,375,000
日本航空電子工業	17,200	1,385.00	23,822,000
T O A	9,600	694.00	6,662,400
マクセルホールディングス	16,500	969.00	15,988,500
古野電気	11,000	795.00	8,745,000
ユニデンホールディングス	2,800	1,795.00	5,026,000

スミダコーポレーション	6,900	677.00	4,671,300
アイコム	4,600	2,600.00	11,960,000
リオン	3,800	2,250.00	8,550,000
船井電機	10,700	427.00	4,568,900
横河電機	69,000	1,394.00	96,186,000
新電元工業	3,000	2,373.00	7,119,000
アズビル	47,000	2,776.00	130,472,000
東亜ディーケーケー	5,500	884.00	4,862,000
日本光電工業	31,300	3,985.00	124,730,500
チノー	4,200	1,286.00	5,401,200
共和電業	15,200	380.00	5,776,000
堀場製作所	14,900	5,370.00	80,013,000
アドバンテスト	55,600	5,180.00	288,008,000
エスペック	7,000	1,693.00	11,851,000
キーエンス	67,900	37,930.00	2,575,447,000
日置電機	4,200	3,000.00	12,600,000
シスメックス	53,600	7,380.00	395,568,000
日本マイクロニクス	14,100	822.00	11,590,200
メガチップス	7,800	1,593.00	12,425,400
O B A R A G R O U P	4,100	2,791.00	11,443,100
コーセル	11,700	910.00	10,647,000
イリソ電子工業	6,500	2,832.00	18,408,000
オブテックスグループ	13,100	1,189.00	15,575,900
千代田インテグレ	4,500	1,720.00	7,740,000
レーザーテック	32,800	6,140.00	201,392,000
スタンレー電気	52,300	2,443.00	127,768,900
岩崎電気	4,400	1,356.00	5,966,400
ウシオ電機	42,400	1,110.00	47,064,000
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	330.00	4,323,000
日本セラミック	8,000	1,937.00	15,496,000
山一電機	6,000	1,390.00	8,340,000
図研	5,200	2,372.00	12,334,400
日本電子	14,800	3,025.00	44,770,000
カシオ計算機	66,500	1,672.00	111,188,000
ファナック	71,200	16,630.00	1,184,056,000
日本シイエムケイ	19,300	406.00	7,835,800
エンプラス	4,700	2,185.00	10,269,500
ローム	33,100	6,400.00	211,840,000
浜松ホトニクス	53,600	4,710.00	252,456,000
三井ハイテック	9,000	1,163.00	10,467,000
新光電気工業	25,200	1,275.00	32,130,000
京セラ	105,200	5,953.00	626,255,600

太陽誘電	33,100	2,866.00	94,864,600	
村田製作所	219,900	5,783.00	1,271,681,700	
双葉電子工業	12,300	1,035.00	12,730,500	
北陸電気工業	4,900	935.00	4,581,500	
ニチコン	26,600	666.00	17,715,600	
日本ケミコン	6,500	1,131.00	7,351,500	
K O A	11,900	888.00	10,567,200	
市光工業	12,000	451.00	5,412,000	
小糸製作所	44,400	3,855.00	171,162,000	
ミツバ	14,400	428.00	6,163,200	
S C R E E Nホールディングス	13,200	4,900.00	64,680,000	
キャノン電子	8,100	1,569.00	12,708,900	
キャノン	402,700	2,219.00	893,591,300	
リコー	190,200	720.00	136,944,000	
象印マホービン	22,400	1,537.00	34,428,800	
東京エレクトロン	47,500	21,885.00	1,039,537,500	
トヨタ紡織	22,100	1,293.00	28,575,300	
ユニプレス	14,900	917.00	13,663,300	
豊田自動織機	60,200	5,270.00	317,254,000	
モリタホールディングス	13,600	1,629.00	22,154,400	
三櫻工業	10,700	666.00	7,126,200	
デンソー	164,800	3,668.00	604,486,400	
東海理化電機製作所	19,500	1,335.00	26,032,500	
川崎重工業	58,400	1,555.00	90,812,000	
名村造船所	29,600	179.00	5,298,400	
日本車輛製造	3,300	2,713.00	8,952,900	
三菱ロジスネクスト	10,700	946.00	10,122,200	
日産自動車	885,400	360.50	319,186,700	
いすゞ自動車	219,600	757.40	166,325,040	
トヨタ自動車	835,800	6,659.00	5,565,592,200	代用有価証券 400,000株
日野自動車	95,100	600.00	57,060,000	
三菱自動車工業	279,100	294.00	82,055,400	
エフテック	7,600	452.00	3,435,200	
武蔵精密工業	17,300	836.00	14,462,800	
日産車体	15,300	845.00	12,928,500	
新明和工業	20,400	1,079.00	22,011,600	
極東開発工業	13,900	1,295.00	18,000,500	
日信工業	15,700	2,214.00	34,759,800	
トピー工業	6,800	1,238.00	8,418,400	
ティラド	4,100	1,305.00	5,350,500	
タチエス	12,300	947.00	11,648,100	
N O K	41,100	1,218.00	50,059,800	

フタバ産業	21,700	497.00	10,784,900
K Y B	8,300	2,061.00	17,106,300
大同メタル工業	17,200	529.00	9,098,800
プレス工業	42,100	252.00	10,609,200
太平洋工業	16,300	875.00	14,262,500
ケーヒン	17,700	2,563.00	45,365,100
河西工業	11,400	494.00	5,631,600
アイシン精機	61,500	2,877.00	176,935,500
マツダ	219,800	578.00	127,044,400
今仙電機製作所	10,000	730.00	7,300,000
本田技研工業	589,200	2,533.50	1,492,738,200
スズキ	149,100	3,123.00	465,639,300
S U B A R U	233,100	2,072.50	483,099,750
安永	4,500	959.00	4,315,500
ヤマハ発動機	97,000	1,318.00	127,846,000
ショーワ	17,900	2,260.00	40,454,000
T B K	13,100	467.00	6,117,700
エクセディ	10,200	1,646.00	16,789,200
豊田合成	24,500	1,898.00	46,501,000
愛三工業	14,100	547.00	7,712,700
日本プラスト	8,800	418.00	3,678,400
ヨロズ	8,200	1,096.00	8,987,200
エフ・シー・シー	12,500	1,446.00	18,075,000
シマノ	28,000	16,020.00	448,560,000
テイ・エス テック	17,500	2,796.00	48,930,000
ジャムコ	5,800	637.00	3,694,600
テルモ	212,200	3,610.00	766,042,000
日機装	22,800	807.00	18,399,600
日本エム・ディ・エム	5,200	1,530.00	7,956,000
島津製作所	88,900	2,722.00	241,985,800
J M S	8,300	803.00	6,664,900
長野計器	7,800	794.00	6,193,200
ブイ・テクノロジー	3,500	3,540.00	12,390,000
東京計器	6,400	747.00	4,780,800
インターアクション	4,400	2,375.00	10,450,000
東京精密	13,500	3,270.00	44,145,000
マニー	30,200	2,306.00	69,641,200
ニコン	121,300	974.00	118,146,200
トプコン	39,100	835.00	32,648,500
オリンパス	415,700	1,714.00	712,509,800
理研計器	6,400	2,060.00	13,184,000
タムロン	6,300	1,712.00	10,785,600

HOYA	149,700	9,920.00	1,485,024,000
ノーリツ銅機	5,600	1,169.00	6,546,400
エー・アンド・デイ	8,100	703.00	5,694,300
朝日インテック	63,800	2,802.00	178,767,600
シチズン時計	89,400	362.00	32,362,800
メニコン	10,400	4,855.00	50,492,000
松風	4,300	1,614.00	6,940,200
セイコーホールディングス	10,300	1,744.00	17,963,200
ニプロ	53,700	1,213.00	65,138,100
スノーピーク	6,200	728.00	4,513,600
パラマウントベッドホールディングス	7,900	4,480.00	35,392,000
トランザクション	6,000	967.00	5,802,000
ニホンフラッシュ	7,600	1,178.00	8,952,800
前田工織	8,400	1,978.00	16,615,200
永大産業	15,600	283.00	4,414,800
アートネイチャー	10,600	658.00	6,974,800
バンダイナムコホールディングス	77,600	5,426.00	421,057,600
SHOEI	7,600	2,030.00	15,428,000
フランスベッドホールディングス	10,300	866.00	8,919,800
パイロットコーポレーション	12,400	3,700.00	45,880,000
萩原工業	5,200	1,263.00	6,567,600
トッパン・フォームズ	16,000	993.00	15,888,000
フジシールインターナショナル	17,100	1,879.00	32,130,900
タカラトミー	34,500	833.00	28,738,500
廣済堂	7,600	769.00	5,844,400
プロネクサス	7,400	1,070.00	7,918,000
大建工業	5,500	1,613.00	8,871,500
凸版印刷	104,100	1,589.00	165,414,900
大日本印刷	97,700	2,293.00	224,026,100
共同印刷	2,900	2,796.00	8,108,400
NISSHA	14,600	753.00	10,993,800
TAKARA & COMPANY	4,500	1,794.00	8,073,000
アシックス	62,700	1,003.00	62,888,100
小松ウオール工業	3,100	1,780.00	5,518,000
ヤマハ	44,300	4,225.00	187,167,500
河合楽器製作所	2,800	2,559.00	7,165,200
クリナップ	9,300	523.00	4,863,900
ピジョン	45,500	3,915.00	178,132,500
オリバー	2,000	2,660.00	5,320,000
キングジム	8,200	861.00	7,060,200
リンテック	17,700	2,317.00	41,010,900
イトーキ	20,000	334.00	6,680,000

任天堂	45,900	46,840.00	2,149,956,000
三菱鉛筆	12,500	1,376.00	17,200,000
タカスタンダード	14,500	1,620.00	23,490,000
コクヨ	36,000	1,387.00	49,932,000
ナカバヤシ	9,900	545.00	5,395,500
グロープライド	4,000	1,698.00	6,792,000
オカムラ	26,000	784.00	20,384,000
美津濃	7,000	1,825.00	12,775,000
東京電力ホールディングス	592,600	365.00	216,299,000
中部電力	228,900	1,516.00	347,012,400
関西電力	284,100	1,146.00	325,578,600
中国電力	107,900	1,485.00	160,231,500
北陸電力	69,900	740.00	51,726,000
東北電力	184,600	1,054.00	194,568,400
四国電力	68,300	820.00	56,006,000
九州電力	153,200	876.00	134,203,200
北海道電力	70,500	405.00	28,552,500
沖縄電力	14,200	1,952.00	27,718,400
電源開発	59,100	2,156.00	127,419,600
イーレックス	11,200	1,451.00	16,251,200
レノバ	13,400	1,058.00	14,177,200
東京瓦斯	144,800	2,403.50	348,026,800
大阪瓦斯	144,500	2,068.00	298,826,000
東邦瓦斯	36,800	5,630.00	207,184,000
北海道瓦斯	5,600	1,572.00	8,803,200
広島ガス	22,700	365.00	8,285,500
西部瓦斯	8,600	2,670.00	22,962,000
静岡ガス	21,100	989.00	20,867,900
メタウォーター	3,900	4,090.00	15,951,000
SBSホールディングス	6,800	1,826.00	12,416,800
東武鉄道	78,200	3,675.00	287,385,000
相鉄ホールディングス	24,200	2,775.00	67,155,000
東急	187,500	1,632.00	306,000,000
京浜急行電鉄	95,700	1,826.00	174,748,200
小田急電鉄	110,500	2,430.00	268,515,000
京王電鉄	38,800	6,210.00	240,948,000
京成電鉄	51,900	3,125.00	162,187,500
富士急行	10,500	2,888.00	30,324,000
新京成電鉄	3,300	2,088.00	6,890,400
東日本旅客鉄道	131,800	8,237.00	1,085,636,600
西日本旅客鉄道	66,900	6,688.00	447,427,200
東海旅客鉄道	62,300	17,325.00	1,079,347,500

西武ホールディングス	100,900	1,251.00	126,225,900
鴻池運輸	11,500	1,155.00	13,282,500
西日本鉄道	21,000	2,649.00	55,629,000
ハマキョウレックス	5,800	2,862.00	16,599,600
サカイ引越センター	3,900	5,460.00	21,294,000
近鉄グループホールディングス	70,500	5,140.00	362,370,000
阪急阪神ホールディングス	93,900	3,720.00	349,308,000
南海電気鉄道	34,200	2,345.00	80,199,000
京阪ホールディングス	31,600	4,885.00	154,366,000
神戸電鉄	2,600	3,810.00	9,906,000
名古屋鉄道	57,800	3,115.00	180,047,000
山陽電気鉄道	6,000	2,070.00	12,420,000
日本通運	25,000	5,080.00	127,000,000
ヤマトホールディングス	124,700	1,883.00	234,810,100
山九	19,700	4,015.00	79,095,500
丸全昭和運輸	6,200	2,325.00	14,415,000
センコーグループホールディングス	38,800	859.00	33,329,200
トナミホールディングス	1,900	5,200.00	9,880,000
ニッコンホールディングス	25,300	2,039.00	51,586,700
福山通運	8,900	3,705.00	32,974,500
セイノーホールディングス	52,600	1,244.00	65,434,400
神奈川中央交通	2,300	3,940.00	9,062,000
日立物流	13,000	2,520.00	32,760,000
丸和運輸機関	7,400	3,275.00	24,235,000
C & F ロジホールディングス	8,200	1,351.00	11,078,200
九州旅客鉄道	62,400	2,925.00	182,520,000
S Gホールディングス	74,700	3,035.00	226,714,500
日本郵船	60,200	1,435.00	86,387,000
商船三井	45,100	1,871.00	84,382,100
川崎汽船	12,800	1,041.00	13,324,800
N S ユナイテッド海運	5,000	1,426.00	7,130,000
飯野海運	38,200	323.00	12,338,600
乾汽船	6,100	1,181.00	7,204,100
日本航空	128,300	1,872.50	240,241,750
A N A ホールディングス	130,300	2,365.50	308,224,650
トランコム	2,100	7,050.00	14,805,000
日新	6,200	1,597.00	9,901,400
三菱倉庫	23,100	2,333.00	53,892,300
三井倉庫ホールディングス	8,700	1,478.00	12,858,600
住友倉庫	25,100	1,234.00	30,973,400
澁澤倉庫	4,900	2,200.00	10,780,000
東陽倉庫	20,900	327.00	6,834,300

日本トランスシティ	18,500	499.00	9,231,500
川西倉庫	4,000	984.00	3,936,000
安田倉庫	8,000	867.00	6,936,000
東洋埠頭	4,900	1,320.00	6,468,000
上組	39,000	1,866.00	72,774,000
近鉄エクスプレス	14,800	1,531.00	22,658,800
エーアイティー	8,200	725.00	5,945,000
日本コンセプト	3,700	1,410.00	5,217,000
N E C ネットエスアイ	7,000	4,580.00	32,060,000
システナ	26,000	1,439.00	37,414,000
デジタルアーツ	3,800	6,410.00	24,358,000
日鉄ソリューションズ	11,000	2,847.00	31,317,000
キューブシステム	7,700	669.00	5,151,300
コア	4,100	1,227.00	5,030,700
ソリトンシステムズ	4,200	1,307.00	5,489,400
ソフトクリエイトホールディングス	4,100	1,876.00	7,691,600
T I S	73,600	2,011.00	148,009,600
電算システム	3,800	2,416.00	9,180,800
グリー	47,600	413.00	19,658,800
コーエーテクモホールディングス	14,900	2,825.00	42,092,500
三菱総合研究所	3,300	3,610.00	11,913,000
ファインデックス	8,200	855.00	7,011,000
ブレインパッド	2,100	5,120.00	10,752,000
K L a b	15,500	739.00	11,454,500
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	10,600	862.00	9,137,200
ネクソン	205,300	1,765.00	362,354,500
エムアップホールディングス	2,500	2,429.00	6,072,500
エイチーム	7,800	688.00	5,366,400
エニグモ	6,600	902.00	5,953,200
コロプラ	25,100	894.00	22,439,400
ブロードリーフ	39,000	487.00	18,993,000
デジタルハーツホールディングス	6,100	752.00	4,587,200
システム情報	5,000	815.00	4,075,000
メディアドゥホールディングス	2,800	4,005.00	11,214,000
じげん	22,900	300.00	6,870,000
ブイキューブ	5,300	1,267.00	6,715,100
フィックスターズ	9,300	1,023.00	9,513,900
C A R T A H O L D I N G S	5,300	806.00	4,271,800
オブティム	4,700	2,261.00	10,626,700
セレス	4,000	758.00	3,032,000
S H I F T	2,000	9,100.00	18,200,000
ティーガイア	6,400	2,089.00	13,369,600

セック	1,600	3,015.00	4,824,000
テクマトリックス	5,500	2,698.00	14,839,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,100	1,680.00	30,408,000
GMOペイメントゲートウェイ	12,200	9,530.00	116,266,000
システムリサーチ	2,900	1,500.00	4,350,000
インターネットイニシアティブ	11,200	3,835.00	42,952,000
さくらインターネット	10,600	644.00	6,826,400
GMOクラウド	1,900	2,895.00	5,500,500
SRAホールディングス	4,400	2,173.00	9,561,200
eBASE	9,800	1,059.00	10,378,200
アバント	6,200	894.00	5,542,800
アドソル日進	3,200	2,381.00	7,619,200
フリービット	5,500	732.00	4,026,000
コムチュア	8,300	2,263.00	18,782,900
アステリア	8,900	457.00	4,067,300
マークライنز	4,800	1,732.00	8,313,600
メディカル・データ・ビジョン	7,400	775.00	5,735,000
gumi	10,900	664.00	7,237,600
モバイルファクトリー	2,700	933.00	2,519,100
テラスカイ	3,000	2,468.00	7,404,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,278.00	5,751,000
ダブルスタンダード	1,300	3,990.00	5,187,000
オープンドア	5,300	907.00	4,807,100
アカツキ	2,800	4,000.00	11,200,000
Ubicomホールディングス	2,600	1,245.00	3,237,000
LINE	16,800	5,280.00	88,704,000
チェンジ	1,800	4,085.00	7,353,000
オークネット	6,400	1,090.00	6,976,000
AOI TYO Holdings	9,500	423.00	4,018,500
マクロミル	16,900	654.00	11,052,600
オロ	2,300	3,050.00	7,015,000
サインポスト	1,800	1,385.00	2,493,000
ソルクシーズ	4,700	593.00	2,787,100
プロトコーポレーション	8,400	878.00	7,375,200
野村総合研究所	104,000	2,604.00	270,816,000
サイバネットシステム	8,000	623.00	4,984,000
インテージホールディングス	11,100	747.00	8,291,700
ソースネクスト	38,700	307.00	11,880,900
インフォコム	8,200	2,583.00	21,180,600
HEROZ	900	3,570.00	3,213,000
ラクスル	4,400	2,411.00	10,608,400
アルテリア・ネットワークス	8,500	2,204.00	18,734,000

フォーカスシステムズ	6,600	797.00	5,260,200
クレスコ	5,500	1,333.00	7,331,500
フジ・メディア・ホールディングス	70,800	1,053.00	74,552,400
オービック	25,500	16,300.00	415,650,000
ジャストシステム	11,900	6,470.00	76,993,000
TDCソフト	7,400	838.00	6,201,200
Zホールディングス	1,011,800	415.00	419,897,000
トレンドマイクロ	32,800	5,390.00	176,792,000
IDホールディングス	3,900	1,427.00	5,565,300
日本オラクル	14,900	11,140.00	165,986,000
アルファシステムズ	2,700	3,000.00	8,100,000
フューチャー	9,100	1,520.00	13,832,000
CAC Holdings	6,100	1,080.00	6,588,000
SBテクノロジー	3,000	2,664.00	7,992,000
オービックビジネスコンサルタント	7,500	4,860.00	36,450,000
伊藤忠テクノソリューションズ	33,300	3,325.00	110,722,500
アイティフォー	10,900	642.00	6,997,800
大塚商会	39,600	4,925.00	195,030,000
サイボウズ	9,300	2,048.00	19,046,400
ソフトブレーン	6,800	446.00	3,032,800
電通国際情報サービス	4,400	4,200.00	18,480,000
デジタルガレージ	13,600	3,790.00	51,544,000
EMシステムズ	11,600	839.00	9,732,400
ウェザーニューズ	3,100	3,550.00	11,005,000
CIJ	7,500	798.00	5,985,000
WOWOW	3,800	2,510.00	9,538,000
スカラ	8,400	495.00	4,158,000
IMAGICA GROUP	8,700	350.00	3,045,000
ネットワンシステムズ	28,400	3,045.00	86,478,000
アルゴグラフィックス	6,000	3,375.00	20,250,000
マーベラス	14,900	522.00	7,777,800
エイベックス	13,500	795.00	10,732,500
日本ユニシス	23,300	3,040.00	70,832,000
兼松エレクトロニクス	4,000	3,430.00	13,720,000
東京放送ホールディングス	44,800	1,632.00	73,113,600
日本テレビホールディングス	61,300	1,190.00	72,947,000
朝日放送グループホールディングス	10,800	692.00	7,473,600
テレビ朝日ホールディングス	20,700	1,585.00	32,809,500
スカパーJSATホールディングス	49,700	401.00	19,929,700
テレビ東京ホールディングス	6,200	2,472.00	15,326,400
ビジョン	8,100	720.00	5,832,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,400	1,338.00	4,549,200

コネクシオ	4,800	1,480.00	7,104,000
日本通信	25,500	154.00	3,927,000
日本電信電話	981,600	2,522.00	2,475,595,200
K D D I	547,700	3,200.00	1,752,640,000
ソフトバンク	669,000	1,429.00	956,001,000
光通信	7,600	20,900.00	158,840,000
N T T ドコモ	542,400	3,286.00	1,782,326,400
エムティーアイ	10,300	545.00	5,613,500
G M O インターネット	29,500	2,334.00	68,853,000
K A D O K A W A	20,400	1,517.00	30,946,800
学研ホールディングス	10,000	1,743.00	17,430,000
ゼンリン	15,300	1,068.00	16,340,400
アイネット	4,700	1,500.00	7,050,000
松竹	4,900	11,390.00	55,811,000
東宝	43,500	3,395.00	147,682,500
東映	2,800	13,250.00	37,100,000
エヌ・ティ・ティ・データ	194,700	1,053.00	205,019,100
ピー・シー・エー	1,500	3,350.00	5,025,000
D T S	15,900	1,941.00	30,861,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	4,530.00	142,695,000
シーイーシー	8,100	1,551.00	12,563,100
カプコン	35,000	3,335.00	116,725,000
ジャステック	6,400	1,139.00	7,289,600
S C S K	17,000	5,230.00	88,910,000
日本システムウエア	3,100	1,920.00	5,952,000
アイネス	7,800	1,399.00	10,912,200
T K C	6,100	5,030.00	30,683,000
富士ソフト	9,500	3,755.00	35,672,500
N S D	23,900	1,513.00	36,160,700
コナミホールディングス	26,800	3,370.00	90,316,000
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,880.00	10,368,000
J B C C ホールディングス	5,800	1,865.00	10,817,000
ミロク情報サービス	6,700	2,656.00	17,795,200
ソフトバンクグループ	583,200	4,592.00	2,678,054,400
伊藤忠食品	2,100	4,610.00	9,681,000
エレマテック	8,600	816.00	7,017,600
J A L U X	3,500	1,535.00	5,372,500
あらた	5,700	4,545.00	25,906,500
東京エレクトロン デバイス	3,400	2,361.00	8,027,400
フィールズ	10,500	324.00	3,402,000
双日	400,100	252.00	100,825,200
アルフレッサ ホールディングス	81,800	2,148.00	175,706,400

横浜冷凍	22,300	904.00	20,159,200
アルコニックス	8,700	1,106.00	9,622,200
神戸物産	25,600	5,340.00	136,704,000
あい ホールディングス	11,500	1,287.00	14,800,500
ダイワボウホールディングス	6,200	6,710.00	41,602,000
マクニカ・富士エレホールディングス	18,400	1,422.00	26,164,800
ラクト・ジャパン	3,000	3,440.00	10,320,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,700	1,103.00	16,214,100
八洲電機	8,800	825.00	7,260,000
レスターホールディングス	8,000	1,683.00	13,464,000
ジューテックホールディングス	3,200	1,007.00	3,222,400
T O K A Iホールディングス	38,400	950.00	36,480,000
三洋貿易	8,700	815.00	7,090,500
ウイン・パートナーズ	6,500	901.00	5,856,500
シップヘルスケアホールディングス	12,100	4,935.00	59,713,500
コメダホールディングス	16,000	1,590.00	25,440,000
小野建	7,500	1,122.00	8,415,000
佐島電機	7,300	818.00	5,971,400
伯東	5,700	957.00	5,454,900
コンドーテック	7,700	913.00	7,030,100
ナガイレーベン	11,200	2,644.00	29,612,800
三菱食品	7,400	2,769.00	20,490,600
松田産業	6,500	1,345.00	8,742,500
第一興商	11,500	3,070.00	35,305,000
メディバルホールディングス	79,000	2,070.00	163,530,000
S P K	5,400	1,300.00	7,020,000
萩原電気ホールディングス	3,300	2,026.00	6,685,800
アズワン	4,800	9,620.00	46,176,000
尾家産業	3,600	1,476.00	5,313,600
シモジマ	6,100	1,281.00	7,814,100
ドウシシャ	7,700	1,307.00	10,063,900
高速	5,500	1,518.00	8,349,000
ハピネット	7,300	1,071.00	7,818,300
日本ライフライン	21,900	1,217.00	26,652,300
マルカ	3,700	1,701.00	6,293,700
I D O M	22,200	429.00	9,523,800
進和	5,300	1,685.00	8,930,500
ダイトロン	3,900	1,463.00	5,705,700
シークス	10,100	846.00	8,544,600
オーハシテクニカ	5,700	1,415.00	8,065,500
伊藤忠商事	514,700	2,160.00	1,111,752,000
丸紅	769,100	516.80	397,470,880

長瀬産業	41,000	1,285.00	52,685,000
蝶理	5,100	1,638.00	8,353,800
豊田通商	81,400	2,468.00	200,895,200
三共生興	16,400	461.00	7,560,400
兼松	26,500	1,028.00	27,242,000
三井物産	646,800	1,500.00	970,200,000
日本紙パルプ商事	4,400	3,595.00	15,818,000
カメイ	9,500	1,040.00	9,880,000
スターゼン	2,900	4,380.00	12,702,000
山善	26,900	914.00	24,586,600
椿本興業	1,700	3,090.00	5,253,000
住友商事	464,900	1,221.50	567,875,350
内田洋行	3,500	4,670.00	16,345,000
三菱商事	516,900	2,229.50	1,152,428,550
第一実業	3,800	3,640.00	13,832,000
キャノンマーケティングジャパン	21,400	2,040.00	43,656,000
西華産業	6,200	1,125.00	6,975,000
佐藤商事	7,700	793.00	6,106,100
菱洋エレクトロ	7,800	2,458.00	19,172,400
東京産業	9,700	487.00	4,723,900
ユアサ商事	6,500	2,919.00	18,973,500
神鋼商事	2,400	1,784.00	4,281,600
阪和興業	13,900	1,647.00	22,893,300
正栄食品工業	4,900	3,815.00	18,693,500
カナデン	7,400	1,252.00	9,264,800
菱電商事	6,500	1,329.00	8,638,500
フルサト工業	5,000	1,391.00	6,955,000
岩谷産業	17,000	3,695.00	62,815,000
極東貿易	3,200	1,370.00	4,384,000
イワキ	12,900	433.00	5,585,700
三愛石油	17,800	1,092.00	19,437,600
稲畑産業	14,900	1,198.00	17,850,200
明和産業	9,000	492.00	4,428,000
ワキタ	16,600	1,000.00	16,600,000
東邦ホールディングス	23,900	2,225.00	53,177,500
サンゲツ	20,200	1,621.00	32,744,200
ミツウロコグループホールディングス	11,700	1,112.00	13,010,400
シナネンホールディングス	3,800	2,781.00	10,567,800
伊藤忠エネクス	16,100	782.00	12,590,200
サンリオ	22,400	1,560.00	34,944,000
サンワテクノス	6,800	819.00	5,569,200
リョーサン	8,300	2,300.00	19,090,000

新光商事	13,600	884.00	12,022,400
トーヨー	5,100	1,763.00	8,991,300
三信電気	5,400	1,462.00	7,894,800
東陽テクニカ	10,400	1,011.00	10,514,400
モスフードサービス	10,100	2,688.00	27,148,800
加賀電子	7,700	1,885.00	14,514,500
ソーダニッカ	10,500	584.00	6,132,000
立花エレテック	6,000	1,456.00	8,736,000
PALTAC	11,900	5,620.00	66,878,000
太平洋興発	6,600	587.00	3,874,200
西本Wismettacホールディングス	2,000	1,786.00	3,572,000
国際紙パルプ商事	22,900	314.00	7,190,600
ヤマタネ	6,500	1,195.00	7,767,500
日鉄物産	4,700	3,220.00	15,134,000
泉州電業	3,100	2,487.00	7,709,700
トラスコ中山	15,200	2,300.00	34,960,000
オートバックスセブン	29,600	1,266.00	37,473,600
モリト	9,300	665.00	6,184,500
加藤産業	11,100	3,600.00	39,960,000
イノテック	6,000	852.00	5,112,000
イエローハット	14,200	1,443.00	20,490,600
J Kホールディングス	8,700	739.00	6,429,300
日伝	7,000	2,038.00	14,266,000
杉本商事	4,900	1,782.00	8,731,800
因幡電機産業	20,600	2,269.00	46,741,400
東テク	3,100	1,905.00	5,905,500
ミスミグループ本社	92,400	2,535.00	234,234,000
タキヒヨー	4,000	1,640.00	6,560,000
スズケン	31,500	3,945.00	124,267,500
ジェコス	7,200	873.00	6,285,600
ローソン	18,800	5,790.00	108,852,000
サンエー	5,900	4,450.00	26,255,000
カワチ薬品	5,800	2,609.00	15,132,200
エービーシー・マート	11,500	5,330.00	61,295,000
アスクル	7,800	3,340.00	26,052,000
ゲオホールディングス	13,000	1,446.00	18,798,000
アダストリア	10,600	1,443.00	15,295,800
くら寿司	3,900	4,020.00	15,678,000
キャンドゥ	5,000	1,895.00	9,475,000
パルグループホールディングス	8,200	1,180.00	9,676,000
エディオン	32,500	918.00	29,835,000
サーラコーポレーション	16,400	573.00	9,397,200

ハローズ	2,900	3,030.00	8,787,000
フジオフードシステム	7,700	1,258.00	9,686,600
あみやき亭	2,300	2,783.00	6,400,900
ひらまつ	22,900	142.00	3,251,800
大黒天物産	2,200	4,430.00	9,746,000
ハニーズホールディングス	7,300	1,064.00	7,767,200
アルペン	6,700	1,596.00	10,693,200
クオールホールディングス	11,400	1,164.00	13,269,600
ジーンズホールディングス	4,000	5,380.00	21,520,000
ビックカメラ	42,300	975.00	41,242,500
D C Mホールディングス	40,200	1,038.00	41,727,600
Monotaro	52,600	3,425.00	180,155,000
DDホールディングス	4,200	750.00	3,150,000
アークランドサービスホールディングス	6,300	1,580.00	9,954,000
J . フロント リテイリング	87,800	890.00	78,142,000
ドトール・日レスホールディングス	10,900	1,592.00	17,352,800
マツモトキヨシホールディングス	30,100	3,670.00	110,467,000
ブロンコビリー	4,300	2,023.00	8,698,900
Z O Z O	51,400	1,695.00	87,123,000
物語コーポレーション	2,000	6,050.00	12,100,000
ココカラファイン	7,700	5,090.00	39,193,000
三越伊勢丹ホールディングス	129,400	660.00	85,404,000
Hamee	3,600	1,240.00	4,464,000
ウエルシアホールディングス	21,900	8,560.00	187,464,000
クリエイティブSDホールディングス	12,100	3,245.00	39,264,500
チムニー	3,300	1,568.00	5,174,400
シュッピン	7,100	685.00	4,863,500
ネクステージ	11,100	660.00	7,326,000
ジョイフル本田	21,300	1,289.00	27,455,700
鳥貴族	3,200	1,469.00	4,700,800
麒麟堂ホールディングス	3,600	2,159.00	7,772,400
ホットランド	6,500	984.00	6,396,000
すかいらーくホールディングス	82,900	1,569.00	130,070,100
S F Pホールディングス	4,300	1,360.00	5,848,000
綿半ホールディングス	3,400	1,692.00	5,752,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,000	1,074.00	21,480,000
B E E N O S	3,900	846.00	3,299,400
あさひ	6,200	1,270.00	7,874,000
日本調剤	5,300	1,682.00	8,914,600
コスモス薬品	3,300	30,150.00	99,495,000
セブン&アイ・ホールディングス	288,600	3,611.00	1,042,134,600

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,100	539.00	21,613,900
ツルハホールディングス	16,000	14,700.00	235,200,000
サンマルクホールディングス	5,700	1,758.00	10,020,600
トリドールホールディングス	18,800	1,193.00	22,428,400
TOKYO BASE	9,800	267.00	2,616,600
JMホールディングス	4,200	2,676.00	11,239,200
バロックジャパンリミテッド	7,400	562.00	4,158,800
クスリのアオキホールディングス	6,700	8,760.00	58,692,000
力の源ホールディングス	4,500	582.00	2,619,000
スシログローバルホールディングス	32,400	1,605.00	52,002,000
LIXILピバ	7,400	1,856.00	13,734,400
メディカルシステムネットワーク	9,200	472.00	4,342,400
ノジマ	12,800	1,847.00	23,641,600
カッパ・クリエイト	9,800	1,303.00	12,769,400
良品計画	98,200	1,194.00	117,250,800
アドヴァン	12,200	1,072.00	13,078,400
アルビス	3,600	2,160.00	7,776,000
コナカ	18,000	326.00	5,868,000
G-7ホールディングス	4,400	2,357.00	10,370,800
イオン北海道	11,900	749.00	8,913,100
コジマ	16,100	380.00	6,118,000
コーナン商事	9,800	2,444.00	23,951,200
エコス	3,200	2,120.00	6,784,000
ワタミ	10,100	996.00	10,059,600
パン・パシフィック・インターナショナルホ	162,300	2,069.00	335,798,700
西松屋チェーン	16,700	841.00	14,044,700
ゼンショーホールディングス	35,800	2,075.00	74,285,000
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,434.00	8,747,400
サイゼリヤ	12,200	2,065.00	25,193,000
VTホールディングス	32,700	299.00	9,777,300
フジ・コーポレーション	3,000	1,658.00	4,974,000
ユナイテッドアローズ	8,000	1,669.00	13,352,000
ハイデイ日高	10,100	1,588.00	16,038,800
コロワイド	25,200	1,381.00	34,801,200
ピーシーデポコーポレーション	13,100	531.00	6,956,100
壱番屋	5,300	4,295.00	22,763,500
スギホールディングス	14,800	6,340.00	93,832,000
薬王堂ホールディングス	3,500	2,668.00	9,338,000
ヴィア・ホールディングス	13,700	428.00	5,863,600
スクロール	15,800	310.00	4,898,000
ヨンドシーホールディングス	7,800	1,738.00	13,556,400
ファミリーマート	59,200	1,819.00	107,684,800

木曽路	9,300	2,361.00	21,957,300
S R S ホールディングス	11,200	834.00	9,340,800
千趣会	17,800	391.00	6,959,800
ケーヨー	19,400	549.00	10,650,600
上新電機	8,100	2,055.00	16,645,500
日本瓦斯	11,900	3,620.00	43,078,000
ロイヤルホールディングス	12,400	1,700.00	21,080,000
いなげや	9,200	1,614.00	14,848,800
島忠	14,000	2,680.00	37,520,000
チヨダ	9,200	1,043.00	9,595,600
ライフコーポレーション	5,600	3,530.00	19,768,000
リンガーハット	9,100	2,090.00	19,019,000
Mr M a x H D	12,500	425.00	5,312,500
A O K I ホールディングス	14,900	648.00	9,655,200
オークワ	11,400	1,454.00	16,575,600
コメリ	11,300	2,070.00	23,391,000
青山商事	15,200	871.00	13,239,200
しまむら	8,500	6,770.00	57,545,000
高島屋	54,500	966.00	52,647,000
松屋	16,800	630.00	10,584,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,000	831.00	29,085,000
近鉄百貨店	3,000	2,528.00	7,584,000
丸井グループ	68,000	1,697.00	115,396,000
アクシアル リテイリング	6,000	4,170.00	25,020,000
イオン	283,300	2,159.50	611,786,350
イズミ	15,100	3,025.00	45,677,500
平和堂	14,300	1,826.00	26,111,800
フジ	8,600	1,690.00	14,534,000
ヤオコー	8,100	6,700.00	54,270,000
ゼビオホールディングス	10,100	893.00	9,019,300
ケーズホールディングス	70,700	1,165.00	82,365,500
O l y m p i c グループ	6,800	663.00	4,508,400
日産東京販売ホールディングス	18,400	208.00	3,827,200
Genky DrugStores	3,700	2,584.00	9,560,800
ブックオフグループホールディングス	5,900	799.00	4,714,100
アインホールディングス	9,300	5,720.00	53,196,000
元気寿司	2,500	2,259.00	5,647,500
ヤマダ電機	224,700	514.00	115,495,800
アーランドサカモト	11,500	975.00	11,212,500
ニトリホールディングス	32,000	16,570.00	530,240,000
グルメ杵屋	7,900	884.00	6,983,600
吉野家ホールディングス	24,300	2,271.00	55,185,300

松屋フーズホールディングス	3,500	3,785.00	13,247,500
サガミホールディングス	10,000	1,229.00	12,290,000
関西スーパーマーケット	7,200	1,106.00	7,963,200
王将フードサービス	5,300	5,610.00	29,733,000
プレナス	8,300	1,799.00	14,931,700
ミニストップ	6,500	1,460.00	9,490,000
アークス	14,300	2,037.00	29,129,100
パローホールディングス	15,600	2,015.00	31,434,000
ベルク	3,700	6,410.00	23,717,000
大庄	5,400	1,137.00	6,139,800
ファーストリテイリング	9,900	48,980.00	484,902,000
サンドラッグ	27,700	3,665.00	101,520,500
サックスパー ホールディングス	8,900	549.00	4,886,100
ベルーナ	17,200	491.00	8,445,200
じもとホールディングス	54,900	96.00	5,270,400
めぶきフィナンシャルグループ	382,600	231.00	88,380,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,063.00	10,630,000
九州フィナンシャルグループ	121,500	461.00	56,011,500
ゆうちょ銀行	210,000	996.00	209,160,000
富山第一銀行	17,000	271.00	4,607,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	435,200	322.00	140,134,400
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	608.00	30,764,800
関西みらいフィナンシャルグループ	45,400	357.00	16,207,800
三十三フィナンシャルグループ	6,700	1,508.00	10,103,600
第四北越フィナンシャルグループ	12,800	2,312.00	29,593,600
新生銀行	54,300	1,340.00	72,762,000
あおぞら銀行	44,300	1,921.00	85,100,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,052,300	423.50	2,139,649,050
りそなホールディングス	808,800	331.10	267,793,680
三井住友トラスト・ホールディングス	139,500	3,165.00	441,517,500
三井住友フィナンシャルグループ	511,000	2,755.50	1,408,060,500
千葉銀行	246,000	501.00	123,246,000
群馬銀行	144,800	337.00	48,797,600
武蔵野銀行	10,900	1,322.00	14,409,800
千葉興業銀行	20,200	236.00	4,767,200
筑波銀行	30,900	167.00	5,160,300
七十七銀行	25,000	1,414.00	35,350,000
青森銀行	5,600	2,252.00	12,611,200
秋田銀行	5,400	1,440.00	7,776,000
山形銀行	8,200	1,293.00	10,602,600
岩手銀行	4,800	2,600.00	12,480,000
東邦銀行	68,300	260.00	17,758,000

東北銀行	4,000	874.00	3,496,000
みちのく銀行	5,500	1,118.00	6,149,000
ふくおかフィナンシャルグループ	61,300	1,464.00	89,743,200
静岡銀行	183,400	645.00	118,293,000
十六銀行	9,300	1,944.00	18,079,200
スルガ銀行	76,700	368.00	28,225,600
八十二銀行	176,000	388.00	68,288,000
山梨中央銀行	9,200	783.00	7,203,600
大垣共立銀行	14,600	2,217.00	32,368,200
福井銀行	6,200	1,555.00	9,641,000
北國銀行	7,800	3,200.00	24,960,000
清水銀行	3,400	1,800.00	6,120,000
富山銀行	1,600	2,078.00	3,324,800
滋賀銀行	14,700	2,553.00	37,529,100
南都銀行	12,700	2,299.00	29,197,300
百五銀行	69,000	314.00	21,666,000
京都銀行	26,100	3,705.00	96,700,500
紀陽銀行	26,600	1,626.00	43,251,600
ほくほくフィナンシャルグループ	49,300	875.00	43,137,500
広島銀行	107,900	441.00	47,583,900
山陰合同銀行	44,200	579.00	25,591,800
中国銀行	63,300	1,005.00	63,616,500
伊予銀行	104,400	581.00	60,656,400
百十四銀行	7,900	1,988.00	15,705,200
四国銀行	11,600	859.00	9,964,400
阿波銀行	12,200	2,363.00	28,828,600
大分銀行	4,800	2,084.00	10,003,200
宮崎銀行	4,900	2,390.00	11,711,000
佐賀銀行	4,600	1,091.00	5,018,600
沖縄銀行	7,100	3,205.00	22,755,500
琉球銀行	17,800	998.00	17,764,400
セブン銀行	249,900	297.00	74,220,300
みずほフィナンシャルグループ	10,040,200	123.60	1,240,968,720
山口フィナンシャルグループ	93,000	576.00	53,568,000
名古屋銀行	6,000	2,175.00	13,050,000
北洋銀行	116,000	195.00	22,620,000
愛知銀行	2,600	3,135.00	8,151,000
中京銀行	3,000	2,076.00	6,228,000
大光銀行	2,500	1,392.00	3,480,000
愛媛銀行	10,400	1,116.00	11,606,400
京葉銀行	31,000	535.00	16,585,000
栃木銀行	42,700	154.00	6,575,800

北日本銀行	2,700	1,883.00	5,084,100
東和銀行	14,200	669.00	9,499,800
トモニホールディングス	59,400	359.00	21,324,600
フィデアホールディングス	75,000	105.00	7,875,000
池田泉州ホールディングス	89,000	165.00	14,685,000
F P G	24,100	463.00	11,158,300
S B I ホールディングス	82,500	1,821.00	150,232,500
ジャフコ	11,700	3,200.00	37,440,000
大和証券グループ本社	592,000	431.90	255,684,800
野村ホールディングス	1,301,500	430.20	559,905,300
岡三証券グループ	65,600	327.00	21,451,200
丸三証券	26,400	414.00	10,929,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,500	235.00	20,797,500
水戸証券	26,500	184.00	4,876,000
いちよし証券	15,600	432.00	6,739,200
松井証券	42,900	794.00	34,062,600
マネックスグループ	40,400	200.00	8,080,000
極東証券	13,900	515.00	7,158,500
岩井コスモホールディングス	8,000	916.00	7,328,000
藍澤証券	14,500	708.00	10,266,000
スパークス・グループ	32,600	178.00	5,802,800
かんぽ生命保険	27,000	1,349.00	36,423,000
S O M P O ホールディングス	138,700	3,500.00	485,450,000
アニコム ホールディングス	6,000	4,120.00	24,720,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	192,900	3,096.00	597,218,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,600	1,975.00	119,685,000
第一生命ホールディングス	417,300	1,323.50	552,296,550
東京海上ホールディングス	264,200	5,025.00	1,327,605,000
T & D ホールディングス	221,500	897.00	198,685,500
アドバンスクリエイト	2,600	1,892.00	4,919,200
全国保証	21,200	2,964.00	62,836,800
日本モーゲージサービス	2,200	1,447.00	3,183,400
C a s a	3,000	1,073.00	3,219,000
アルヒ	12,100	1,190.00	14,399,000
プレミアグループ	4,400	1,623.00	7,141,200
クレディセゾン	51,200	1,178.00	60,313,600
芙蓉総合リース	7,800	5,280.00	41,184,000
みずほリース	11,900	2,061.00	24,525,900
東京センチュリー	14,700	3,495.00	51,376,500
日本証券金融	31,600	502.00	15,863,200
アイフル	112,300	221.00	24,818,300
リコーリース	6,000	2,866.00	17,196,000

イオンフィナンシャルサービス	44,600	1,054.00	47,008,400
アコム	148,800	440.00	65,472,000
ジャックス	8,500	1,718.00	14,603,000
オリエントコーポレーション	209,500	122.00	25,559,000
日立キャピタル	17,600	2,008.00	35,340,800
アプラスフィナンシャル	45,700	61.00	2,787,700
オリックス	462,000	1,216.50	562,023,000
三菱UFJリース	185,400	501.00	92,885,400
日本取引所グループ	212,000	2,122.00	449,864,000
イー・ギャランティ	8,500	1,923.00	16,345,500
NECキャピタルソリューション	3,000	1,924.00	5,772,000
いちご	98,200	259.00	25,433,800
日本駐車場開発	99,200	127.00	12,598,400
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,420.00	6,816,000
ヒューリック	158,800	1,057.00	167,851,600
三栄建築設計	3,800	1,171.00	4,449,800
野村不動産ホールディングス	44,800	1,715.00	76,832,000
三重交通グループホールディングス	19,400	471.00	9,137,400
サムティ	9,900	1,362.00	13,483,800
ディア・ライフ	14,300	403.00	5,762,900
日本商業開発	6,100	1,362.00	8,308,200
プレサンスコーポレーション	14,100	1,072.00	15,115,200
ユニゾホールディングス	11,400	5,980.00	68,172,000
日本管理センター	7,000	1,050.00	7,350,000
フージャースホールディングス	17,600	608.00	10,700,800
オープンハウス	21,700	2,217.00	48,108,900
東急不動産ホールディングス	201,200	512.00	103,014,400
飯田グループホールディングス	61,100	1,412.00	86,273,200
ムゲンエステート	10,200	458.00	4,671,600
ビーロッド	5,700	594.00	3,385,800
ハウズドゥ	4,700	748.00	3,515,600
ジェイ・エス・ビー	1,200	4,800.00	5,760,000
パーク24	39,400	1,573.00	61,976,200
パラカ	3,100	1,560.00	4,836,000
三井不動産	364,600	1,955.50	712,975,300
三菱地所	518,000	1,712.50	887,075,000
平和不動産	14,100	2,807.00	39,578,700
東京建物	78,300	1,170.00	91,611,000
ダイビル	20,700	903.00	18,692,100
京阪神ビルディング	13,600	1,403.00	19,080,800
住友不動産	166,400	2,889.50	480,812,800
テーオーシー	18,000	662.00	11,916,000

東京楽天地	1,700	4,100.00	6,970,000
スターツコーポレーション	9,400	2,056.00	19,326,400
フジ住宅	11,800	489.00	5,770,200
空港施設	13,300	424.00	5,639,200
ゴールドクレスト	6,900	1,623.00	11,198,700
エスリード	4,000	1,300.00	5,200,000
日神グループホールディングス	14,500	400.00	5,800,000
日本エスコン	14,400	628.00	9,043,200
タカラレーベン	37,200	351.00	13,057,200
A V A N T I A	7,000	640.00	4,480,000
イオンモール	37,600	1,326.00	49,857,600
ファースト住建	4,800	933.00	4,478,400
カチタス	18,600	1,697.00	31,564,200
トーセイ	12,000	994.00	11,928,000
サンフロンティア不動産	12,400	833.00	10,329,200
エフ・ジェー・ネクスト	7,600	804.00	6,110,400
ランドビジネス	7,400	291.00	2,153,400
日本空港ビルデング	23,800	3,995.00	95,081,000
日本工営	4,900	2,963.00	14,518,700
L I F U L L	29,500	309.00	9,115,500
ジェイエイシーリクルートメント	5,300	1,085.00	5,750,500
日本M & Aセンター	54,400	3,420.00	186,048,000
メンバーズ	2,700	1,410.00	3,807,000
UTグループ	8,600	1,356.00	11,661,600
タケエイ	8,600	773.00	6,647,800
ビーネックスグループ	10,800	632.00	6,825,600
コシダカホールディングス	19,800	420.00	8,316,000
パソナグループ	8,400	1,061.00	8,912,400
リンクアンドモチベーション	18,700	333.00	6,227,100
G C A	10,800	635.00	6,858,000
エス・エム・エス	22,800	2,217.00	50,547,600
パーソルホールディングス	71,800	1,120.00	80,416,000
リニカル	4,900	859.00	4,209,100
クックパッド	30,600	368.00	11,260,800
学情	3,400	1,115.00	3,791,000
スタジオアリス	5,100	1,410.00	7,191,000
シミックホールディングス	5,000	1,595.00	7,975,000
総合警備保障	28,300	5,400.00	152,820,000
カカクコム	53,200	2,178.00	115,869,600
アイロムグループ	3,500	1,317.00	4,609,500
ルネサンス	5,500	952.00	5,236,000
ディップ	10,200	2,075.00	21,165,000

オプトホールディング	4,500	1,428.00	6,426,000
新日本科学	9,300	642.00	5,970,600
ツクイ	19,600	432.00	8,467,200
ベネフィット・ワン	19,600	1,853.00	36,318,800
エムスリー	157,800	3,870.00	610,686,000
アウトソーシング	40,700	465.00	18,925,500
ウェルネット	11,700	487.00	5,697,900
ワールドホールディングス	2,900	1,298.00	3,764,200
ディー・エヌ・エー	36,400	1,326.00	48,266,400
博報堂D Yホールディングス	98,200	1,138.00	111,751,600
ぐるなび	15,500	532.00	8,246,000
タカミヤ	12,500	401.00	5,012,500
ジャパンベストレスキューシステム	6,500	704.00	4,576,000
ファンコミュニケーションズ	22,800	439.00	10,009,200
ライク	3,200	1,525.00	4,880,000
エスプール	15,500	707.00	10,958,500
WDBホールディングス	3,600	2,477.00	8,917,200
バリューコマース	4,400	1,998.00	8,791,200
インフォマート	80,000	726.00	58,080,000
J Pホールディングス	28,000	265.00	7,420,000
E P Sホールディングス	11,300	1,130.00	12,769,000
プレステージ・インターナショナル	27,100	852.00	23,089,200
アミューズ	4,400	2,188.00	9,627,200
ドリームインキュベータ	3,800	1,150.00	4,370,000
クイック	5,200	998.00	5,189,600
ケネディクス	69,600	477.00	33,199,200
電通グループ	73,800	2,106.00	155,422,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	565.00	2,203,500
ぴあ	2,200	2,876.00	6,327,200
イオンファンタジー	3,400	1,513.00	5,144,200
シーティーエス	9,700	539.00	5,228,300
ネクシィーズグループ	3,300	981.00	3,237,300
みらかホールディングス	20,600	2,340.00	48,204,000
アルプス技研	6,900	1,576.00	10,874,400
日本空調サービス	9,600	715.00	6,864,000
オリエンタルランド	76,100	14,095.00	1,072,629,500
ダスキン	18,200	2,793.00	50,832,600
明光ネットワークジャパン	11,900	743.00	8,841,700
ファルコホールディングス	5,000	1,657.00	8,285,000
ラウンドワン	21,200	796.00	16,875,200
リゾートトラスト	33,700	1,043.00	35,149,100
ビー・エム・エル	9,300	2,765.00	25,714,500

りらいあコミュニケーションズ	13,000	1,087.00	14,131,000
リソー教育	37,700	248.00	9,349,600
ユー・エス・エス	79,800	1,692.00	135,021,600
サイバーエージェント	41,400	4,430.00	183,402,000
楽天	334,500	917.00	306,736,500
クリーク・アンド・リバー社	5,000	896.00	4,480,000
テー・オー・ダブリュー	16,600	264.00	4,382,400
山田コンサルティンググループ	4,600	1,070.00	4,922,000
セントラルスポーツ	3,200	2,162.00	6,918,400
フルキャストホールディングス	7,300	1,280.00	9,344,000
エン・ジャパン	12,700	2,252.00	28,600,400
テクノプロ・ホールディングス	14,300	5,180.00	74,074,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	6,650.00	20,615,000
Gunosy	5,500	823.00	4,526,500
イー・ガーディアン	4,000	1,763.00	7,052,000
ジャパンマテリアル	21,700	1,537.00	33,352,900
ベクトル	10,100	730.00	7,373,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,900	819.00	5,651,100
I B J	6,700	624.00	4,180,800
アサンテ	4,300	1,424.00	6,123,200
N・フィールド	9,300	415.00	3,859,500
バリューHR	3,600	1,450.00	5,220,000
M&Aキャピタルパートナーズ	5,200	2,891.00	15,033,200
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,504.00	5,715,200
シグマクシス	5,500	1,493.00	8,211,500
ウィルグループ	5,600	608.00	3,404,800
リクルートホールディングス	512,400	2,937.50	1,505,175,000
エラン	4,600	1,732.00	7,967,200
日本郵政	586,600	856.90	502,657,540
ベルシステム24ホールディングス	12,500	1,234.00	15,425,000
鎌倉新書	6,100	1,020.00	6,222,000
LITALICO	3,000	2,183.00	6,549,000
アトラエ	2,200	2,737.00	6,021,400
ストライク	2,800	4,100.00	11,480,000
ソラスト	20,300	1,038.00	21,071,400
インソース	3,800	2,282.00	8,671,600
ベイカレント・コンサルティング	4,500	6,180.00	27,810,000
グレイステクノロジー	3,600	2,826.00	10,173,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	2,737.00	21,074,900
グリーンズ	5,200	408.00	2,121,600
日総工産	6,000	448.00	2,688,000
キュービーネットホールディングス	4,000	1,688.00	6,752,000

ＲＰＡホールディングス	4,800	744.00	3,571,200	
スプリックス	4,100	833.00	3,415,300	
カーブスホールディングス	18,600	465.00	8,649,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	782.00	4,613,800	
リログループ	39,400	2,239.00	88,216,600	
東祥	5,900	905.00	5,339,500	
エイチ・アイ・エス	11,400	1,303.00	14,854,200	
共立メンテナンス	11,800	2,383.00	28,119,400	
イチネンホールディングス	9,100	1,083.00	9,855,300	
建設技術研究所	5,500	1,747.00	9,608,500	
燦ホールディングス	4,400	1,310.00	5,764,000	
東京テアトル	4,700	1,191.00	5,597,700	
ナガワ	2,300	7,050.00	16,215,000	
よみうりランド	2,100	3,470.00	7,287,000	
東京都競馬	4,900	3,500.00	17,150,000	
カナモト	11,900	2,069.00	24,621,100	
東京ドーム	30,300	763.00	23,118,900	
西尾レントオール	6,900	2,113.00	14,579,700	
トランス・コスモス	7,100	2,156.00	15,307,600	
乃村工藝社	30,800	769.00	23,685,200	
藤田観光	4,100	1,679.00	6,883,900	
KNT - CTホールディングス	5,700	821.00	4,679,700	
日本管財	7,400	1,816.00	13,438,400	
トーカイ	6,900	2,882.00	19,885,800	
セコム	75,700	9,119.00	690,308,300	
セントラル警備保障	3,600	4,275.00	15,390,000	
丹青社	14,000	656.00	9,184,000	
メイテック	9,100	4,485.00	40,813,500	
応用地質	7,700	1,251.00	9,632,700	
船井総研ホールディングス	14,500	2,215.00	32,117,500	
オオバ	8,900	557.00	4,957,300	
ベネッセホールディングス	24,100	3,150.00	75,915,000	
イオンディライト	8,400	3,165.00	26,586,000	
ナック	6,000	839.00	5,034,000	
ニチイ学館	11,100	1,089.00	12,087,900	
ダイセキ	12,200	2,325.00	28,365,000	
合 計	87,507,700		152,354,149,040	

(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
----	----	------	-----	----

新株予約権証券	株式会社千葉興業銀行(ワラント)	27,200		
合計		27,200		

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位:円)	
	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	504,936,832	633,599,484
金銭信託	827,792,557	100,485,366
コール・ローン	267,424,520	103,015,575
株式	178,606,464,111	186,251,660,602
投資証券	4,394,088,058	4,618,495,180
派生商品評価勘定	27,245,209	27,953,556
未収入金	48,846,591	1,865,057,554
未収配当金	267,879,105	227,793,045
差入委託証拠金	1,096,617,753	1,118,430,587
流動資産合計	186,041,294,736	194,946,490,949
資産合計		
	186,041,294,736	194,946,490,949
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,286,862	9,203,874
前受金	22,998,847	17,362,275
未払金	11,682,025	54,739,686
未払解約金	992,052,101	1,290,294,992
未払利息	783	297
その他未払費用	23,083	41,742
流動負債合計	1,031,043,701	1,371,642,866
負債合計		
	1,031,043,701	1,371,642,866
純資産の部		
元本等		
元本	50,156,918,145	58,066,751,593
剰余金		
剰余金又は欠損金()	134,853,332,890	135,508,096,490
元本等合計	185,010,251,035	193,574,848,083
純資産合計		
	185,010,251,035	193,574,848,083
負債純資産合計		
	186,041,294,736	194,946,490,949

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	50,156,918,145口	58,066,751,593口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6886円 (10,000口当たりの純資産額 36,886円)	1口当たり純資産額 3.3337円 (10,000口当たりの純資産額 33,337円)

(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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,847,197,992	-	1,870,196,839	22,998,847
	SPMINI 1906	1,326,815,033	-	1,341,957,285	15,142,252
	DJ EUR 1906	317,818,264	-	323,761,140	5,942,876
	FTSE 1906	116,233,325	-	117,084,589	851,264
	SPI200 1906	86,331,370	-	87,393,825	1,062,455
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	122,280,500	-	122,321,000	40,500
	米ドル	89,360,000	-	89,384,000	24,000
	カナダドル	4,142,000	-	4,144,000	2,000
	ユーロ	24,864,000	-	24,876,000	12,000
	オーストラリアドル	3,914,500	-	3,917,000	2,500
合計		1,969,478,492	-	1,992,517,839	22,958,347

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(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 2019年 4月27日

至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	53,208,560,898円
同期中における追加設定元本額	12,569,281,751円
同期中における一部解約元本額	15,620,924,504円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC 外国株式インデックスファンドS	14,530,943,449円
三井住友・DC 年金バランス30 (債券重点型)	281,447,230円
三井住友・DC 年金バランス50 (標準型)	1,173,444,908円
三井住友・DC 年金バランス70 (株式重点型)	786,537,850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)	73,260,890円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	1,988,128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)	7,899,545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)	21,142,487円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	39,734,004円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	28,557,819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)	72,267,318円
外国株式指数ファンド	515,978,365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	3,283,561,242円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	509,858,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,067,966円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	492,485,334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)	14,280,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,985,108円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	56,285,291円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,652,516円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,909,723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)	1,742,054,495円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,619,538円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	76,749,837円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,554,318,707円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,493,601,415円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,319,455,272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>	103,737,458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>	758,296,083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>	60,125,135円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	175,645,387円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	775,699,406円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	658,649,408円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,587,648,005円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,104,987円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	409,339,094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)	601,436,192円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	135,732,381円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	28,425,171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)	720,253,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	23,722,444円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	12,876,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	6,622,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	44,693,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	111,349,288円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	111,277,275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>	1,090,156,776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>	152,693,007円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	6,115,998,283円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	278,956,079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 >	2,012,443,704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 >	7,865,987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 >	101,802,107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 >	48,744,796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 >	120,134,876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 >	147,153,141円
合計	50,156,918,145円

(2020年 4月27日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,156,918,145円
同期中における追加設定元本額	27,917,523,800円
同期中における一部解約元本額	20,007,690,352円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	25,451,218,551円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	354,132,894円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,402,748,729円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	898,409,075円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	67,502,372円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,062,158円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,137,497円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	23,861,394円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	50,148,540円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	42,133,260円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,012,458円
外国株式指数ファンド	558,034,519円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,826,411,908円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	243,195,509円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	245,763,764円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	180,873,346円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,810,021円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	63,308,584円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	50,183,200円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	158,005,784円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	76,905,157円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	92,680,407円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,402,638円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	11,277,567円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	218,126円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	848,695円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	538,088円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,759,348円

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,296,632,642円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	7,995,785円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	71,673,896円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,521,663,602円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,513,925,274円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,117,486,464円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	19,789,865円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	101,693,203円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	347,233円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	718,885,446円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	64,157,112円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	177,133,917円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	760,554,540円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	648,495,263円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,550,284,613円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	837,014円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	293,533,256円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	131,650,499円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,994,714円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	13,073,387円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	6,812,692円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	43,227,998円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	112,493,525円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	634,241,041円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	137,128,409円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	5,665,809,160円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	251,019,233円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	95,964,227円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	6,000,355円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	7,004,719円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	7,446,085円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	135,212,835円
合計	58,066,751,593円

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APACHE CORPORATION	19,062	10.69	203,772.78	
	BAKER HUGHES COMPANY	31,974	13.42	429,091.08	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	20.44	401,278.08	

CHENIERE ENERGY INC	11,747	41.87	491,846.89
CHEVRON CORPORATION	96,717	87.01	8,415,346.17
CONCHO RESOURCES INC	10,172	53.09	540,031.48
CONOCOPHILLIPS	55,797	36.09	2,013,713.73
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	12.59	57,095.65
DEVON ENERGY CORPORATION	21,054	10.52	221,488.08
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,933	35.78	283,842.74
EOG RESOURCES INC	30,830	43.36	1,336,788.80
EXXON MOBIL CORPORATION	217,519	43.73	9,512,105.87
HALLIBURTON CO	44,317	8.86	392,648.62
HESS CORPORATION	15,362	42.46	652,270.52
HOLLYFRONTIER CORP	6,263	28.56	178,871.28
KINDER MORGAN INC	104,140	14.62	1,522,526.80
MARATHON OIL CORP	31,450	4.93	155,048.50
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	35,915	25.76	925,170.40
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	15,585	12.02	187,331.70
NOBLE ENERGY INC	26,757	8.18	218,872.26
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	50,338	13.81	695,167.78
ONEOK INC	19,764	27.66	546,672.24
PHILLIPS 66	23,496	60.53	1,422,212.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,858	77.45	686,052.10
SCHLUMBERGER LTD	73,444	16.11	1,183,182.84
TARGA RESOURCES CORP	11,788	9.72	114,579.36
TECHNIPFMC PLC	21,584	8.02	173,103.68
VALERO ENERGY CORP	22,007	52.50	1,155,367.50
WILLIAMS COS INC	61,445	18.28	1,123,214.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,440	216.78	2,479,963.20
ALBEMARLE CORPORATION	4,714	61.53	290,052.42
AMCOR PLC	82,302	8.42	692,982.84
AVERY DENNISON CORP	4,832	108.54	524,465.28
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12,590	18.45	232,285.50
BALL CORPORATION	15,187	65.27	991,255.49
CELANESE CORPORATION	6,420	78.79	505,831.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	28.00	336,056.00
CORTEVA INC	38,111	26.27	1,001,175.97
CROWN HOLDINGS INC	6,863	59.22	406,426.86
DOW INC	37,953	33.12	1,257,003.36
DUPONT DE NEMOURS INC	38,956	41.90	1,632,256.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,027	57.27	402,436.29
ECOLAB INC	13,499	180.08	2,430,899.92
FMC CORPORATION	6,676	88.20	588,823.20
FREEMPORT-MCMORAN INC	69,858	8.48	592,395.84

INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	31.13	595,828.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,871	126.49	616,132.79
LINDE PLC	27,616	181.47	5,011,475.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,793	50.05	740,389.65
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,092	177.35	548,366.20
MOSAIC CO/THE	18,584	11.33	210,556.72
NEWMONT CORPORATION	42,763	63.11	2,698,772.93
NUCOR CORP	15,455	37.87	585,280.85
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	85.99	402,605.18
PPG INDUSTRIES INC	12,848	92.74	1,191,523.52
RPM INTERNATIONAL INC	6,118	65.05	397,975.90
SEALED AIR CORP	7,895	28.49	224,928.55
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,330	506.06	2,191,239.80
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	23.54	239,896.14
VULCAN MATERIALS CO	6,698	102.03	683,396.94
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	40.70	60,032.50
WESTROCK CO	13,034	28.88	376,421.92
3M COMPANY	29,528	147.00	4,340,616.00
ACUITY BRANDS INC	1,884	83.34	157,012.56
AERCAP HOLDINGS NV	3,944	22.26	87,793.44
ALLEGION PLC	4,764	96.57	460,059.48
AMETEK INC	11,307	77.06	871,317.42
BOEING CO	27,646	128.98	3,565,781.08
CARRIER GLOBAL CORP	42,223	16.25	686,123.75
CATERPILLAR INC	28,560	114.04	3,256,982.40
CUMMINS INC	7,482	147.77	1,105,615.14
DEERE & CO	15,183	138.63	2,104,819.29
DOVER CORP	7,186	90.97	653,710.42
EATON CORP PLC	21,253	78.86	1,676,011.58
EMERSON ELECTRIC CO	31,316	53.82	1,685,427.12
FASTENAL COMPANY	29,021	36.03	1,045,626.63
FLOWERVE CORPORATION	6,650	25.53	169,774.50
FORTIVE CORP	14,950	60.34	902,083.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	43.72	281,994.00
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	129.30	1,634,610.60
GENERAL ELECTRIC CO	450,795	6.26	2,821,976.70
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	27.85	216,867.95
HEICO CORP	1,888	75.70	142,921.60
HEICO CORP-CLASS A	4,435	66.77	296,124.95
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	36,734	135.52	4,978,191.68
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	10.81	205,649.44
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	2,107	184.50	388,741.50

IDEX CORP	3,839	152.72	586,292.08
ILLINOIS TOOL WORKS	16,690	158.23	2,640,858.70
INGERSOLL-RAND INC	16,918	27.82	470,658.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	80.00	554,160.00
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	47.11	541,765.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	10,600	22.86	242,316.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	40,974	27.91	1,143,584.34
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,089	189.85	2,105,246.65
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,056	176.51	362,904.56
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	13,059	381.77	4,985,534.43
MASCO CORP	14,885	40.05	596,144.25
MIDDLEBY CORP	2,823	51.49	145,356.27
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,295	339.31	2,814,576.45
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	47.85	1,010,161.35
OWENS CORNING	5,205	37.10	193,105.50
PACCAR INC	17,781	67.48	1,199,861.88
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,505	134.95	877,849.75
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,220	31.67	260,327.40
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	77,798	63.43	4,934,727.14
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	174.59	1,085,775.21
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,445	306.41	1,668,402.45
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	34.55	262,580.00
SMITH(A.O.) CORP	7,157	40.39	289,071.23
SNAP-ON INC	2,407	116.07	279,380.49
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,137	18.09	92,928.33
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,684	107.74	827,874.16
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,060	316.04	651,042.40
TEXTRON INC	11,803	27.03	319,035.09
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	84.03	1,072,138.77
TRANSDIGM GROUP INC	2,427	304.92	740,040.84
UNITED RENTALS INC	3,596	106.05	381,355.80
WABCO HOLDINGS INC	2,598	135.16	351,145.68
WABTEC CORP	9,231	53.44	493,304.64
WW GRAINGER INC	2,390	269.61	644,367.90
XYLEM INC	9,124	68.52	625,176.48
CINTAS CORP	4,833	200.18	967,469.94
COPART INC	10,456	73.83	771,966.48
COSTAR GROUP INC	1,853	593.60	1,099,940.80
EQUIFAX INC	6,127	131.42	805,210.34
IHS MARKIT LTD	19,584	65.60	1,284,710.40
MANPOWERGROUP	3,264	68.75	224,400.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	18,026	12.47	224,784.22

REPUBLIC SERVICES INC	11,415	76.10	868,681.50
ROBERT HALF INTL INC	5,555	44.06	244,753.30
ROLLINS INC	6,451	38.14	246,041.14
TRANSUNION	9,497	72.13	685,018.61
VERISK ANALYTICS INC	8,444	148.54	1,254,271.76
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	85.74	1,162,291.44
WASTE MANAGEMENT INC	22,016	98.48	2,168,135.68
AMERCO	390	252.54	98,490.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	10.31	58,519.56
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,925	72.28	500,539.00
CSX CORPORATION	38,440	63.82	2,453,240.80
DELTA AIR LINES INC	8,299	22.41	185,980.59
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,148	71.93	586,085.64
FEDEX CORP	12,743	123.06	1,568,153.58
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,411	101.60	448,157.60
KANSAS CITY SOUTHERN	5,100	131.41	670,191.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	35.88	284,887.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,060	160.68	2,098,480.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,926	141.63	697,669.38
SOUTHWEST AIRLINES	6,316	29.33	185,248.28
UBER TECHNOLOGIES INC	23,948	29.49	706,226.52
UNION PACIFIC CORP	35,688	156.09	5,570,539.92
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	2,880	25.56	73,612.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	36,101	100.18	3,616,598.18
XPO LOGISTICS INC	4,716	66.00	311,256.00
APTIV PLC	13,074	62.74	820,262.76
AUTOLIV INC	4,001	60.75	243,060.75
BORGWARNER INC	12,075	27.08	326,991.00
FORD MOTOR COMPANY	208,063	4.87	1,013,266.81
GENERAL MOTORS CO	67,788	21.95	1,487,946.60
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	18.67	137,168.49
LEAR CORP	2,749	88.50	243,286.50
TESLA INC	6,950	725.15	5,039,792.50
CAPRI HOLDINGS LTD	6,229	12.50	77,862.50
D.R.HORTON INC	17,316	40.94	708,917.04
GARMIN LTD	6,739	78.92	531,841.88
HANESBRANDS INC	22,204	8.44	187,401.76
HASBRO INC	7,491	74.87	560,851.17
LEGGETT & PLATT INC	6,656	29.88	198,881.28
LENNAR CORP-CL A	13,372	42.88	573,391.36
LULULEMON ATHLETICA INC	6,005	214.55	1,288,372.75
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	78.96	226,062.48

NEWELL BRANDS INC	18,477	12.91	238,538.07
NIKE INC -CL B	64,058	88.37	5,660,805.46
NVR INC	173	2,847.37	492,595.01
POLARIS INC	2,467	63.33	156,235.11
PULTE GROUP INC	13,065	25.64	334,986.60
PVH CORP	3,303	41.36	136,612.08
RALPH LAUREN CORPORATION	1,971	68.30	134,619.30
TAPESTRY INC	14,712	13.64	200,671.68
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	10.00	86,340.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	8.97	74,370.27
VF CORP	17,117	54.57	934,074.69
WHIRLPOOL CORP	3,212	104.58	335,910.96
ARAMARK	13,242	24.57	325,355.94
CARNIVAL CORP	21,372	11.91	254,540.52
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,306	882.47	1,152,505.82
DARDEN RESTAURANTS INC	5,866	68.82	403,698.12
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	367.29	779,022.09
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,617	71.37	1,043,215.29
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	43.78	772,016.52
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	14,715	80.71	1,187,647.65
MCDONALD'S CORPORATION	38,716	184.02	7,124,518.32
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	14,027	15.11	211,947.97
MGM MIRAGE	25,878	13.94	360,739.32
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	10,922	10.86	118,612.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,036	35.68	322,404.48
STARBUCKS CORP	60,807	75.58	4,595,793.06
VAIL RESORTS INC	2,038	153.94	313,729.72
WYNN RESORTS LTD	4,913	76.61	376,384.93
YUM! BRANDS INC	15,549	85.89	1,335,503.61
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,230	66.65	2,614,679.50
ALPHABET INC-CL A	15,446	1,276.60	19,718,363.60
ALPHABET INC-CL C	15,938	1,279.31	20,389,642.78
ALTICE USA INC-A	6,300	26.21	165,123.00
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,729	508.55	3,930,582.95
COMCAST CORP-CLASS A	233,390	37.16	8,672,772.40
DISCOVERY INC-A	7,075	21.02	148,716.50
DISCOVERY INC-C	18,283	19.14	349,936.62
DISH NETWORK CORP.	12,937	23.40	302,725.80
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	116.31	1,785,591.12
FACEBOOK INC-A	124,019	190.07	23,572,291.33
FOX CORPORATION-CLASS A	16,962	24.83	421,251.27
FOX CORPORATION-CLASS B	8,773	24.52	215,113.96

IAC/INTERACTIVECORP	3,974	223.67	888,864.58
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	14.74	289,287.24
LIBERTY BROADBAND-C	5,418	126.08	683,101.44
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	18.38	154,980.16
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	21,079	17.51	369,198.68
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	27.44	282,302.72
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	31.08	237,699.84
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	30.64	126,880.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	7,512	38.24	287,258.88
MATCH GROUP INC	2,681	81.23	217,777.63
NETFLIX INC	22,530	424.99	9,575,024.70
NEWS CORP-CLASS A	16,662	8.83	147,125.46
OMNICOM GROUP	10,417	52.03	541,996.51
PINTEREST INC- CLASS A	14,828	20.62	305,753.36
ROKU INC	4,624	124.83	577,213.92
SIRIUS XM HOLDINGS INC	81,768	5.50	450,132.84
SNAP INC-A	35,102	16.00	561,632.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	5,707	127.88	729,811.16
THE WALT DISNEY CO.	92,661	101.19	9,376,366.59
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	18.44	74,700.44
TWITTER INC	37,026	28.74	1,064,127.24
VIACOMCBS INC	32,846	15.63	513,382.98
ZILLOW GROUP INC-C	7,906	40.70	321,813.73
ADVANCE AUTO PARTS	3,426	117.59	402,863.34
AMAZON.COM INC	21,665	2,410.22	52,217,416.30
AUTOZONE INC	1,271	1,047.04	1,330,787.84
BEST BUY COMPANY INC	13,126	71.88	943,496.88
BOOKING HOLDINGS INC	2,165	1,362.77	2,950,397.05
BURLINGTON STORES INC	3,739	174.49	652,418.11
CARMAX INC	8,427	70.96	597,979.92
DOLLAR GENERAL CORP	13,035	175.98	2,293,899.30
DOLLAR TREE INC	12,047	74.54	897,983.38
EBAY INC	39,732	39.35	1,563,454.20
EXPEDIA GROUP INC	6,894	66.57	458,933.58
GAP INC/THE	9,218	6.90	63,604.20
GENUINE PARTS CO	7,406	75.03	555,672.18
GRUBHUB INC	4,403	43.52	191,618.56
HOME DEPOT INC	56,079	212.18	11,898,842.22
KOHL'S CORP	8,274	15.80	130,729.20
LKQ CORPORATION	15,922	21.33	339,616.26
LOWE'S COMPANIES INC	39,710	98.75	3,921,362.50
MERCADOLIBRE INC	2,251	571.27	1,285,928.77

NORDSTROM INC	4,756	17.84	84,847.04
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,012	384.82	1,543,897.84
ROSS STORES INC	18,131	85.49	1,550,019.19
TARGET CORP	26,051	107.82	2,808,818.82
TIFFANY & CO	5,541	126.35	700,105.35
TJX COMPANIES INC	62,641	46.05	2,884,618.05
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	101.98	623,811.66
ULTA BEAUTY INC	2,765	210.52	582,087.80
WAYFAIR INC-CLASS A	2,887	122.41	353,397.67
COSTCO WHOLESALE CORP	22,712	310.55	7,053,211.60
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	4.74	63,990.00
KROGER CO	39,652	32.96	1,306,929.92
SYSCO CORP	26,129	53.08	1,386,927.32
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	39,655	43.74	1,734,509.70
WALMART INC	73,512	129.44	9,515,393.28
ALTRIA GROUP INC	95,985	39.42	3,783,728.70
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,404	35.99	1,022,259.96
BROWN-FORMAN CORPORATION	15,620	61.13	954,850.60
BUNGE LIMITED	7,174	39.61	284,162.14
CAMPBELL SOUP CO	7,879	50.75	399,859.25
COCA-COLA CO/THE	210,391	45.43	9,558,063.13
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	12,033	40.25	484,328.25
CONAGRA BRANDS INC	24,639	34.18	842,161.02
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	158.83	1,410,569.23
GENERAL MILLS INC	31,072	60.48	1,879,234.56
HORMEL FOODS CORPORATION	14,939	46.61	696,306.79
INGREDION INC	3,320	80.57	267,492.40
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,768	117.80	679,470.40
KELLOGG CO	12,949	64.10	830,030.90
KRAFT HEINZ COMPANY	34,009	29.23	994,083.07
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	57.78	428,554.26
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,209	154.26	957,800.34
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	9,629	43.03	414,335.87
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	74,020	51.41	3,805,368.20
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	19,947	59.80	1,192,830.60
PEPSICO INC	72,083	134.36	9,685,071.88
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	79,987	73.67	5,892,642.29
THE HERSHEY COMPANY	7,514	135.74	1,019,950.36
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	58.98	881,692.02
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	71.35	890,804.75
CLOROX COMPANY	6,208	190.65	1,183,555.20
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	41,857	71.40	2,988,589.80

COTY INC-CL A	16,985	6.27	106,495.95
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,317	166.31	1,882,130.27
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	141.66	2,521,548.00
PROCTER & GAMBLE CO	128,483	118.78	15,261,210.74
ABBOTT LABORATORIES	91,466	94.06	8,603,291.96
ABIOMED INC	2,288	168.52	385,573.76
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,854	191.97	739,852.38
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	88.70	708,979.10
ANTHEM INC	13,036	264.12	3,443,068.32
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,935	92.92	2,316,960.20
BECTON DICKINSON & CO	14,106	268.17	3,782,806.02
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,656	36.90	2,644,106.40
CARDINAL HEALTH INC	15,114	50.32	760,536.48
CENTENE CORP	29,691	70.58	2,095,590.78
CERNER CORP	15,537	72.75	1,130,316.75
CIGNA CORPORATION	19,198	188.20	3,613,063.60
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,509	293.21	735,663.89
CVS HEALTH CORPORATION	66,864	62.31	4,166,295.84
DANAHER CORP	32,178	165.07	5,311,622.46
DAVITA INC	5,115	74.00	378,510.00
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	39.31	466,373.84
DEXCOM INC	4,617	332.44	1,534,875.48
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,722	223.48	2,396,152.56
HCA HEALTHCARE INC	14,352	107.83	1,547,576.16
HENRY SCHEIN INC	7,559	52.39	396,016.01
HOLOGIC INC	13,592	47.11	640,319.12
HUMANA INC.	6,808	369.09	2,512,764.72
IDEXX LABORATORIES INC	4,361	271.80	1,185,319.80
INSULET CORP	2,958	203.83	602,929.14
INTUITIVE SURGICAL INC	5,988	514.93	3,083,400.84
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,995	163.72	817,781.40
MCKESSON CORP	7,996	139.94	1,118,960.24
MEDTRONIC PLC	68,908	99.30	6,842,564.40
QUEST DIAGNOSTICS	6,814	106.62	726,508.68
RESMED INC	7,271	161.00	1,170,631.00
STERIS PLC	4,287	147.82	633,704.34
STRYKER CORP	17,447	188.12	3,282,129.64
TELEFLEX INC	2,340	338.39	791,832.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	48,895	291.29	14,242,624.55
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	101.65	427,234.95
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,349	108.68	472,649.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,481	187.63	1,216,030.03

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,188	195.54	818,921.52
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	116.45	1,264,181.20
ABBVIE INC	76,670	83.59	6,408,845.30
AGILENT TECHNOLOGIES INC	15,308	75.75	1,159,581.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,946	108.12	1,183,481.52
ALLERGAN PLC	16,877	186.90	3,154,311.30
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,613	145.63	817,421.19
AMGEN INC	30,771	236.28	7,270,571.88
BEIGENE LTD-ADR	1,850	160.20	296,370.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	433.01	528,272.20
BIOGEN INC	9,176	297.80	2,732,612.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	97.31	883,574.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,044	62.25	7,534,989.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,964	23.85	428,441.40
ELI LILLY & CO	44,424	162.93	7,238,002.32
EXACT SCIENCES CORP	6,832	75.46	515,542.72
GILEAD SCIENCES INC	64,930	79.64	5,171,025.20
ILLUMINA INC	7,655	309.07	2,365,930.85
INCYTE CORP	9,243	103.48	956,465.64
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,760	58.15	393,094.00
IQVIA HOLDINGS INC	8,158	128.86	1,051,239.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	107.15	279,018.60
JOHNSON & JOHNSON	135,649	154.86	21,006,604.14
MERCK & CO. INC.	131,546	81.43	10,711,790.78
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,258	713.38	897,432.04
MYLAN NV	26,138	15.76	411,934.88
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	98.18	410,981.48
PERKINELMER INC	5,624	87.55	492,381.20
PERRIGO CO PLC	6,187	51.43	318,197.41
PFIZER INC	285,960	37.38	10,689,184.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,162	566.21	2,356,566.02
SAREPTA THERAPEUTICS INC	3,828	121.53	465,216.84
SEATTLE GENETICS INC	5,726	146.04	836,225.04
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	59,290	10.22	605,943.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,615	328.70	6,776,150.50
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,417	269.86	3,620,711.62
WATERS CORP	3,527	191.32	674,785.64
ZOETIS INC	24,652	125.91	3,103,933.32
BANK OF AMERICA CORP	440,243	22.18	9,764,589.74
CITIGROUP INC	112,237	43.10	4,837,414.70
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	20.60	428,459.40
COMERICA INC	7,691	32.13	247,111.83

EAST WEST BANCORP INC	9,201	30.37	279,434.37
FIFTH THIRD BANCORP	33,954	17.12	581,292.48
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	100.05	890,144.85
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,062	8.16	432,985.92
JPMORGAN CHASE & CO	161,245	90.71	14,626,533.95
KEYCORP	51,128	10.90	557,295.20
M & T BANK CORP	5,998	105.06	630,149.88
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	20,200	11.88	239,976.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,526	100.73	2,269,043.98
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	45,237	9.79	442,870.23
SIGNATURE BANK	2,508	94.12	236,052.96
SVB FINANCIAL GROUP	2,640	184.00	485,760.00
TRUIST FINANCIAL CORPORATION	68,950	35.48	2,446,346.00
US BANCORP	76,789	34.00	2,610,826.00
WELLS FARGO & COMPANY	206,558	26.92	5,560,541.36
ZIONS BANCORPORATION	8,874	29.46	261,428.04
ALLY FINANCIAL INC	20,139	14.30	287,987.70
AMERICAN EXPRESS COMPANY	35,757	83.17	2,973,909.69
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,062	107.48	651,543.76
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	42,207	35.76	1,509,322.32
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	67,565	186.52	12,602,223.80
BLACKROCK INC	5,952	475.14	2,828,033.28
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	34,684	48.43	1,679,746.12
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,649	56.15	1,384,041.35
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	96.52	546,399.72
CME GROUP INC.	18,423	182.72	3,366,250.56
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	36.23	595,077.75
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	10,809	38.66	417,875.94
EATON VANCE CORP	5,530	33.58	185,697.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	16.00	365,120.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	274.43	532,119.77
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	15.92	227,624.16
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,520	177.00	2,924,040.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,913	88.92	2,570,943.96
INVESCO LIMITED	18,328	7.80	142,958.40
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	12,885	12.17	156,810.45
KKR & CO INC -A	24,824	23.61	586,094.64
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	421.02	804,990.24
MOODY'S CORP	8,888	245.20	2,179,337.60
MORGAN STANLEY	62,409	37.97	2,369,669.73
MSCI INC-A	4,383	324.89	1,423,992.87
NASDAQ INC	6,498	105.63	686,383.74

NORTHERN TRUST CORP	11,127	77.39	861,118.53
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,426	61.55	395,520.30
S&P GLOBAL INC	12,564	283.94	3,567,422.16
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,841	35.40	2,118,371.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,574	48.82	272,150.55
STATE STREET CORP	18,694	57.41	1,073,222.54
SYNCHRONY FINANCIAL	27,825	16.97	472,190.25
T ROWE PRICE GROUP INC	12,364	100.34	1,240,603.76
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	14,028	36.72	515,108.16
VOYA FINANCIAL INC	7,308	41.74	305,035.92
AFLAC INC	38,953	36.29	1,413,604.37
ALLEGHANY CORPORATION	689	524.97	361,704.33
ALLSTATE CORP	16,654	101.44	1,689,381.76
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	61.65	218,179.35
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	47,036	23.35	1,098,290.60
AON PLC	11,871	175.54	2,083,835.34
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	20,476	23.64	484,052.64
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,394	75.28	707,180.32
ASSURANT INC	3,114	104.65	325,880.10
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,199	23.64	193,824.36
BROWN & BROWN INC	10,899	34.76	378,849.24
CHUBB LTD	23,475	104.02	2,441,869.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	78.53	617,088.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	173.32	223,236.16
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	170.81	352,722.65
FNF GROUP	13,937	26.25	365,846.25
GLOBE LIFE INC	6,040	76.07	459,462.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	36.04	660,649.24
LINCOLN NATIONAL CORP	8,356	30.21	252,434.76
LOEWS CORPORATION	13,914	32.40	450,813.60
MARKEL CORP	702	879.54	617,437.08
MARSH & MCLENNAN COS	26,208	93.29	2,444,944.32
METLIFE INC	41,534	33.30	1,383,082.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	29.98	423,437.52
PROGRESSIVE CORP	30,367	82.87	2,516,513.29
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	55.78	1,156,207.84
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,022	101.29	306,098.38
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,239	141.13	315,990.07
TRAVELERS COS INC(THE)	13,126	100.82	1,323,363.32
UNUM GROUP	9,769	15.35	149,954.15
W.R.BERKLEY CORPORATION	7,428	50.24	373,182.72
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	177.22	1,209,172.06

CBRE GROUP INC-A	16,199	39.99	647,798.01
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	21,483	161.61	3,471,867.63
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	4.00	209,200.00
JONES LANG LASALLE INC	2,618	102.48	268,292.64
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916	305.79	1,809,053.64
ACCENTURE PLC-CL A	32,648	175.46	5,728,418.08
ADOBE INC	24,886	344.10	8,563,272.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,321	102.78	855,232.38
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	40.40	89,768.80
ANSYS INC	4,256	259.45	1,104,219.20
AUTODESK INC	11,506	180.35	2,075,107.10
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,245	139.23	3,097,171.35
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	7,623	68.96	525,682.08
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	75.86	609,079.94
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,889	111.44	656,270.16
CADENCE DESIGN SYS INC	14,250	80.52	1,147,410.00
CDK GLOBAL INC	5,808	34.71	201,595.68
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,244	104.37	651,686.28
CITRIX SYSTEMS INC	6,676	146.04	974,963.04
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,737	53.81	1,546,337.97
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,984	94.70	187,884.80
DOCUSIGN INC	5,401	105.07	567,483.07
DROPBOX INC-CLASS A	10,565	20.20	213,465.82
DXC TECHNOLOGY CO	11,825	15.92	188,254.00
EPAM SYSTEMS INC	3,128	203.03	635,077.84
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,596	125.73	3,972,565.08
FISERV INC	30,144	96.29	2,902,565.76
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	222.62	973,072.02
FORTINET INC	7,360	103.27	760,067.20
GARTNER INC	4,568	109.76	501,383.68
GLOBAL PAYMENTS INC	15,685	153.01	2,399,961.85
GODADDY INC - CLASS A	8,905	67.39	600,107.95
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	87.17	412,401.27
INTL BUSINESS MACHINES CORP	45,493	124.72	5,673,886.96
INTUIT INC	13,382	263.66	3,528,298.12
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	159.11	622,915.65
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	101.95	708,246.65
MASTERCARD INC-CL A	46,151	258.76	11,942,032.76
MICROSOFT CORP	372,892	174.55	65,088,298.60
MONGODB INC	2,035	159.94	325,477.90
NORTONLIFELOCK INC	31,347	20.96	657,033.12
OKTA INC	5,270	155.35	818,694.50

ORACLE CORPORATION	118,127	53.01	6,261,912.27
PALO ALTO NETWORKS INC	4,867	193.45	941,521.15
PAYCHEX INC	17,507	68.09	1,192,051.63
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	211.80	534,159.60
PAYPAL HOLDINGS INC	57,346	120.18	6,891,842.28
PTC INC	5,462	65.00	355,030.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	4,049	238.73	966,617.77
SABRE CORP	13,930	5.59	77,868.70
SALESFORCE.COM, INC.	42,832	153.98	6,595,271.36
SERVICENOW INC	9,802	302.94	2,969,417.88
SPLUNK INC	7,614	128.63	979,388.82
SQUARE INC-A	17,051	62.01	1,057,332.51
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	51.21	591,270.66
SYNOPSYS INC	7,601	153.03	1,163,181.03
TWILIO INC-A	5,649	109.95	621,107.55
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,865	314.71	586,934.15
VERISIGN INC	5,227	212.13	1,108,803.51
VISA INC	88,048	167.32	14,732,191.36
VMWARE INC	4,194	128.17	537,544.98
WESTERN UNION COMPANY	21,840	18.50	404,040.00
WIX.COM LTD	2,557	134.36	343,558.52
WORKDAY INC-CLASS A	8,688	144.96	1,259,412.48
AMPHENOL CORPORATION -CL A	15,698	86.17	1,352,696.66
APPLE INC	228,505	282.97	64,660,059.85
ARISTA NETWORKS INC	2,720	216.81	589,723.20
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	55.20	227,976.00
CDW CORP/DE	7,404	104.77	775,717.08
CISCO SYSTEMS INC	218,093	42.52	9,273,314.36
COGNEX CORP	8,698	48.80	424,462.40
CORNING INC	38,044	20.78	790,554.32
DELL TECHNOLOGIES INC-C	7,900	39.69	313,551.00
F5 NETWORKS INC	2,909	127.32	370,373.88
FLEX LTD	23,204	8.10	187,952.40
FLIR SYSTEMS INC	6,867	39.66	272,345.22
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	61,911	9.53	590,011.83
HP INC	78,476	15.00	1,177,140.00
IPG PHOTONICS CORP	1,776	120.90	214,718.40
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	23.29	406,643.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,542	97.54	930,726.68
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,241	152.80	1,412,024.80
NETAPP INC	10,919	43.06	470,172.14
SEAGATE TECHNOLOGY	12,634	48.63	614,391.42

TE CONNECTIVITY LTD	16,545	70.15	1,160,631.75
TRIMBLE INC	12,759	32.63	416,326.17
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	40.69	604,531.33
XEROX HOLDINGS CORP	9,697	17.97	174,255.09
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	208.62	570,992.94
AT&T INC	375,942	29.71	11,169,236.82
CENTURYLINK INC	49,758	10.21	508,029.18
T-MOBILE US INC	22,097	90.80	2,006,407.60
VERIZON COMMUNICATIONS INC	213,529	57.93	12,369,734.97
AES CORPORATION	33,656	12.86	432,816.16
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	49.98	604,807.98
AMEREN CORPORATION	12,454	73.64	917,112.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	83.23	2,141,258.21
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,154	125.01	1,144,341.54
ATMOS ENERGY CORP	5,710	104.41	596,181.10
CENTERPOINT ENERGY INC	25,464	16.68	424,739.52
CMS ENERGY CORPORATION	14,040	59.40	833,976.00
CONSOLIDATED EDISON INC	16,493	82.64	1,362,981.52
DOMINION ENERGY INC	42,503	77.92	3,311,833.76
DTE ENERGY COMPANY	10,496	103.02	1,081,297.92
DUKE ENERGY CORP	37,900	85.69	3,247,651.00
EDISON INTERNATIONAL	17,941	59.25	1,063,004.25
ENERGY CORP	10,866	97.53	1,059,760.98
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,092	43.68	440,818.56
EVERGY INC	11,273	58.51	659,583.23
EVERSOURCE ENERGY	16,644	86.57	1,440,871.08
EXELON CORP	50,837	36.60	1,860,634.20
FIRSTENERGY CORP	26,948	42.32	1,140,439.36
NEXTERA ENERGY INC	25,128	239.70	6,023,181.60
NISOURCE INC	18,919	26.03	492,461.57
NRG ENERGY INC	13,547	32.60	441,632.20
OGE ENERGY CORP	11,870	31.27	371,174.90
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,996	77.14	462,531.44
PPL CORPORATION	36,597	25.49	932,857.53
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,964	51.37	1,282,400.68
SEMPRA ENERGY	14,772	126.97	1,875,600.84
SOUTHERN CO	54,269	57.73	3,132,949.37
UGI CORPORATION	10,588	28.24	299,005.12
VISTRA ENERGY CORP	18,354	18.04	331,106.16
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	93.77	1,541,391.26
XCEL ENERGY INC	26,959	64.57	1,740,742.63
ADVANCED MICRO DEVICES	54,897	56.18	3,084,113.46

	ANALOG DEVICES INC	19,298	105.92	2,044,044.16
	APPLIED MATERIALS INC	48,260	51.74	2,496,972.40
	BROADCOM INC	20,398	264.81	5,401,594.38
	INTEL CORP	223,631	59.26	13,252,373.06
	KLA CORPORATION	7,805	164.92	1,287,200.60
	LAM RESEARCH CORP	7,581	266.67	2,021,625.27
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	31,750	27.13	861,377.50
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,814	53.67	741,397.38
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,065	82.01	989,450.65
	MICRON TECHNOLOGY INC	57,501	44.16	2,539,244.16
	NVIDIA CORP	29,890	289.59	8,655,845.10
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	94.43	1,365,174.51
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	14.66	306,569.92
	QORVO INC	6,042	89.89	543,115.38
	QUALCOMM INC	58,780	76.04	4,469,631.20
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	96.51	845,138.07
	TERADYNE INC	8,542	62.00	529,604.00
	TEXAS INSTRUMENTS INC	48,056	113.93	5,475,020.08
	XILINX INC	12,876	89.74	1,155,492.24
	米ドル 小計	15,404,627		1,244,237,912.72 (133,879,999,408)
カナダドル	CAMECO CORP	16,384	14.34	234,946.56
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	66,360	19.75	1,310,610.00
	CENOVUS ENERGY INC	54,018	4.28	231,197.04
	ENBRIDGE INC	104,629	41.17	4,307,575.93
	HUSKY ENERGY INC	14,553	3.61	52,536.33
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	18.55	241,131.45
	INTER PIPELINE LTD	19,394	10.45	202,667.30
	KEYERA CORP	11,374	17.79	202,343.46
	OVINTIV INC	13,275	6.60	87,615.00
	PARKLAND FUEL CORP	7,666	28.68	219,860.88
	PEMBINA PIPELINE CORP	27,411	28.41	778,746.51
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	9.08	82,065.04
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	21.95	1,726,191.90
	TC ENERGY CORP	47,682	64.29	3,065,475.78
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,905	85.85	1,022,044.25
	BARRICK GOLD CORP	90,520	38.21	3,458,769.20
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	6,563	41.10	269,739.30
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	8.55	270,795.60
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	9,493	192.04	1,823,035.72
	KINROSS GOLD CORP	63,501	9.99	634,374.99
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,581	60.33	940,001.73

LUNDIN MINING CORP	28,209	6.78	191,257.02
METHANEX CORPORATION	2,452	19.34	47,421.68
NUTRIEN LTD	29,898	48.45	1,448,558.10
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	24,814	10.41	258,313.74
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	30.25	86,908.25
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,560	55.80	1,370,448.00
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	0.42	31,857.84
CAE INC	12,891	19.68	253,694.88
WSP GLOBAL INC	6,141	89.56	549,987.96
THOMSON REUTERS CORP	10,175	99.96	1,017,093.00
AIR CANADA	5,737	18.24	104,642.88
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,013	111.43	4,124,358.59
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7,115	323.20	2,299,568.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,364	49.55	711,736.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	20.84	188,935.44
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,069	66.66	937,839.54
STARS GROUP INC/THE	13,795	35.39	488,205.05
QUEBECOR INC -CL B	9,953	30.17	300,282.01
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	22.89	623,340.48
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,570	95.30	340,221.00
DOLLARAMA INC	14,542	43.42	631,413.64
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	45,924	40.30	1,850,737.20
EMPIRE CO LTD A	7,235	33.45	242,010.75
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	74.50	636,155.50
METRO INC	13,109	60.15	788,506.35
WESTON (GEORGE) LTD	4,281	102.95	440,728.95
SAPUTO INC	13,425	34.66	465,310.50
AURORA CANNABIS INC	47,116	1.03	48,529.48
BAUSCH HEALTH COS INC	15,027	23.87	358,694.49
CANOPY GROWTH CORP	11,251	21.88	246,171.88
CRONOS GROUP INC	8,026	8.76	70,307.76
BANK OF MONTREAL	33,057	67.52	2,232,008.64
BANK OF NOVA SCOTIA	63,154	53.35	3,369,265.90
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	79.00	1,857,527.00
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	52.43	890,942.99
ROYAL BANK OF CANADA	73,726	83.20	6,134,003.20
TORONTO-DOMINION BANK	93,129	54.87	5,109,988.23
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	68,634	44.87	3,079,607.58
CI FINANCIAL CORP	11,041	13.67	150,930.47
IGM FINANCIAL INC	6,433	27.09	174,269.97
ONEX CORPORATION	4,217	61.98	261,369.66
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	386.55	538,464.15

	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	20.99	298,058.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	41.11	199,424.61	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,058	132.61	935,961.38	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	16.06	1,602,948.60	
	POWER CORP OF CANADA	26,356	20.13	530,546.28	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	29,068	43.75	1,271,725.00	
	BLACKBERRY LIMITED	25,993	5.70	148,160.10	
	CGI INC-CL A	13,436	86.05	1,156,167.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,026	1,350.00	1,385,100.00	
	OPEN TEXT CORPORATION	13,665	52.00	710,580.00	
	SHOPIFY INC-CLASS A	5,335	908.61	4,847,434.35	
	BCE INC	8,379	56.48	473,245.92	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	18,509	58.22	1,077,593.98	
	TELUS CORPORATION	15,222	22.60	344,017.20	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,712	18.97	506,726.64	
	ALTAGAS LTD	17,347	14.99	260,031.53	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	37.40	113,322.00	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,344	33.59	246,684.96	
	EMERA INC	13,874	54.40	754,745.60	
	FORTIS INC	21,905	53.27	1,166,879.35	
	HYDRO ONE LTD	15,052	25.30	380,815.60	
	カナダドル 小計	2,044,376		84,523,506.82 (6,446,607,865)	
ユーロ	ENI SPA	133,196	8.25	1,098,867.00	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	30,462	9.41	286,769.26	
	NESTE OYJ	20,558	29.61	608,722.38	
	OMV AG	7,781	27.64	215,066.84	
	REPSOL SA	74,961	7.74	580,348.06	
	TENARIS S.A.	25,963	5.91	153,649.03	
	TOTAL SA	122,058	31.86	3,888,767.88	
	VOPAK	3,130	51.94	162,572.20	
	AIR LIQUIDE SA	24,422	115.30	2,815,856.60	
	AKZO NOBEL	10,399	68.24	709,627.76	
	ARCELORMITTAL	35,989	8.94	322,065.56	
	ARKEMA	3,250	72.84	236,730.00	
	BASF SE	47,219	43.69	2,063,234.20	
	COVESTRO AG	8,053	29.79	239,898.87	
	CRH PLC	40,916	26.06	1,066,270.96	
	EVONIK INDUSTRIES AG	12,950	21.70	281,015.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	35.78	120,578.60	
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,958	38.98	271,222.84	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,430	113.20	1,067,476.00	

LANXESS	4,409	40.73	179,578.57
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,441	26.96	308,449.36
SOLVAY SA	3,758	66.56	250,132.48
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	10.20	308,386.80
SYMRISE AG	6,524	95.26	621,476.24
THYSSENKRUPP AG	19,367	5.43	105,201.54
UMICORE	9,349	39.16	366,106.84
UPM-KYMMENE OYJ	27,288	24.00	654,912.00
VOESTALPINE AG	6,338	18.40	116,619.20
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,792	20.90	309,152.80
AIRBUS SE	30,303	52.34	1,586,059.02
ALSTOM RGPT	9,668	38.60	373,184.80
ANDRITZ AG	4,328	31.44	136,072.32
BOUYGUES SA	11,049	26.98	298,102.02
BRENTAG AG	7,392	39.30	290,505.60
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	5.77	316,161.30
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,583	22.96	587,385.68
DASSAULT AVIATION SA	172	785.00	135,020.00
EIFFAGE SA	3,488	70.18	244,787.84
FERROVIAL SA	23,480	22.00	516,560.00
GEA GROUP AG	8,178	20.63	168,712.14
HOCHTIEF AG	825	66.80	55,110.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,632	45.16	344,661.12
KION GROUP AG	3,179	43.74	139,049.46
KNORR-BREMSE AG	2,328	79.67	185,471.76
KONE OYJ-B	18,168	53.66	974,894.88
LEGRAND SA	13,198	58.40	770,763.20
LEONARDO SPA	18,310	6.12	112,203.68
METSO OYJ	5,880	22.83	134,240.40
MTU AERO ENGINES AG	2,496	107.95	269,443.20
PRYSMIAN SPA	11,926	16.03	191,173.78
SAFRAN SA	17,246	76.18	1,313,800.28
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,687	80.18	2,300,123.66
SIEMENS AG-REG	39,518	78.44	3,099,791.92
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	13.43	154,203.26
THALES SA	5,403	68.18	368,376.54
VINCI S.A.	25,765	69.94	1,802,004.10
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	6.28	118,748.64
BUREAU VERITAS SA	17,817	18.01	320,884.17
RANDSTAD NV	5,121	33.92	173,704.32
TELEPERFORMANCE	2,970	189.50	562,815.00
WOLTERS KLUWER-CVA	14,578	67.74	987,513.72

AENA SME SA	3,556	113.60	403,961.60
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	86.25	116,092.50
ATLANTIA SPA	26,501	13.88	367,966.38
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,574	7.18	119,001.32
DEUTSCHE POST AG-REG	50,830	26.11	1,327,171.30
FRAPORT AG	1,856	35.72	66,296.32
GETLINK	22,311	11.27	251,444.97
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	16,789	48.66	816,952.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	39.64	99,417.12
CONTINENTAL AG	5,578	69.74	389,009.72
DAIMLER AG	48,163	27.56	1,327,372.28
FAURECIA	3,127	31.16	97,437.32
FERRARI NV	6,200	144.05	893,110.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	52,499	7.35	385,867.65
MICHELIN (CGDE)-B	8,746	82.40	720,670.40
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	17.67	97,336.22
PIRELLI & C SPA	17,484	3.35	58,693.78
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	7,765	42.20	327,683.00
PSA PEUGEOT CITROEN	28,139	12.38	348,501.51
RENAULT SA	8,830	16.00	141,297.66
VALEO SA	14,048	17.43	244,856.64
VOLKSWAGEN AG	1,984	128.00	253,952.00
VOLKSWAGEN AG PFD	9,869	117.36	1,158,225.84
ADIDAS AG	9,273	205.40	1,904,674.20
ESSILORLUXOTTICA	14,466	105.00	1,518,930.00
HERMES INTERNATIONAL	1,676	674.40	1,130,294.40
KERING	4,004	451.35	1,807,205.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	14,191	340.85	4,837,002.35
MONCLER SPA	10,437	32.58	340,037.46
PUMA SE	3,830	52.98	202,913.40
SEB SA	1,589	114.90	182,576.10
ACCOR SA	10,451	24.60	257,094.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,221	103.20	435,607.20
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-NEW	70	103.20	7,224.00
SODEXO	3,900	67.32	262,548.00
ALTICE NV -A W/I	37,625	3.45	129,806.25
BOLLORE	39,433	2.32	91,563.42
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	9.94	86,771.34
JC DECAUX SA	2,828	16.31	46,124.68
PUBLICIS GROUPE	10,736	26.90	288,798.40
SES	17,687	5.95	105,237.65
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	34.62	75,506.22

UBISOFT ENTERTAINMENT SA	5,382	67.20	361,670.40
VIVENDI SA	44,196	19.65	868,451.40
DELIVERY HERO SE	5,334	74.26	396,102.84
INDITEX	55,558	22.99	1,277,278.42
JUST EAT TAKEAWAY	5,922	88.40	523,504.80
PROSUS NV	25,434	67.50	1,716,795.00
ZALANDO SE	6,626	42.41	281,008.66
CARREFOUR SA	28,378	13.32	377,994.96
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	35.68	65,401.44
COLRUYT NV	2,870	54.70	156,989.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,377	15.74	194,875.86
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	59,452	22.95	1,364,423.40
METRO AG	8,344	7.80	65,133.26
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,845	38.12	1,518,891.40
DANONE	32,081	62.50	2,005,062.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	28,021	6.67	186,956.11
HEINEKEN HOLDING NV	5,512	68.25	376,194.00
HEINEKEN NV	13,143	75.28	989,405.04
KERRY GROUP PLC-A	8,005	103.80	830,919.00
PERNOD-RICARD SA	11,112	135.00	1,500,120.00
REMY COINTREAU	1,273	99.75	126,981.75
BEIERSDORF AG	5,138	94.78	486,979.64
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	67.75	404,738.50
HENKEL AG & CO KGAA	9,043	77.44	700,289.92
L'OREAL	12,765	243.30	3,105,724.50
UNILEVER NV	75,516	45.27	3,418,609.32
BIOMERIEUX	1,779	118.30	210,455.70
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,269	93.10	211,243.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	11,118	69.30	770,477.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,162	37.66	796,960.92
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,048	39.75	1,870,158.00
SARTORIUS AG-VORZUG	1,804	254.20	458,576.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	7,177	39.59	284,173.31
BAYER AG	51,053	59.54	3,039,695.62
EUROFINS SCIENTIFIC	701	442.60	310,262.60
GALAPAGOS NV	2,318	194.75	451,430.50
GRIFOLS S.A.	15,169	31.60	479,340.40
IPSEN	1,498	65.20	97,669.60
MERCK KGAA	6,553	104.50	684,788.50
ORION OYJ	6,379	47.20	301,088.80
QIAGEN N.V.	12,543	38.14	478,390.02
RECORDATI SPA	4,578	38.30	175,337.40

SANOFI	57,442	90.94	5,223,775.48
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	211.60	329,038.00
UCB SA	6,623	82.36	545,470.28
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,916	6.31	119,359.96
AIB GROUP PLC	36,918	0.98	36,456.52
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	2.59	915,041.17
BANCO DE SABADELL SA	242,077	0.35	84,726.95
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	829,065	1.90	1,578,539.76
BANK OF IRELAND GROUP PLC	52,159	1.52	79,281.68
BANKIA SA	82,022	0.89	73,048.79
BANKINTER,S.A.	36,405	3.41	124,395.88
BNP PARIBAS	58,653	26.30	1,542,573.90
CAIXABANK	181,981	1.53	279,977.76
COMMERZBANK AG	46,644	3.07	143,570.23
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	6.54	380,351.88
ERSTE GROUP BANK AG	15,778	17.79	280,769.51
FINECOBANK SPA	32,034	9.21	295,097.20
ING GROEP NV-CVA	205,237	4.60	945,116.38
INTESA SANPAOLO	801,876	1.34	1,077,560.96
KBC GROUPE SA	13,541	44.50	602,574.50
MEDIOBANCA SPA	26,782	5.00	133,963.56
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,862	14.80	116,357.60
SOCIETE GENERALE	41,025	13.51	554,575.95
UNICREDIT SPA	105,606	6.68	706,292.92
AMUNDI SA	3,955	57.55	227,610.25
DEUTSCHE BANK AG -REG	99,560	5.45	542,701.56
DEUTSCHE BOERSE AG	10,031	135.35	1,357,695.85
EURAZEO	1,792	41.68	74,690.56
EXOR NV	6,204	47.85	296,861.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,071	69.40	282,527.40
NATIXIS	45,362	1.91	86,777.50
WENDEL	1,082	76.00	82,232.00
AEGON NV	91,609	2.15	197,234.17
AGEAS	8,765	30.92	271,013.80
ALLIANZ SE-REG	21,519	155.76	3,351,799.44
ASSICURAZIONI GENERALI	52,574	12.37	650,340.38
AXA SA	103,334	14.56	1,504,543.04
CNP ASSURANCES	8,978	8.24	74,023.61
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,058	134.00	409,772.00
MAPFRE SA	46,367	1.57	73,213.49
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,363	199.20	1,466,709.60

NN GROUP NV	15,922	23.73	377,829.06
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.39	196,505.67
SAMPO OYJ-A SHS	21,422	26.89	576,037.58
SCOR SE	7,099	23.48	166,684.52
AROUNDTOWN SA	63,402	4.75	301,730.11
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,144	36.47	661,711.68
VONOVIA SE	26,484	44.61	1,181,451.24
ADYEN NV	490	867.00	424,830.00
AMADEUS IT GROUP SA	21,931	42.73	937,111.63
ATOS SE	4,547	60.90	276,912.30
CAPGEMINI SA	8,059	78.00	628,602.00
DASSAULT SYSTEMES SA	6,666	135.85	905,576.10
EDENRED	12,139	35.68	433,119.52
SAP SE	50,662	106.68	5,404,622.16
WIRECARD AG	5,952	131.48	782,568.96
WORLDLINE SA	6,842	64.68	442,540.56
INGENICO S.A.	3,603	117.50	423,352.50
NOKIA OYJ	295,063	3.08	910,416.88
CELLNEX TELECOM SA	13,299	49.59	659,497.41
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	170,388	12.58	2,144,332.98
ELISA OYJ	6,988	56.02	391,467.76
ILIAD SA	1,016	139.70	141,935.20
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	1.97	342,431.91
ORANGE S.A.	100,867	11.18	1,128,197.39
PROXIMUS SA	7,349	19.32	141,982.68
TELECOM ITALIA SPA	491,982	0.33	165,945.52
TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.33	85,217.14
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	2.53	102,237.21
TELEFONICA S.A.	241,284	3.97	958,621.33
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	30.26	159,439.94
E.ON SE	116,681	8.68	1,013,724.52
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	122,490	3.76	461,664.81
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	28,638	6.70	191,989.15
ENAGAS	10,471	20.39	213,503.69
ENDESA S.A.	18,336	19.53	358,102.08
ENEL SPA	420,373	5.90	2,480,200.70
ENGIE	91,950	9.24	850,169.70
FORTUM OYJ	24,312	14.86	361,276.32
IBERDROLA SA	317,605	8.72	2,771,421.23
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	15.12	233,437.68
RED ELECTRICA CORPORATION SA	23,632	14.89	351,998.64
RWE AG	29,609	25.03	741,113.27

	SNAM SPA	106,707	3.86	411,995.72
	SUEZ	18,986	9.61	182,493.43
	TERNA SPA	67,555	5.58	377,497.34
	UNIPER SE	11,709	24.20	283,357.80
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	28,561	18.70	534,233.50
	VERBUND AG	2,458	38.18	93,846.44
	ASML HOLDING NV	21,914	266.70	5,844,463.80
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	63,610	15.33	975,141.30
	STMICROELECTRONICS NV	35,518	22.63	803,772.34
	ユーロ 小計	10,154,350		164,190,920.94 (19,101,971,742)
英ポンド	BP PLC	1,045,687	3.08	3,226,990.08
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	216,119	13.79	2,980,713.24
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	191,963	13.48	2,588,429.09
	ANGLO AMERICAN PLC	51,260	13.97	716,512.28
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.70	149,835.81
	BHP GROUP PLC	110,160	12.87	1,417,979.52
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,626	47.59	315,331.34
	EVRAZ PLC	28,275	2.46	69,641.32
	GLENCORE PLC	538,015	1.39	749,347.29
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.18	193,219.32
	MONDI PLC	25,128	13.20	331,689.60
	RIO TINTO PLC	58,423	37.50	2,190,862.50
	ASHTED GROUP PLC	23,686	18.30	433,453.80
	BAE SYSTEMS PLC	173,381	5.05	875,574.05
	BUNZL PLC	17,064	17.19	293,415.48
	DCC PLC	4,734	53.76	254,499.84
	FERGUSON PLC	11,206	53.80	602,882.80
	MEGGITT PLC	36,960	2.53	93,582.72
	MELROSE INDUSTRIES PLC	246,349	0.89	219,546.22
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	86,917	3.10	269,616.53
	SMITHS GROUP PLC	24,168	11.84	286,149.12
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	86.14	317,425.90
	WEIR GROUP PLC/THE	16,710	8.43	140,865.30
	EXPERIAN PLC	44,915	22.58	1,014,180.70
	G4S PLC	74,291	0.85	63,191.92
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	47.26	386,775.84
	RELX PLC	100,974	17.38	1,755,432.99
	RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	4.41	399,515.42
	EASYJET PLC	7,630	5.73	43,719.90
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,694	5.17	241,781.53
	BURBERRY GROUP PLC	23,066	12.91	297,782.06

PERSIMMON PLC	16,916	21.93	370,967.88
TAYLOR WIMPEY PLC	147,698	1.51	223,836.31
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7,187	43.32	311,340.84
CARNIVAL PLC	8,091	8.49	68,708.77
COMPASS GROUP PLC	78,344	12.66	992,226.76
GVC HOLDINGS PLC	23,842	6.98	166,607.89
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9,999	33.62	336,166.38
TUI AG-DI	17,636	2.75	48,499.00
WHITBREAD PLC	6,801	26.51	180,294.51
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	4.50	189,238.50
INFORMA PLC	70,487	4.14	292,098.12
ITV PLC	215,062	0.68	147,102.40
PEARSON PLC	39,623	4.32	171,527.96
WPP PLC	63,987	5.45	348,729.15
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	4.93	142,308.66
KINGFISHER PLC	109,678	1.46	160,129.88
MARKS & SPENCER GROUP PLC	84,084	0.90	76,365.08
NEXT PLC	6,860	44.82	307,465.20
OCADO GROUP PLC	22,177	16.06	356,273.50
SAINSBURY (J) PLC	112,814	2.01	227,545.83
TESCO PLC	527,322	2.36	1,245,007.24
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	146,235	1.88	275,214.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	18.88	316,720.33
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	117,926	29.55	3,484,713.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	19.75	171,904.00
DIAGEO PLC	120,650	26.55	3,203,257.50
IMPERIAL BRANDS PLC	45,288	15.46	700,378.92
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,076	65.34	2,357,205.84
UNILEVER PLC	56,404	40.92	2,308,051.68
NMC HEALTH PLC	3,940	7.66	30,200.10
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	15.26	676,857.30
ASTRAZENECA PLC	67,156	82.04	5,509,478.24
GLAXOSMITHKLINE PLC	256,292	16.87	4,325,183.79
BARCLAYS PLC	863,463	0.88	765,114.56
HSBC HOLDINGS PLC	1,034,027	4.02	4,158,339.58
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,756,526	0.29	1,117,003.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	245,244	1.04	256,525.22
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	3.76	551,509.04
3I GROUP PLC	49,338	7.37	364,015.76
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	14.65	286,827.66
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	15,570	74.40	1,158,408.00
M&G PLC	133,064	1.25	166,330.00

	SCHRODERS PLC	6,213	25.34	157,437.42
	ST JAMES'S PLACE PLC	23,417	7.85	183,823.45
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	123,263	2.04	252,072.83
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	23.08	266,227.80
	AVIVA PLC	198,601	2.30	457,576.70
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.67	168,981.63
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	302,263	1.85	561,453.52
	PRUDENTIAL PLC	138,100	10.25	1,416,215.50
	RSA INSURANCE GROUP PLC	52,295	3.47	181,568.24
	AVEVA GROUP PLC	3,527	32.41	114,310.07
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	15,111	3.70	55,910.70
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	6.09	341,408.72
	HALMA PLC	19,839	20.79	412,452.81
	BT GROUP PLC	419,350	1.15	484,139.57
	VODAFONE GROUP PLC	1,419,322	1.09	1,551,602.81
	CENTRICA PLC	254,915	0.32	82,286.56
	NATIONAL GRID PLC	175,047	9.39	1,644,041.42
	SEVERN TRENT PLC	14,253	23.71	337,938.63
	SSE PLC	55,879	12.05	673,621.34
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	8.93	296,804.16
	英ポンド 小計	15,550,431		71,105,495.34 (9,464,852,484)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	17.85	180,302.85
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	392	633.00	248,136.00
	GIVAUDAN-REG	484	3,262.00	1,578,808.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	26,329	36.25	954,426.25
	SIKA AG	6,470	161.00	1,041,670.00
	ABB LTD	97,696	16.81	1,642,758.24
	GEBERIT AG-REG	1,986	403.00	800,358.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	208.00	195,728.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,102	216.00	454,032.00
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	39.01	273,811.19
	SGS SA	308	2,181.00	671,748.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,030	140.10	424,503.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	26,223	52.24	1,369,889.52
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,692	183.80	310,989.60
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	35.90	90,324.40
	DUFREY AG-REG	2,262	26.08	58,992.96
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	144	1,933.00	278,352.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	49	7,810.00	382,690.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	82,100.00	410,500.00
	NESTLE SA-REGISTERED	153,361	106.56	16,342,148.16

	ALCON INC	21,063	51.34	1,081,374.42
	SONOVA HOLDING AG	2,643	175.50	463,846.50
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	460	751.40	345,644.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,995	424.80	1,697,076.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	110,441	85.97	9,494,612.77
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	36,084	347.45	12,537,385.80
	VIFOR PHARMA AG	2,638	145.75	384,488.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	132,838	7.74	1,028,963.14
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,877	34.01	437,946.77
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	66.70	124,528.90
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	718.80	699,392.40
	UBS GROUP AG	201,356	9.09	1,831,534.17
	BALOISE HOLDING AG	2,475	140.10	346,747.50
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,735	322.50	559,537.50
	SWISS RE AG	15,168	67.48	1,023,536.64
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,520	287.00	2,158,240.00
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	90.20	352,321.20
	TEMENOS GROUP AG-REG	3,131	118.85	372,119.35
	SWISSCOM AG-REG	1,239	511.00	633,129.00
	スイスフラン 小計	905,519		63,282,592.73 (6,990,195,192)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	225.70	1,936,731.70
	BOLIDEN AB	13,086	201.70	2,639,446.20
	ALFA LAVAL AB	13,939	168.50	2,348,721.50
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	191.00	9,954,729.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	34,434	345.00	11,879,730.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	308.90	6,112,204.30
	EPIROC AB-A	29,626	100.70	2,983,338.20
	EPIROC AB-B	25,132	99.70	2,505,660.40
	SANDVIK AB	61,070	142.45	8,699,421.50
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	171.90	2,700,720.90
	SKF AB-B SHARES	20,607	154.55	3,184,811.85
	VOLVO AB-B SHS	75,703	116.20	8,796,688.60
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	110.80	1,786,428.40
	ELECTROLUX AB-SER B	13,883	127.00	1,763,141.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	61.76	1,148,303.68
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,437	124.75	4,795,015.75
	ICA GRUPPEN AB	5,614	456.60	2,563,352.40
	SWEDISH MATCH AB	9,284	624.80	5,800,643.20
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,351	303.80	8,916,833.80
	NORDEA BANK ABP	167,942	55.17	9,265,360.14
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	88,317	68.34	6,035,583.78

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	84.00	6,524,112.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	111.38	5,114,680.98	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,879	194.05	2,111,069.95	
	INVESTOR AB-B SHS	23,614	476.70	11,256,793.80	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	191.75	2,158,529.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	395.00	1,330,360.00	
	ERICSSON LM-B SHS	161,331	81.10	13,083,944.10	
	HEXAGON AB-B SHS	13,203	438.60	5,790,835.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,238	262.00	1,110,356.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	128.50	3,281,504.50	
	TELIA CO AB	151,710	33.86	5,136,900.60	
	スウェーデンクローナ 小計	1,286,065		162,715,953.78 (1,742,687,864)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	5,392	155.95	840,882.40	
	EQUINOR ASA	50,788	133.00	6,754,804.00	
	NORSK HYDRO ASA	64,344	22.50	1,447,740.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	342.90	3,087,814.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	196.30	1,075,724.00	
	MOWI ASA	22,242	170.45	3,791,148.90	
	ORKLA ASA	43,456	92.86	4,035,324.16	
	DNB ASA	44,508	109.45	4,871,400.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,066	185.10	2,048,316.60	
	TELENOR ASA	37,498	152.60	5,722,194.80	
	ノルウェークローネ 小計	293,779		33,675,349.96 (341,468,048)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	606.60	3,341,759.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	318.10	3,661,967.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,581	561.40	5,378,773.40	
	ISS A/S	8,523	91.98	783,945.54	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	6,000.00	1,008,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	388	6,378.00	2,474,664.00	
	DSV PANALPINA A S	10,873	660.00	7,176,180.00	
	PANDORA A/S	4,763	228.10	1,086,440.30	
	CARLSBERG AS-B	5,585	807.40	4,509,329.00	
	COLOPLAST-B	6,052	1,074.50	6,502,874.00	
	DEMANT A/S	4,455	160.00	712,800.00	
	GENMAB A/S	3,294	1,661.00	5,471,334.00	
	H LUNDBECK A/S	2,896	240.70	697,067.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	91,765	446.45	40,968,484.25	
	DANSKE BANK A/S	32,789	71.30	2,337,855.70	
TRYG A/S	5,752	177.10	1,018,679.20		
ORSTED A/S	9,592	713.40	6,842,932.80		

	デンマーククローネ 小計	213,497		93,973,085.99 (1,465,980,141)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	13,386	22.43	300,247.98
	OIL SEARCH LTD	70,573	2.61	184,195.53
	ORIGIN ENERGY LIMITED	89,306	4.84	432,241.04
	SANTOS LTD	84,526	4.34	366,842.84
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,659	17.36	132,960.24
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,112	20.36	938,840.32
	WORLEY LIMITED	31,142	6.90	214,879.80
	ALUMINA LTD	106,977	1.50	160,465.50
	BHP GROUP LTD	152,583	30.54	4,659,884.82
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	9.68	223,501.52
	BORAL LIMITED	75,397	2.45	184,722.65
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	70,101	11.45	802,656.45
	INCITEC PIVOT LTD	61,355	2.08	127,618.40
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	27,158	17.81	483,683.98
	NEWCREST MINING LIMITED	37,503	28.53	1,069,960.59
	ORICA LIMITED	17,981	16.68	299,923.08
	RIO TINTO LIMITED	19,336	87.27	1,687,452.72
	SOUTH32 LTD	235,718	1.84	434,899.71
	CIMIC GROUP LTD	4,062	21.84	88,714.08
	BRAMBLES LIMITED	74,644	10.79	805,408.76
	SEEK LIMITED	18,186	15.64	284,429.04
	AURIZON HOLDINGS LTD	120,139	4.50	540,625.50
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	45,831	3.39	155,367.09
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31,541	21.66	683,178.06
	CROWN RESORTS LTD	21,863	8.35	182,556.05
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	9.12	24,168.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	104,040	2.78	289,231.20
	REA GROUP LTD	2,556	80.27	205,170.12
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	33,543	2.62	87,882.66
	WESFARMERS LIMITED	59,674	36.65	2,187,052.10
	COLES GROUP LIMITED	66,443	16.14	1,072,390.02
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,824	35.89	2,362,423.36
COCA-COLA AMATIL LIMITED	23,442	8.20	192,224.40	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	9.71	354,065.44	
COCHLEAR LIMITED	2,927	179.26	524,694.02	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	61.94	585,085.24	
SONIC HEALTHCARE LTD	21,081	24.48	516,062.88	
CSL LIMITED	23,588	313.75	7,400,735.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	145,659	16.02	2,333,457.18	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	5.80	115,077.80	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	91,374	58.88	5,380,101.12	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	154,272	15.76	2,431,326.72	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	186,708	15.33	2,862,233.64	
	AMP LIMITED	223,504	1.30	290,555.20	
	ASX LTD	9,287	81.49	756,797.63	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	4.05	93,239.10	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,904	95.01	1,606,049.04	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	46.41	268,389.03	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,187	5.86	686,715.82	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.61	335,969.64	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	67,004	7.89	528,661.56	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	8.92	570,282.36	
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,967	10.97	306,797.99	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	16.24	128,442.16	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	216,943	3.05	661,676.15	
	TPG TELECOM LTD	17,758	7.37	130,876.46	
	AGL ENERGY LIMITED	32,492	17.10	555,613.20	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.87	159,787.50	
	オーストラリアドル 小計	3,579,337		51,448,489.49	(3,547,887,835)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	65,410	3.60	235,476.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	66,024	5.64	372,375.36	
	A2 MILK CO LTD	37,422	19.70	737,213.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,600	28.00	856,800.00	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,962	12.30	196,332.60	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	87,897	4.44	390,262.68	
	MERCURY NZ LTD	30,223	4.36	131,772.28	
	MERIDIAN ENERGY LTD	61,565	4.49	276,426.85	
	ニュージーランドドル 小計	395,103		3,196,659.17	(207,143,514)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	137,424	55.25	7,592,676.00	
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	7.70	535,150.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	70,500	56.45	3,979,725.00	
	MTR CORPORATION	84,500	41.25	3,485,625.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	11.74	316,980.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	118,000	49.30	5,817,400.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	30.95	3,590,200.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.64	611,200.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	13.32	943,056.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	65,000	20.75	1,348,750.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	42,000	27.30	1,146,600.00	
	WH GROUP LIMITED	534,500	7.62	4,072,890.00	

	BANK OF EAST ASIA	87,220	16.08	1,402,497.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	23.50	4,406,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	132.40	5,137,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,300	245.00	15,263,500.00	
	AIA GROUP LTD	616,600	69.55	42,884,530.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	123,924	46.95	5,818,231.80	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.34	1,601,320.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	31.05	2,589,073.20	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	20.95	576,125.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	339,333	8.74	2,965,770.42	
	SINO LAND CO	202,200	10.54	2,131,188.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	84,500	102.60	8,669,700.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	27,000	49.00	1,323,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	21.35	1,131,550.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	29.45	2,120,400.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	37,000	53.30	1,972,100.00	
	PCCW LIMITED	177,000	4.65	823,050.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	45.30	1,359,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	81.40	6,927,140.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.96	883,560.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	550,014	13.68	7,524,191.52	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	71,500	51.35	3,671,525.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	75.85	932,955.00	
	香港ドル 小計	4,592,399		155,554,029.54 (2,159,089,930)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	69,900	5.69	397,731.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	43,720	1.50	65,580.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	99,100	3.23	320,093.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	66,300	0.98	64,974.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	116,700	1.43	166,881.00	
	SATS LTD	26,800	2.99	80,132.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	6.04	151,398.64	
	GENTING SINGAPORE LTD	260,600	0.74	192,844.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	69,050	1.45	100,122.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	20.88	98,136.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	3.39	349,848.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	95,000	18.67	1,773,650.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	179,100	8.65	1,549,215.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	63,900	19.56	1,249,884.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	9.64	343,184.00	
	CAPITALAND LTD	136,600	2.82	385,212.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.43	191,694.00	

	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.76	146,692.00	
	VENTURE CORP LTD	15,200	15.18	230,736.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	441,915	2.70	1,193,170.50	
	シンガポールドドル 小計	1,899,951		9,051,177.64 (684,269,029)	
イスラエルシケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,711	12.55	360,323.05	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	471.00	654,219.00	
	BANK HAPOALIM BM	52,321	23.00	1,203,383.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	19.50	1,367,925.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	11.38	622,190.12	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	72.60	671,477.40	
	AZRIELI GROUP	2,140	205.00	438,700.00	
	NICE LTD	3,251	575.00	1,869,325.00	
	イスラエルシケル 小計	221,885		7,187,542.57 (219,507,550)	
	合 計	56,541,319		186,251,660,602 (186,251,660,602)	

(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 610銘柄	69.2%	71.9%
カナダドル	株式 84銘柄	3.3%	3.5%
ユーロ	株式 238銘柄	9.9%	10.3%
英ポンド	株式 93銘柄	4.9%	5.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.6%	3.8%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	0.9%	0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	1.8%	1.9%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 35銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドドル	株式 20銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシケル	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	308,490.16	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	5,587	835,200.63	
		AMERICAN TOWER CORP	22,771	5,570,014.31	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	66,789	395,390.88	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,853	1,085,378.14
BOSTON PROPERTIES INC	7,835	707,970.60
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902	410,248.38
DIGITAL REALTY TRUST INC	13,726	2,059,311.78
DUKE REALTY CORP	17,347	595,002.10
EQUINIX INC	4,423	3,030,197.30
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	8,664	523,565.52
EQUITY RESIDENTIAL	19,671	1,258,747.29
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332	805,044.52
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,463	574,496.07
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,613	250,236.38
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,237	587,262.51
HOST HOTELS AND RESORTS INC	37,569	417,015.90
INVITATION HOMES INC	30,462	663,462.36
IRON MOUNTAIN INC	14,204	334,220.12
KIMCO REALTY CORPORATION	21,090	181,374.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,595	406,192.65
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,780	615,165.40
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,249	242,933.05
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,454	280,376.28
PROLOGIS INC	38,188	3,400,259.52
PUBLIC STORAGE	8,249	1,544,460.27
REALTY INCOME CORPORATION	17,798	888,476.16
REGENCY CENTERS CORP	8,289	293,679.27
SIMON PROPERTY GROUP INC	16,756	862,766.44
SL GREEN REALTY CORP	3,945	176,420.40
SUN COMMUNITIES INC	4,598	582,750.52
UDR INC	16,633	603,611.57
VENTAS INC	21,118	585,179.78
VEREIT INC	54,273	253,997.64
VICI PROPERTIES INC	23,498	366,098.84
VORNADO REALTY TRUST	8,706	328,825.62
WELLTOWER INC	20,071	884,328.26
WEYERHAEUSER CO	37,766	740,591.26
WP CAREY INC	8,640	507,340.80
米ドル 小計	683,576	34,156,082.68 (3,675,194,496)
カナダドル		
CAN APARTMENT PROP	3,971	182,427.74
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,546	89,156.52
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,144	62,152.80
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	112,656.74

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	72,488.70
カナダドル 小計		28,687	518,882.50 (39,575,168)
ユーロ	COVIVIO	2,388	141,847.20
	GECINA SA	2,189	241,884.50
	ICADE	2,061	142,724.25
	KLEPIERRE	9,305	150,322.27
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,176	360,235.20
ユーロ 小計		23,119	1,037,013.42 (120,646,141)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962	171,260.25
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	205,767.27
	SEGRO PLC	59,061	486,308.27
英ポンド 小計		136,726	863,335.79 (114,918,627)
オーストラリアドル	APA GROUP	68,168	749,848.00
	DEXUS	54,256	474,197.44
	GOODMAN GROUP	86,301	1,117,597.95
	GPT GROUP	97,296	359,995.20
	LENDLEASE GROUP	23,184	238,563.36
	MIRVAC GROUP	200,053	412,109.18
	SCENTRE GROUP	275,200	553,152.00
	STOCKLAND	127,393	338,865.38
	SYDNEY AIRPORT	49,760	276,168.00
	TRANSURBAN GROUP	145,680	1,812,259.20
	VICINITY CENTRES	146,656	188,452.96
オーストラリアドル 小計		1,273,947	6,521,208.67 (449,702,549)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	197,000	2,383,700.00
	LINK REIT	110,100	7,321,650.00
香港ドル 小計		307,100	9,705,350.00 (134,710,258)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	150,400	407,584.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,400	186,472.00
	CAPITALAND MALL TRUST	120,700	202,776.00
	MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	104,900	184,624.00
	SUNTEC REIT	102,700	126,321.00
シンガポールドル 小計		609,100	1,107,777.00 (83,747,941)
合計			4,618,495,180 (4,618,495,180)

（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 39銘柄	1.9%	79.6%
カナダドル	投資証券 5銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	2.6%
英ポンド	投資証券 3銘柄	0.1%	2.5%
オーストラリアドル	投資証券 11銘柄	0.2%	9.7%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.9%
シンガポールドル	投資証券 5銘柄	0.0%	1.8%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
（単位：円）		
資産の部		
流動資産		
預金	40,395,507	136,683,620
金銭信託	819,944,438	646,925,215
コール・ローン	264,889,127	663,214,708
株式	2,983,396,437	3,662,360,965
投資信託受益証券	205,443,266	411,445,602
投資証券	16,033,917	119,441,221
派生商品評価勘定	212,613,737	101,259,570
現先取引勘定	3,000,720,000	-
未収入金	-	132,763
未収配当金	3,196,279	4,237,599
前払金	-	6,878,868
差入委託証拠金	907,222,865	650,095,027
流動資産合計	8,453,855,573	6,402,675,158
資産合計	8,453,855,573	6,402,675,158
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,805,238	31,112,301
前受金	160,746,345	-
未払金	844	-
未払解約金	335,678,000	4,770,000
未払利息	776	1,913
その他未払費用	132,913	96,472
流動負債合計	498,364,116	35,980,686
負債合計	498,364,116	35,980,686
純資産の部		
元本等		
元本	5,742,636,631	5,713,549,870
剰余金		

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
剰余金又は欠損金()	2,212,854,826	653,144,602
元本等合計	7,955,491,457	6,366,694,472
純資産合計	7,955,491,457	6,366,694,472
負債純資産合計	8,453,855,573	6,402,675,158

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,742,636,631口	5,713,549,870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)	1.3853円 (13,853円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.1143円 (11,143円)
----------------	--------------------------------	----------------------	--------------------------------	----------------------

(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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	(2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
	MSCIE 1906	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	米ドル	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	売建	417,000,000	-	416,865,299	134,701
	米ドル	417,000,000	-	416,865,299	134,701
合計		9,175,193,317	-	9,385,732,414	210,808,499

（2020年 4月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,172,770,028	-	2,165,891,160	6,878,868
	MSCIE 2006	2,172,770,028	-	2,165,891,160	6,878,868
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,262,767,762	-	2,337,596,220	74,828,458
	米ドル	2,262,767,762	-	2,337,596,220	74,828,458
	売建	961,067,762	-	958,870,083	2,197,679
	米ドル	961,000,000	-	958,802,971	2,197,029
	ブラジルリアル	58,380	-	57,750	630
	香港ドル	9,382	-	9,362	20
合計		5,396,605,552	-	5,462,357,463	70,147,269

（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 2019年 4月27日
至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,878,626,011円
同期中における追加設定元本額	4,007,992,951円
同期中における一部解約元本額	1,143,982,331円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC つみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,216,433,946円
三井住友・DC 新興国株式インデックスファンド	1,366,945,879円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,011,050,786円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	966,886,784円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	929,156,206円
イオン・バランス戦略ファンド	34,214,964円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド2050	7,300,944円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	12,743,929円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	8,973,559円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	41,732,939円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	32,975,659円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	77,343,543円
三井住友・DC つみたてNISA・世界分散ファンド	15,269,337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>	21,608,156円
合計	5,742,636,631円

(2020年 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,742,636,631円
同期中における追加設定元本額	3,557,523,267円
同期中における一部解約元本額	3,586,610,028円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	2,454,605,033円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,776,810,273円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	198,129,473円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	458,657,103円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	338,056,722円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,268,525円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	40,284,077円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	27,674,839円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	125,402,862円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	82,725,406円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	144,452,900円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	36,039,470円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,548,148円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,895,039円
合計	5,713,549,870円

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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	6,800	0.62	4,222.80	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,387	3.30	4,577.10	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	1,867	7.30	13,629.10	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	673	30.75	20,694.75	
	51JOB INC-ADR	189	64.51	12,192.39	
	BEST INC-ADR	1,816	5.50	9,988.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,399	28.89	69,307.11	
	NIO INC-ADR	5,143	2.94	15,120.42	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,038	28.91	30,008.58	
	LUCKIN COFFEE INC - ADR	659	4.39	2,893.01	

	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,117	110.15	123,037.55	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	3,019	47.39	143,070.41	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,766	43.95	121,565.70	
	58.COM INC-ADR	787	51.38	40,436.06	
	AUTOHOME INC-ADR	493	73.88	36,422.84	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,151	100.95	217,143.45	
	HUYA INC-ADR	492	16.21	7,975.32	
	IQIYI INC-ADR	1,087	17.76	19,305.12	
	JOYY INC	421	59.33	24,977.93	
	MOMO INC-SPON ADR	1,091	23.12	25,223.92	
	NETEASE.COM INC -ADR	557	348.95	194,365.15	
	SINA CORP	556	33.48	18,614.88	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	840	10.75	9,030.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	488	36.49	17,807.12	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	13,616	204.36	2,782,565.76	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	263	30.18	7,937.34	
	JD.COM INC-ADR	5,781	45.05	260,434.05	
	PINDUODUO INC-ADR	1,513	49.57	74,999.41	
	TRIP.COM GROUP-ADR	3,689	23.78	87,724.42	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	3,446	16.09	55,446.14	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	475	20.95	9,951.25	
	ZAI LAB LTD-ADR	293	63.45	18,590.85	
	BANCO MACRO SA-ADR	320	14.51	4,643.20	
	CREDICORP LTD	519	134.21	69,654.99	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	709	6.10	4,324.90	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	231	25.62	5,918.22	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	7,080	0.80	5,678.16	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	445	59.40	26,433.00	
	GLOBANT SA	258	105.87	27,314.46	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	892	6.70	5,976.40	
	米ドル 小計	77,366		4,629,201.26 (498,102,055)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	115,600	4.63	535,228.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	28,400	47.22	1,341,048.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,195	178.04	212,757.80	
	ORBIA ADVANCE CO SAB DE CV	8,600	25.99	223,514.00	
	ALFA S.A.B. -A	22,000	8.62	189,640.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,600	47.13	169,668.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	1,485	235.71	350,029.35	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,000	135.65	406,950.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	1,750	154.93	271,127.50	
	ALSEA SAB DE CV	3,800	21.48	81,624.00	

	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	17,400	25.08	436,392.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	1,584	59.59	94,390.56	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	1,600	58.71	93,936.00	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	41,800	57.04	2,384,272.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	2,900	90.32	261,928.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	4,500	97.44	438,480.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	15,500	141.73	2,196,815.00	
	GRUMA S.A.B. -B	1,505	229.78	345,818.90	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	10,700	32.63	349,141.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	12,100	34.40	416,240.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	20,700	61.12	1,265,184.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	20,200	15.03	303,606.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	266,500	13.61	3,627,065.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	4,300	70.35	302,505.00	
	メキシコペソ 小計	610,719		16,297,360.11	(70,241,622)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,300	56.14	72,982.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	29,500	16.07	474,065.00	
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	33,300	15.95	531,135.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	6,100	13.49	82,289.00	
	BRASKEM SA-PREF A	1,800	18.93	34,074.00	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. -CSN	5,300	7.08	37,524.00	
	GERDAU S.A. -PREF	8,700	10.93	95,091.00	
	SUZANO SA	4,515	39.13	176,671.95	
	VALE SA	25,000	43.76	1,094,000.00	
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	5,000	8.28	41,400.00	
	WEG SA	6,730	38.71	260,518.30	
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	10,100	12.04	121,604.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	4,900	32.98	161,602.00	
	RUMO SA	9,000	20.55	184,950.00	
	COGNA EDUCACAO	14,100	4.61	65,001.00	
	B2W CIA DIGITAL	1,561	68.68	107,209.48	
	LOJAS AMERICANAS SA	5,900	22.50	132,750.00	
	LOJAS RENNER S.A.	5,980	37.67	225,266.60	
	MAGAZINE LUIZA SA	5,900	47.38	279,542.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	5,800	16.94	98,252.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	3,100	19.99	61,969.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	1,300	67.30	87,490.00	
	RAIA DROGASIL SA	1,800	104.54	188,172.00	
	AMBEV SA	37,000	11.11	411,070.00	
	BRF-BRASIL FOODS SA	4,500	18.55	83,475.00	
	JBS SA	8,300	21.54	178,782.00	

	NATURA &CO HOLDING SA	5,100	33.23	169,473.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,800	50.00	90,000.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	3,900	52.04	202,956.00	
	HYPERMARCAS SA	2,700	30.01	81,027.00	
	BANCO BRADESCO S.A. -PREF	34,742	17.84	619,797.28	
	BANCO BRADESCO SA	9,908	15.93	157,834.44	
	BANCO DO BRASIL S.A.	6,400	24.30	155,520.00	
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	38,000	20.88	793,440.00	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	34,580	8.40	290,472.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,700	37.50	63,750.00	
	BM&F BOVESPA SA	16,100	37.00	595,700.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	5,100	24.40	124,440.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,100	9.07	46,257.00	
	PORTO SEGURO SA	600	43.84	26,304.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,300	9.30	58,590.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	2,400	20.58	49,392.00	
	CIELO SA	9,300	4.08	37,944.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	3,400	45.51	154,734.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	7,200	12.20	87,840.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	2,200	21.78	47,916.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	1,600	24.93	39,888.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,500	8.75	65,625.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	2,600	37.77	98,202.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,100	42.47	46,717.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,350	38.23	51,610.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	6,500	17.94	116,610.00	
	ブラジルリアル 小計	463,666		9,558,924.55 (184,009,297)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	3,327	5,024.00	16,714,848.00	
	EMPRESAS CMPC SA	8,980	1,705.00	15,310,900.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	921	18,200.00	16,762,200.00	
	LATAM AIRLINES GROUP	1,840	2,965.10	5,455,784.00	
	FALABELLA SA	5,234	2,075.00	10,860,550.00	
	CENCOSUD SA	12,537	954.00	11,960,298.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	883	5,750.00	5,077,250.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	1,886	1,715.10	3,234,678.60	
	BANCO DE CHILE	380,926	67.70	25,788,690.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	353	27,500.00	9,707,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	567,731	30.99	17,593,983.69	
	ITAU CORPBANCA	1,230,978	2.20	2,708,151.60	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,200	4,360.10	5,232,120.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	20,335	250.00	5,083,750.00	

	COLBUN SA	61,705	113.00	6,972,665.00	
	ENEL AMERICAS SA	286,610	134.20	38,463,062.00	
	ENEL CHILE SA	227,542	61.10	13,902,816.20	
	チリペソ 小計	2,812,988		210,829,247.29	(26,416,904)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	41,073	1,910.00	78,449,430.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,250	9,110.00	20,497,500.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,718	23,040.00	39,582,720.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,564	24,200.00	86,248,800.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	28,377	820.00	23,269,140.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	1,916	21,360.00	40,925,760.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,245	18,300.00	59,383,500.00	
	コロンビアペソ 小計	82,143		348,356,850.00	(9,266,292)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) CORINTH REFINERIES SA	599	12.98	7,775.02	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	334	11.74	3,921.16	
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.22	519.06	
	OPAP SA	1,325	7.94	10,527.12	
	JUMBO S.A.	802	13.60	10,907.20	
	ALPHA BANK AE	11,891	0.60	7,201.18	
	EUROBANK ERGASIAS SEEVICES & HOLDINGS SA	19,175	0.33	6,477.31	
	NATIONAL BANK OF GREECE	4,254	1.14	4,862.32	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,878	11.38	21,371.64	
	ユーロ 小計	40,381		73,562.01	(8,558,204)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	1,004	85.60	85,942.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	12,606	7.96	100,343.76	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,111	26.68	56,321.48	
	KOC HOLDING AS	6,107	14.66	89,528.62	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,755	18.07	31,712.85	
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	4,473	10.27	45,937.71	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	734	58.70	43,085.80	
	ARCELIK AS	866	15.26	13,215.16	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,989	56.00	167,384.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	2,205	18.05	39,800.25	
	AKBANK T.A.S.	20,175	5.74	115,804.50	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,240	8.12	131,868.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	9,681	4.84	46,856.04	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,157	7.81	55,896.17	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	8,901	13.61	121,142.61	
	トルコリラ 小計	97,004		1,144,840.15	(17,676,331)

チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	547	518.00	283,346.00
	MONETA MONEY BANK AS	3,975	51.90	206,302.50
	CEZ AS	1,346	460.50	619,833.00
チェココルナ 小計		5,868		1,109,481.50 (4,748,580)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	3,501	2,010.00	7,037,010.00
	RICHTER GEDEON NYRT	1,084	6,560.00	7,111,040.00
	OTP BANK PLC	1,711	8,400.00	14,372,400.00
ハンガリーフォリント 小計		6,296		28,520,450.00 (9,314,778)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	546	62.14	33,928.44
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,258	60.84	137,376.72
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	14,344	3.65	52,355.60
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,106	72.80	80,516.80
	CCC SA	282	43.80	12,351.60
	LPP SA	9	5,920.00	53,280.00
	AMREST HOLDINGS SE	739	25.05	18,511.95
	CD PROJEKT SA	557	363.40	202,413.80
	CYFROWY POLSAT SA	2,338	25.16	58,824.08
	DINO POLSKA SA	366	175.00	64,050.00
	BANK MILLENNIUM SA	4,887	2.72	13,302.41
	BANK PEKAO SA	1,434	49.31	70,710.54
	MBANK SA	79	212.00	16,748.00
	PKO BANK POLSKI SA	7,143	20.82	148,717.26
	SANTANDER BANK POLSKA SA	253	145.30	36,760.90
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,783	29.91	143,059.53
	ORANGE POLSKA SA	4,301	6.90	29,676.90
	PGE SA	7,070	4.05	28,654.71
ポーランドズロチ 小計		52,495		1,201,239.24 (30,811,786)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	11,000	2.04	22,440.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	14,000	5.71	79,940.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	204,000	3.74	762,960.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	25,500	13.64	347,820.00
	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	8,000	5.07	40,560.00
	CNOOC LTD	142,000	8.51	1,208,420.00
	PETROCHINA CO LTD	158,000	2.69	425,020.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	10,000	5.83	58,300.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	40,000	1.52	60,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	9,500	58.20	552,900.00
	BBMG CORPORATION - H	9,000	1.92	17,280.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	11,500	3.44	39,560.00

CHINA MOLYBDENUM CO LTD	36,000	2.17	78,120.00
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	28,000	9.22	258,160.00
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	18,000	10.12	182,160.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	8,800	1.69	14,872.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	7,000	7.26	50,820.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	13,000	4.73	61,490.00
MAANSHAN IRON&STEEL-H	6,000	2.23	13,380.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	14,000	7.10	99,400.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	18,000	2.15	38,700.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	10,000	9.34	93,400.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	42,000	3.48	146,160.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	13,000	3.03	39,390.00
BOC AVIATION LTD	1,900	52.10	98,990.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	31,000	5.05	156,550.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	5.43	108,600.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	12,500	35.95	449,375.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	10,000	10.70	107,000.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	28,000	4.54	127,120.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	14,500	8.39	121,655.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	18,000	5.85	105,300.00
CITIC LIMITED	44,000	7.40	325,600.00
CRRG CORP LTD-H	31,000	4.00	124,000.00
FOSUN INTERNATIONAL	18,000	9.57	172,260.00
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	4,000	13.70	54,800.00
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	1.32	14,520.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	26,000	2.30	59,800.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	5,000	12.36	61,800.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	7,500	3.47	26,025.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,500	15.52	100,880.00
WEICHAI POWER CO	14,000	13.48	188,720.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,618	7.15	47,318.70
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	4,000	24.10	96,400.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	6.04	78,520.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3,500	38.25	133,875.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	26,000	4.38	113,880.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	10,000	35.55	355,500.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	10,000	9.39	93,900.00
AIR CHINA/HONG KONG	16,000	5.45	87,200.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	10,000	5.14	51,400.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	22,000	2.06	45,320.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	18,000	3.10	55,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	10,140	9.02	91,462.80

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	8,000	3.71	29,680.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	10,000	3.75	37,500.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	10,000	8.77	87,700.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	6,000	8.03	48,180.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	8,000	14.20	113,600.00
SINOTRANS LIMITED	8,000	1.76	14,080.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	5.12	61,440.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	15,500	3.23	50,065.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	22,000	6.79	149,380.00
BYD CO LTD-H	5,500	43.40	238,700.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	20,000	4.91	98,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	4,800	16.48	79,104.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	41,000	11.42	468,220.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	25,000	4.91	122,750.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	21,200	6.50	137,800.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	5,000	3.80	19,000.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	9,000	64.00	576,000.00
BOSIDENG INTL HOLDGS LTD	26,000	2.10	54,600.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	9,000	20.80	187,200.00
LI NING COMPANY LIMITED	16,500	23.40	386,100.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,100	87.05	531,005.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	4,000	12.96	51,840.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LIMITED	3,000	11.88	35,640.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	3,000	32.55	97,650.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	110,000	0.93	102,300.00
CHINA LITERATURE LTD	1,400	30.15	42,210.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	45,000	406.40	18,288,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	99,000	0.90	89,100.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	8,100	99.20	803,520.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	11,000	9.55	105,050.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	4,500	29.80	134,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	17,500	12.64	221,200.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	21,000	27.45	576,450.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	12,000	35.25	423,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.74	92,430.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	13.88	194,320.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	44.10	176,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	8,000	7.69	61,520.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	42,000	5.63	236,460.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	4,000	60.80	243,200.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	5,500	66.95	368,225.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	30,000	18.34	550,200.00

PING AN HEALTHCARE AND TECHN	2,600	111.20	289,120.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,000	12.06	192,960.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	13.90	107,030.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	11,200	19.28	215,936.00
3SBIO INC	10,500	8.11	85,155.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	10,000	9.25	92,500.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	38,000	15.56	591,280.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	12,000	4.81	57,720.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	22,000	3.37	74,140.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	12.90	77,400.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	30.05	120,200.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	8,000	37.05	296,400.00
LUYE PHARMA GROUP	9,500	3.83	36,385.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	5,000	29.45	147,250.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	56,000	11.22	628,320.00
SSY GROUP LIMITED	10,000	5.81	58,100.00
WUXI APPTTEC CO LTD	1,340	106.60	142,844.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	6,000	115.40	692,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	229,000	3.10	709,900.00
BANK OF CHINA LTD	628,000	2.86	1,796,080.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	67,000	4.69	314,230.00
CHINA CITIC BANK	68,000	3.58	243,440.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	756,000	6.01	4,543,560.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	21,000	2.97	62,370.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	30,500	34.45	1,050,725.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	51,100	5.50	281,050.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	13,000	3.11	40,430.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	513,000	5.06	2,595,780.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	59,000	4.43	261,370.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	64,000	1.40	89,600.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	8,000	10.96	87,680.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	25,500	3.69	94,095.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	92,000	0.82	75,440.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	10,400	10.90	113,360.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	16,000	14.10	225,600.00
FAR EAST HORIZON LTD	18,000	6.09	109,620.00
GF SECURITIES CO LTD-H	10,600	7.98	84,588.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	5,000	10.72	53,600.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	22,800	6.87	156,636.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	14,000	12.50	175,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	58,000	15.84	918,720.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	21,400	24.00	513,600.00

CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	30,000	0.88	26,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	12,600	12.16	153,216.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	7,100	24.65	175,015.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	65,000	2.45	159,250.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	52,000	7.16	372,320.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	44,000	77.30	3,401,200.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	2,800	24.65	69,020.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	12,000	8.14	97,680.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	8.75	78,750.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	15,000	12.90	193,500.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	44,000	5.18	227,920.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	30,000	26.10	783,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	26,000	30.85	802,100.00
CHINA VANKE CO LTD -H	12,300	24.15	297,045.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	22,000	5.56	122,320.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	62,000	9.57	593,340.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	9.30	107,880.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	21,000	2.85	59,850.00
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	8,000	10.96	87,680.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	10,000	11.82	118,200.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	13,500	37.95	512,325.00
SEAZEN GROUP LTD	20,000	6.79	135,800.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	16,000	2.29	36,640.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	9,500	29.95	284,525.00
SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.30	17,550.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	19,000	1.89	35,910.00
SOHO CHINA LTD	7,500	3.52	26,400.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	20,000	32.40	648,000.00
WHARF HOLDINGS LTD	9,000	13.80	124,200.00
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	44,000	1.42	62,480.00
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	17,000	3.17	53,890.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	4.86	68,040.00
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	17,000	11.60	197,200.00
KINGSOFT CORPORATION LTD.	6,000	26.15	156,900.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	8,000	13.24	105,920.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	5,500	37.45	205,975.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,500	16.82	92,510.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	10,000	3.67	36,700.00
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,500	18.68	84,060.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	7,000	7.23	50,610.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	2,000	8.79	17,580.00
LENOVO GROUP LTD	52,000	4.10	213,200.00

	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	5,400	106.50	575,100.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	81,400	10.00	814,000.00	
	ZTE CORPORATION	6,200	22.00	136,400.00	
	CHINA MOBILE LTD	48,500	61.05	2,960,925.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD	106,000	2.62	277,720.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	338,000	1.71	577,980.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	46,000	4.97	228,620.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	3,500	26.40	92,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	36,000	2.94	105,840.00	
	CGN POWER CO LTD-H	93,000	1.94	180,420.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	13,800	25.70	354,660.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP	27,000	3.58	96,660.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	37,000	1.52	56,240.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	8,000	43.05	344,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	16,000	8.95	143,200.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	1.03	12,360.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	6,400	83.30	533,120.00	
	GUANGDONG INVESTMENT	22,000	15.70	345,400.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	12,000	2.37	28,440.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	22,000	2.76	60,720.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	24,000	4.63	111,120.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	3.60	14,400.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	3,000	14.04	42,120.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	22,500	14.04	315,900.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	28,000	4.53	126,840.00	
	香港ドル 小計	6,939,298		72,857,442.50 (1,011,261,301)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	29,200	3.22	94,024.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	1,900	20.30	38,570.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	20,300	5.27	106,981.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	13,100	3.75	49,125.00	
	GAMUDA BHD	13,300	3.20	42,560.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	3,900	7.18	28,002.00	
	IJM CORP BHD	18,500	1.65	30,525.00	
	SIME DARBY BERHAD	23,500	2.00	47,000.00	
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	0.77	4,262.50	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	8,300	5.10	42,330.00	
	MISC BHD	11,800	7.80	92,040.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	3.78	13,986.00	
	GENTING BHD	15,200	3.95	60,040.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	26,600	2.21	58,786.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,200	27.92	33,504.00	

	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	31.26	37,512.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	2,500	9.15	22,875.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	14,000	3.83	53,620.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	3,500	20.30	71,050.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	138.40	83,040.00	
	PPB GROUP BERHAD	4,140	16.12	66,736.80	
	QL RESOURCES BHD	5,300	8.00	42,400.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	15,000	4.71	70,650.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	12,600	7.60	95,760.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	15,600	5.11	79,716.00	
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	13,800	7.17	98,946.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	10,100	2.96	29,896.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	40,900	3.50	143,150.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,700	13.24	62,228.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	12.80	24,320.00	
	MALAYAN BANKING BERHAD	29,600	7.36	217,856.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	24,900	15.82	393,918.00	
	RHB BANK BHD	11,800	4.70	55,460.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	21,900	3.69	80,811.00	
	DIGI.COM BHD	21,800	4.36	95,048.00	
	MAXIS BERHAD	18,700	5.31	99,297.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,200	4.00	32,800.00	
	PETRONAS GAS BHD	6,800	15.26	103,768.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	25,300	12.16	307,648.00	
	YTL CORP BHD	16,000	0.74	11,840.00	
	マレーシアリングット 小計	526,840		3,122,081.30 (77,052,966)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	37,400	5.55	207,570.00	
	IRPC PCL-NVDR	53,200	2.54	135,128.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	10,600	76.25	808,250.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	91,300	34.00	3,104,200.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	9,100	39.50	359,450.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	14,200	26.25	372,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	19,300	36.75	709,275.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	6,300	323.00	2,034,900.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	34,700	58.75	2,038,625.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	54,700	9.10	497,770.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	61,200	10.90	667,080.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	19,400	21.00	407,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	14,091	36.25	510,798.75	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	41,800	13.10	547,580.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	7,300	41.75	304,775.00	

	CP ALL PCL-NVDR	46,700	66.25	3,093,875.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	32,900	27.50	904,750.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	7,000	41.00	287,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	21,900	12.70	278,130.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	70,900	20.60	1,460,540.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	3,200	119.00	380,800.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	3,100	103.00	319,300.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LTD- FOREIGN	8,900	88.50	787,650.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LTD- NVDR	5,500	88.50	486,750.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	29,200	10.50	306,600.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	5,600	67.00	375,200.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	135,700	0.91	123,487.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,200	45.00	189,000.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	6,300	52.00	327,600.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	17,300	47.75	826,075.00	
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	54,800	7.10	389,080.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	8,900	198.50	1,766,650.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	18,900	52.50	992,250.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL -NVDR	4,600	45.00	207,000.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	76,500	3.24	247,860.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	43.75	297,500.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	2,500	266.00	665,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	14,700	39.00	573,300.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	5,800	69.25	401,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	23,000	38.00	874,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	4,800	63.25	303,600.00	
	タイパーツ 小計	1,094,291		29,570,198.75 (97,877,357)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	16,450	40.65	668,692.50	
	AYALA CORPORATION	2,380	550.00	1,309,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	600	443.40	266,040.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	24,130	49.00	1,182,370.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,005	814.00	1,632,070.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	78.00	567,060.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	4,110	134.30	551,973.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,110	118.40	841,824.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	7,737	59.50	460,351.50	
	BDO UNIBANK INC	16,000	100.00	1,600,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,040	39.00	508,560.00	
	SECURITY BANK CORP	2,020	102.00	206,040.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	2.59	287,231.00	
	ALTUS SAN NICOLAS CORP-NEW	146	5.19	757.74	

	AYALA LAND INC	55,900	28.90	1,615,510.00	
	MEGAWORLD CORP	92,000	2.59	238,280.00	
	ROBINSONS LAND CO	17,200	15.50	266,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	76,100	28.65	2,180,265.00	
	GLOBE TELECOM INC	220	2,208.00	485,760.00	
	PLDT INC	530	1,227.00	650,310.00	
	ABOITIZ POWER CORP	12,000	26.55	318,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,350	256.00	345,600.00	
	フィリピンペソ 小計	469,198		16,182,894.74	(34,307,736)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	115,900	875.00	101,412,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	10,400	1,850.00	19,240,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	12,200	16,225.00	197,945,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	208,200	1,240.00	258,168,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	16,100	4,950.00	79,695,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	10,575.00	139,590,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	12,900	4,710.00	60,759,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	21,300	6,700.00	142,710,000.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	23,600	2,550.00	60,180,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	163,900	3,630.00	594,957,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	66,900	1,390.00	92,991,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	53,600	4,080.00	218,688,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	21,200	9,900.00	209,880,000.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	4,000	42,800.00	171,200,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	54,700	1,520.00	83,144,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	35,600	6,325.00	225,170,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	64,200	7,500.00	481,500,000.00	
	KALBE FARMA PT	153,100	1,255.00	192,140,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	62,800	3,800.00	238,640,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	830.00	12,865,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	77,300	24,600.00	1,901,580,000.00	
	PT BANK MANDIRI	150,400	4,280.00	643,712,000.00	
	PT BANK RAKYAT	442,100	2,630.00	1,162,723,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	660.00	18,612,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	350.00	27,790,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	397,200	3,090.00	1,227,348,000.00	
XL AXIATA TBK PT	35,400	2,380.00	84,252,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	65,600	770.00	50,512,000.00		
	インドネシアルピア 小計	2,404,900		8,697,404,000.00	(60,881,828)
韓国ウォン	GS HOLDINGS	421	37,500.00	15,787,500.00	
	S-OIL CORPORATION	310	70,300.00	21,793,000.00	

SK INNOVATION CO LTD	458	97,600.00	44,700,800.00
HANWHA SOLUTIONS CORP	970	14,000.00	13,580,000.00
HYUNDAI STEEL COMPANY	658	18,900.00	12,436,200.00
KCC CORP	30	154,500.00	4,635,000.00
KOREA ZINC CO., LTD.	68	390,000.00	26,520,000.00
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	113	70,800.00	8,000,400.00
LG CHEM LTD	367	353,500.00	129,734,500.00
LG CHEM LTD	63	163,500.00	10,300,500.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	122	212,500.00	25,925,000.00
OCI COMPANY LTD	110	37,800.00	4,158,000.00
POSCO	629	173,000.00	108,817,000.00
POSCO CHEMUCAL CO LTD	201	51,800.00	10,411,800.00
CJ CORP	90	71,700.00	6,453,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	255	81,400.00	20,757,000.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	2,143	3,300.00	7,071,900.00
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE ENGINEERING	415	17,700.00	7,345,500.00
DOOSAN BOBCAT INC	289	22,600.00	6,531,400.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	512	24,100.00	12,339,200.00
HANWHA CORPORATION	165	18,450.00	3,044,250.00
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	192	17,500.00	3,360,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	562	33,000.00	18,546,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	70	229,000.00	16,030,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	596	25,450.00	15,168,200.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	274	76,400.00	20,933,600.00
LG CORP	783	62,000.00	48,546,000.00
LOTTE CORPORATION	108	26,500.00	2,862,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	441	13,350.00	5,887,350.00
SAMSUNG C&T CORPORATION	643	98,700.00	63,464,100.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,267	10,900.00	13,810,300.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	3,170	4,170.00	13,218,900.00
SK HOLDINGS CO LTD	289	175,500.00	50,719,500.00
S1 CORPORATION	106	83,400.00	8,840,400.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	74	146,000.00	10,804,000.00
GLOVIS CO LTD	153	98,300.00	15,039,900.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	295	19,800.00	5,841,000.00
PAN OCEAN CO LTD	2,212	3,370.00	7,454,440.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	611	20,650.00	12,617,150.00
HANON SYSTEMS	1,587	8,760.00	13,902,120.00
HYUNDAI MOBIS	535	169,000.00	90,415,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	1,195	90,100.00	107,669,500.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	265	57,500.00	15,237,500.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	180	55,900.00	10,062,000.00

KIA MOTORS CORPORATION	1,966	27,700.00	54,458,200.00
COWAY CO LTD	364	59,400.00	21,621,600.00
FILA HOLDINGS CORP	358	33,200.00	11,885,600.00
HLB INC	261	95,400.00	24,899,400.00
HLB INC--RIGHTS-NEW	26	28,032.00	728,832.00
LG ELECTRONICS INC	878	52,600.00	46,182,800.00
KANGWON LAND INC	845	24,150.00	20,406,750.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	533	17,100.00	9,114,300.00
KAKAO CORP	420	183,000.00	76,860,000.00
NAVER CORPORATION	1,113	192,500.00	214,252,500.00
NCSOFT CORP	124	653,000.00	80,972,000.00
NETMARBLE CORPORATION	232	90,900.00	21,088,800.00
PEARLABYSS CORP	54	201,100.00	10,859,400.00
CJ ENM CO LTD	57	110,700.00	6,309,900.00
HOTEL SHILLA CO LTD	258	76,900.00	19,840,200.00
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	132	67,500.00	8,910,000.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	60	84,700.00	5,082,000.00
SHINSEGAE CO LTD	63	243,500.00	15,340,500.00
BGF RETAIL CO LTD	61	148,500.00	9,058,500.00
E-MART INC	171	108,500.00	18,553,500.00
GS RETAIL CO LTD	290	31,300.00	9,077,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	70	259,000.00	18,130,000.00
KT&G CORPORATION	872	78,900.00	68,800,800.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	179	121,500.00	21,748,500.00
OTTOGI CORPORATION	4	539,000.00	2,156,000.00
AMOREPACIFIC CORP	268	171,000.00	45,828,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	62,000.00	2,046,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	240	57,600.00	13,824,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	76	1,434,000.00	108,984,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	17	763,000.00	12,971,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	435	85,000.00	36,975,000.00
CELLTRION INC	755	211,500.00	159,682,500.00
HANMI PHARM CO LTD	55	254,000.00	13,970,000.00
HELIXMITH CO LTD	137	66,400.00	9,096,800.00
HELIXMITH CO LTD(NEW)	34	66,400.00	2,257,600.00
MEDY-TOC INC	23	110,000.00	2,530,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	136	591,000.00	80,376,000.00
YUHAN CORPORATION	395	46,950.00	18,545,250.00
BS FINANCIAL GROUP INC	2,009	4,635.00	9,311,715.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	2,246	23,150.00	51,994,900.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	1,867	7,200.00	13,442,400.00
KB FINANCIAL GROUP INC	3,185	31,100.00	99,053,500.00

	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	3,673	27,150.00	99,721,950.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,533	7,850.00	35,584,050.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	303	46,000.00	13,938,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	1,580	2,980.00	4,708,400.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,873	5,150.00	14,795,950.00	
	SAMSUNG CARD CO LTD	310	27,800.00	8,618,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD.	453	27,300.00	12,366,900.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	748	8,680.00	6,492,640.00	
	DB INSURANCE CO LTD	359	42,500.00	15,257,500.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	1,685.00	1,607,490.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	333	25,400.00	8,458,200.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	223	184,500.00	41,143,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	490	46,900.00	22,981,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	288	157,000.00	45,216,000.00	
	KMW CO LTD	241	61,700.00	14,869,700.00	
	LG DISPLAY CO LTD	1,686	10,550.00	17,787,300.00	
	LG INNOTEK CO LTD	115	126,000.00	14,490,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	459	107,500.00	49,342,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	37,472	49,350.00	1,849,243,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,448	42,500.00	274,040,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	440	277,000.00	121,880,000.00	
	LG UPLUS CORP	1,886	12,750.00	24,046,500.00	
	SK TELECOM CO LTD	141	209,500.00	29,539,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	2,129	22,550.00	48,008,950.00	
	KOREA GAS CORPORATION	265	26,250.00	6,956,250.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	4,308	81,400.00	350,671,200.00	
	韓国ウォン 小計	118,009		5,679,761,337.00 (495,843,164)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	11,000	81.00	891,000.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	16,000	41.70	667,200.00	
	CHINA STEEL CORP	88,000	19.15	1,685,200.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	28,000	68.30	1,912,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	36,000	80.00	2,880,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	41,000	57.00	2,337,000.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	40,073	42.00	1,683,066.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	496.00	496,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	25,000	23.75	593,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,060	238.00	490,280.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	7.03	70,300.00	
	EVA AIRWAYS CORP	18,897	9.90	187,080.30	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	22,740	9.94	226,035.60	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	17,000	31.50	535,500.00	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	14,000	30.60	428,400.00
ECLAT TEXTILE CO LTD	2,000	275.00	550,000.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	2,200	146.00	321,200.00
FORMOSA TAFFETA CO LTD	10,000	31.10	311,000.00
GIANT MANUFACTURING CO LTD	2,000	150.50	301,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	209.00	209,000.00
POU CHEN	19,000	26.60	505,400.00
RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	1,200	66.30	79,560.00
TATUNG CO LTD	10,000	21.40	214,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	485.50	971,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	288.00	1,440,000.00
STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	65.90	131,800.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	39,000	66.60	2,597,400.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	46,253	18.90	874,181.70
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	148,000	18.60	2,752,800.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	78,785	25.70	2,024,774.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	74,863	20.60	1,542,177.80
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	60,359	18.05	1,089,479.95
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	87,000	28.20	2,453,400.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	89,760	11.25	1,009,800.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	79,643	11.70	931,823.10
TAIWAN BUSINESS BANK	44,288	10.15	449,523.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	69,276	19.00	1,316,244.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	25,299	40.60	1,027,139.40
CHAILEASE HOLDING CO LTD	8,262	98.70	815,459.40
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	72,000	16.10	1,159,200.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	63,000	37.05	2,334,150.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	107,000	8.40	898,800.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	21,540	19.25	414,645.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	50,000	39.20	1,960,000.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	91,432	8.08	738,770.56
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	40.55	243,300.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,800	41.70	75,060.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	5,000	195.00	975,000.00
ACER INC	18,000	15.65	281,700.00
ADVANTECH CO LTD	3,000	264.50	793,500.00
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	193.00	965,000.00
AU OPTRONICS CORP	78,000	7.45	581,100.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	5,000	219.50	1,097,500.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	4,010	82.20	329,622.00
COMPAL ELECTRONICS	37,000	18.55	686,350.00
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	131.00	1,965,000.00

	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	53.60	375,200.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	97,800	73.80	7,217,640.00	
	INNOLUX DISPLAY CORPORATION	65,000	6.14	399,100.00	
	INVENTEC CORPORATION	24,000	23.10	554,400.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	780	3,740.00	2,917,200.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	15,000	43.80	657,000.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	4,000	92.00	368,000.00	
	PEGATRON CORP	14,000	64.70	905,800.00	
	QUANTA COMPUTER INC	20,000	62.40	1,248,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	38.05	380,500.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	2,000	207.50	415,000.00	
	WISTRON CORPORATION	25,293	26.00	657,618.00	
	WIWYNN CORP	1,000	669.00	669,000.00	
	WPG HOLDINGS CO LTD	9,520	37.30	355,096.00	
	YAGEO CORPORATION	2,198	345.00	758,310.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	4,000	99.30	397,200.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	30,000	108.50	3,255,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	11,000	65.50	720,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	13,000	106.00	1,378,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	27,000	63.10	1,703,700.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	360.00	720,000.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	12,000	348.50	4,182,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	10,000	59.10	591,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	4,000	176.00	704,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	263.50	263,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	98.70	592,200.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	231.50	926,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	193,000	294.00	56,742,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	80,000	15.90	1,272,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	7,000	66.80	467,600.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	251.00	753,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	20,000	13.00	260,000.00	
	新台湾ドル 小計	2,585,331		147,305,636.51 (527,354,178)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,014	350.45	1,757,156.30	
	COAL INDIA LTD	8,717	137.00	1,194,229.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,473	201.40	900,862.20	
	INDIAN OIL CORP LTD	13,301	81.50	1,084,031.50	
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	17,465	67.60	1,180,634.00	
	PETRONET LNG LTD	4,423	218.50	966,425.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	22,471	1,417.00	31,841,407.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	167.95	755,607.05	

ASIAN PAINTS LTD	2,345	1,827.55	4,285,604.75
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,004	519.70	1,041,478.80
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,103	499.05	1,049,502.15
HINDALCO INDUSTRIES LTD	9,223	103.65	955,963.95
JSW STEEL LTD	6,718	153.25	1,029,533.50
PIDILITE INDUSTRIES LTD	886	1,505.20	1,333,607.20
SHREE CEMENT LTD	61	18,587.45	1,133,834.45
TATA STEEL LTD	3,137	267.55	839,304.35
ULTRATECH CEMENT LTD	830	3,307.95	2,745,598.50
UPL LTD	3,725	335.85	1,251,041.25
VEDANTA LTD	13,075	77.95	1,019,196.25
ASHOK LEYLAND LIMITED	10,356	44.95	465,502.20
HAVELLS INDIA LTD	2,221	525.60	1,167,357.60
LARSEN & TOUBRO LTD	3,569	851.20	3,037,932.80
SIEMENS LTD	617	1,145.90	707,020.30
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,400	270.65	1,190,860.00
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	1,604	361.10	579,204.40
INTERGLOBE AVIATION LTD	676	891.75	602,823.00
BAJAJ AUTO LTD	657	2,445.35	1,606,594.95
BHARAT FORGE LTD	2,003	263.25	527,289.75
BOSCH LIMITED	55	10,212.45	561,684.75
EICHER MOTORS LTD	103	13,589.20	1,399,687.60
HERO MOTOCORP LTD	688	1,894.80	1,303,622.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	6,175	334.30	2,064,302.50
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	788	5,045.65	3,975,972.20
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,442	72.00	535,824.00
TATA MOTORS LTD	12,440	74.20	923,048.00
PAGE INDUSTRIES LTD	46	17,854.35	821,300.10
TITAN CO LTD	2,567	906.05	2,325,830.35
INFO EDGE INDIA LTD	500	2,327.10	1,163,550.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	5,651	145.15	820,242.65
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,054	2,310.50	2,435,267.00
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	426	3,062.15	1,304,475.90
ITC LIMITED	25,552	180.05	4,600,637.60
NESTLE INDIA LTD	178	17,406.05	3,098,276.90
UNITED SPIRITS LTD	2,109	519.50	1,095,625.50
COLGATE PALMOLIVE INDIA	573	1,483.65	850,131.45
DABUR INDIA LIMITED	4,168	499.05	2,080,040.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,808	534.40	1,500,595.20
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	6,440	2,283.10	14,703,164.00
MARICO LTD	3,281	306.10	1,004,314.10
AUROBINDO PHARMA LIMITED	1,539	624.45	961,028.55

	CIPLA LTD	3,110	599.30	1,863,823.00	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	596	2,425.40	1,445,538.40	
	DR.REDDY'S LABORATORIES	950	4,002.80	3,802,660.00	
	LUPIN LTD	1,307	877.35	1,146,696.45	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	909	864.45	785,785.05	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	7,019	485.55	3,408,075.45	
	AXIS BANK LIMITED	16,577	403.95	6,696,279.15	
	BANDHAN BANK LTD	2,530	198.45	502,078.50	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	12,937	1,580.30	20,444,341.10	
	ICICI BANK LIMITED	37,805	334.85	12,659,004.25	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	2,812	260.65	732,947.80	
	STATE BANK OF INDIA	14,494	179.75	2,605,296.50	
	BAJAJ FINANCE LIMITED	1,449	1,976.25	2,863,586.25	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	350	2,427.75	849,712.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,348	140.45	329,776.60	
	REC LTD	5,374	89.35	480,166.90	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	785	668.20	524,537.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	294	4,389.80	1,290,601.20	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,535	453.35	1,602,592.25	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	1,428	1,136.50	1,622,922.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,564	336.55	862,914.20	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,697	679.15	1,831,667.55	
	DLF LIMITED	4,986	128.20	639,205.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	8,583	468.10	4,017,702.30	
	INFOSYS LIMITED	26,905	658.00	17,703,490.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	7,057	1,818.55	12,833,507.35	
	TECH MAHINDRA LTD	3,833	503.45	1,929,723.85	
	WIPRO LTD	8,396	177.75	1,492,389.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	19,555	494.25	9,665,058.75	
	BHARTI INFRATEL LTD	3,387	152.00	514,824.00	
	GAIL INDIA LIMITED	13,856	81.50	1,129,264.00	
	NTPC LTD	18,498	93.40	1,727,713.20	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	15,235	159.15	2,424,650.25	
	TATA POWER CO LTD	4,120	31.05	127,926.00	
	インドルピー 小計	491,437		238,334,679.85 (338,435,245)	
エジプトボンド	ELSEWEDY ELECTRIC CO	5,455	9.49	51,767.95	
	EASTERN TOBACCO	5,913	12.06	71,310.78	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	11,199	62.40	698,817.60	
	エジプトボンド 小計	22,567		821,896.33 (5,597,114)	
	EXXARO RESOURCES LIMITED	1,848	106.57	196,941.36	

南アフリカランド

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	416	935.20	389,043.20
ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	3,120	518.28	1,617,033.60
GOLD FIELDS LIMITED	6,802	157.84	1,073,627.68
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LIMITED	6,071	110.07	668,234.97
KUMBA IRON ORE LTD	490	346.85	169,956.50
NORTHAM PLATINUM LTD	2,882	92.65	267,017.30
SASOL LTD.	4,187	67.00	280,529.00
SIBANYE STILLWATER LTD	18,668	38.05	710,317.40
BIDVEST GROUP LTD	2,459	141.75	348,563.25
MULTICHOICE GROUP LTD	3,068	89.97	276,027.96
MR PRICE GROUP LTD	2,037	130.69	266,215.53
NASPERS LIMITED-N SHS	3,498	2,904.00	10,158,192.00
PEPKOR HOLDINGS LTD	7,054	10.30	72,656.20
THE FOSCHINI GROUP	2,131	69.15	147,358.65
WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	7,756	27.77	215,384.12
BID CORP LTD	2,744	229.16	628,815.04
CLICKS GROUP LTD	2,022	229.02	463,078.44
PICK N PAY STORES LTD	3,137	60.57	190,008.09
SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	3,329	111.00	369,519.00
SPAR GROUP LIMITED	1,720	189.50	325,940.00
TIGER BRANDS LTD	929	179.21	166,486.09
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	10,359	18.39	190,502.01
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	3,076	109.89	338,021.64
ABSA GROUP LTD	5,907	79.22	467,952.54
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	327	933.00	305,091.00
NEDBANK GROUP LTD	2,834	87.98	249,335.32
STANDARD BANK GROUP LIMITED	10,384	93.12	966,958.08
FIRSTRAND LIMITED	26,994	39.43	1,064,373.42
INVESTEC LTD	2,223	36.91	82,050.93
PSG GROUP LTD	1,359	162.23	220,470.57
REINET INVESTMENTS SCA	1,066	287.00	305,942.00
REMGRO LTD	4,353	128.92	561,188.76
RMB HOLDINGS LTD	5,468	52.08	284,773.44
DISCOVERY LTD	3,105	85.48	265,415.40
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	63.82	30,123.04
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	8,911	16.39	146,051.29
OLD MUTUAL LTD	39,043	12.13	473,591.59
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	5,957	24.22	144,278.54
SANLAM LTD	13,975	56.18	785,115.50
NEPI ROCKCASTLE PLC	3,006	78.91	237,203.46
MTN GROUP LIMITED	12,626	42.75	539,761.50
TELKOM SA SOC LTD	2,170	18.94	41,099.80

VODACOM GROUP LIMITED	5,340	124.22	663,334.80
南アフリカランド 小計	255,323		27,363,580.01 (154,604,227)
合 計	19,156,120		3,662,360,965 (3,662,360,965)

(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 40銘柄	7.8%	13.6%
メキシコペソ	株式 24銘柄	1.1%	1.9%
ブラジルレアル	株式 52銘柄	2.9%	5.0%
チリペソ	株式 17銘柄	0.4%	0.7%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	0.1%	0.3%
ユーロ	株式 9銘柄	0.1%	0.2%
トルコリラ	株式 15銘柄	0.3%	0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.1%	0.3%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	0.5%	0.8%
香港ドル	株式 205銘柄	15.9%	27.6%
マレーシアリングット	株式 40銘柄	1.2%	2.1%
タイバーツ	株式 41銘柄	1.5%	2.7%
フィリピンペソ	株式 22銘柄	0.5%	0.9%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	1.0%	1.7%
韓国ウォン	株式 112銘柄	7.8%	13.5%
新台湾ドル	株式 88銘柄	8.3%	14.4%
インドルピー	株式 84銘柄	5.3%	9.2%
エジプトポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
南アフリカランド	株式 44銘柄	2.4%	4.2%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,853	10,432.39	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	25,362	389,945.82	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	44,379	1,355,112.76	
		ISHARES MSCI UAE ETF	22,888	227,735.60	
	米ドル 小計		94,482	1,983,226.57 (213,395,178)	
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	338,000	13,046,800.00	
中国元(オフショア) 小計		338,000	13,046,800.00 (198,050,424)		

投資信託受益証券合計				411,445,602		
				(411,445,602)		
投資証券	米ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	41,650	1,015,843.50		
	米ドル 小計		41,650	1,015,843.50		
					(109,304,760)	
	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	23,200	426,184.00		
	メキシコペソ 小計		23,200	426,184.00		
					(1,836,853)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,200	75,008.00		
		KLABIN SA-UNIT	5,900	101,775.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	2,300	101,867.00		
	ブラジルリアル 小計		11,400	278,650.00		
					(5,364,012)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	9,022	90,129.78		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		25,563	329,762.70			
REDEFINE PROPERTIES LTD		43,761	95,836.59			
RESILIENT REIT LTD		115	3,845.60			
南アフリカランド 小計		78,461	519,574.67			
				(2,935,596)		
投資証券合計				119,441,221		
				(119,441,221)		
合計				530,886,823		
				(530,886,823)		

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

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資信託受益証券 4銘柄	3.4%	-	40.2%
	投資証券 1銘柄	-	1.7%	20.6%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.3%
ブラジルリアル	投資証券 3銘柄	-	0.1%	1.0%
南アフリカランド	投資証券 4銘柄	-	0.0%	0.6%
中国元(オフショア)	投資信託受益証券 1銘柄	3.1%	-	37.3%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	119,389,113	29,223,710
コール・ローン	38,569,538	29,959,559
投資証券	12,718,162,720	3,952,989,000
未収入金	156,274,541	102,225
未収配当金	111,852,741	45,102,963
前払金	-	14,135,500
差入委託証拠金	-	15,120,000
流動資産合計	13,144,248,653	4,086,632,957
資産合計	13,144,248,653	4,086,632,957
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	14,148,700
未払金	14,383,851	-
未払解約金	200,090,000	2,285,580
未払利息	113	86
その他未払費用	6,468	10,403
流動負債合計	214,480,432	16,444,769
負債合計	214,480,432	16,444,769
純資産の部		
元本等		
元本	5,748,282,368	2,079,734,759
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,181,485,853	1,990,453,429
元本等合計	12,929,768,221	4,070,188,188
純資産合計	12,929,768,221	4,070,188,188
負債純資産合計	13,144,248,653	4,086,632,957

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,748,282,368口	2,079,734,759口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.2493円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 22,493円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.9571円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 19,571円)</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (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	(2020年 4月27日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 4月26日現在)

該当事項はありません。

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	108,768,700	-	94,620,000	14,148,700
	東証REIT指数先物	108,768,700	-	94,620,000	14,148,700
	合計	108,768,700	-	94,620,000	14,148,700

(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 2019年 4月27日
至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,131,265,092円
同期中における追加設定元本額	4,291,910,342円
同期中における一部解約元本額	3,674,893,066円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	924,366,881円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	870,273,854円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	832,359,678円
イオン・バランス戦略ファンド	119,998,945円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	634,337,452円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,309,201円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	7,582,448円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,477,505円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	17,206,371円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,219,373円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,827,257円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,636,404円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	449,196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)	983,874,679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)	578,315,919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>	78,756,375円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,779,298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>	241,284,470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>	115,538,605円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	284,688,457円
合計	5,748,282,368円

(2020年 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,748,282,368円
同期中における追加設定元本額	2,292,676,609円
同期中における一部解約元本額	5,961,224,218円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	152,382,989円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	310,073,497円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	261,721,272円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,177,332,621円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	5,392,698円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	25,359,901円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	17,271,591円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	48,367,096円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	24,397,339円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,133,135円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	10,128,064円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,159,286円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	383,164円
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>	5,389,396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>	4,214,611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>	6,211,193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>	9,816,906円
合計	2,079,734,759円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	58	5,562,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	70	6,545,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	107	12,925,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	160	101,280,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	618	46,350,000	
	森ヒルズリート投資法人	554	78,058,600	
	産業ファンド投資法人	622	92,429,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	457	146,468,500	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	315	52,762,500	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	242	77,440,000	
G L P 投資法人	1,200	161,880,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	210	67,515,000	
日本プロロジスリート投資法人	726	207,853,800	
星野リゾート・リート投資法人	74	28,675,000	
O n e リート投資法人	75	18,022,500	
イオンリート投資法人	519	56,571,000	
ヒューリックリート投資法人	411	49,278,900	
日本リート投資法人	157	51,182,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	3,095	45,806,000	
積水ハウス・リート投資法人	1,408	94,054,400	
トーセイ・リート投資法人	104	10,566,400	
ケネディクス商業リート投資法人	187	31,846,100	
ヘルスケア&メディカル投資法人	104	12,199,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	94	8,685,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	1,556	199,323,600	
いちごホテルリート投資法人	82	4,928,200	
ラサールロジポート投資法人	448	69,395,200	
スターアジア不動産投資法人	162	14,256,000	
マリモ地方創生リート投資法人	46	4,365,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	137	60,622,500	
大江戸温泉リート投資法人	84	4,846,800	
さくら総合リート投資法人	104	7,820,800	
投資法人みらい	548	22,084,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	114	9,986,400	
三菱地所物流リート投資法人	95	32,727,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	91	13,031,200	
ザイマックス・リート投資法人	70	6,685,000	
タカラレーベン不動産投資法人	137	11,864,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	100	12,300,000	
日本ビルファンド投資法人	467	299,814,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	482	283,416,000	
日本リテールファンド投資法人	911	109,137,800	
オリックス不動産投資法人	961	127,620,800	

日本プライムリアルティ投資法人	317	97,794,500	
プレミア投資法人	435	49,242,000	
東急リアル・エステート投資法人	323	47,610,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	335	30,853,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,082	120,102,000	
森トラスト総合リート投資法人	346	42,350,400	
インヴィンシブル投資法人	2,113	59,692,250	
フロンティア不動産投資法人	171	52,240,500	
平和不動産リート投資法人	302	28,508,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	315	79,726,500	
福岡リート投資法人	250	27,575,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	149	82,993,000	
いちごオフィスリート投資法人	374	25,619,000	
大和証券オフィス投資法人	111	68,154,000	
阪急阪神リート投資法人	218	25,658,600	
スタートアップリート投資法人	75	14,430,000	
大和ハウスリート投資法人	688	180,324,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,555	55,902,250	
大和証券リビング投資法人	581	51,941,400	
ジャパンエクセレント投資法人	447	54,087,000	
合計	28,349	3,952,989,000	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（2019年 4月26日現在）	（2020年 4月27日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	24,025,748	51,118,215
金銭信託	85,127,412	3,963,979
コール・ローン	27,501,041	4,063,792
投資証券	5,377,489,103	5,478,909,884
派生商品評価勘定	-	5,199

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
未収入金	47,435	2,163
未収配当金	5,509,720	5,165,802
流動資産合計	5,519,700,459	5,543,229,034
資産合計	5,519,700,459	5,543,229,034
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,197
未払金	-	5,641,591
未払解約金	110,000,000	-
未払利息	80	11
その他未払費用	1,437	1,101
流動負債合計	110,001,517	5,647,900
負債合計	110,001,517	5,647,900
純資産の部		
元本等		
元本	2,475,122,234	3,351,152,062
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,934,576,708	2,186,429,072
元本等合計	5,409,698,942	5,537,581,134
純資産合計	5,409,698,942	5,537,581,134
負債純資産合計	5,519,700,459	5,543,229,034

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本と	外貨建資産等の会計処理

なる重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。
---------	--------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,475,122,234口	3,351,152,062口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1856円 (10,000口当たりの純資産額 21,856円)	1口当たり純資産額 1.6524円 (10,000口当たりの純資産額 16,524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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2019年 4月26日現在)

該当事項はありません。

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	5,500,000	-	5,500,602	602
	米ドル	4,500,000	-	4,495,403	4,597
	ユーロ	500,000	-	501,768	1,768
	オーストラリアドル	500,000	-	503,431	3,431
	売建	2,430,180	-	2,430,780	600
	カナダドル	610,080	-	610,080	-
	英ポンド	1,064,400	-	1,064,800	400
	シンガポールドル	755,700	-	755,900	200
合計		7,930,180	-	7,931,382	2

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月27日

至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,192,135,055円
同期中における追加設定元本額	2,055,570,269円
同期中における一部解約元本額	1,772,583,090円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	78,329,005円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	78,891,404円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	80,027,060円
イオン・バランス戦略ファンド	21,338,148円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	1,487,090,193円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,374,240円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,100,758円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,627,470円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	22,566,359円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,381,573円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,162,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,839,613円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	459,604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)	585,081,246円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	43,080,884円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,772,093円
合計	2,475,122,234円

(2020年 4月27日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,475,122,234円
同期中における追加設定元本額	2,273,912,402円
同期中における一部解約元本額	1,397,882,574円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	37,376,988円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	37,514,775円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	28,930,639円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,048,076,760円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	2,560,043円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	27,304,661円

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	18,240,993円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	55,898,575円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	27,687,998円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,576,318円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	35,818,994円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	450,246円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	449,158円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	2,818,172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>	5,447,742円
合計	3,351,152,062円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	5,392	56,939.52	
		AGREE REALTY CORP	2,607	158,427.39	
		ALEXANDER'S INC	136	38,974.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	6,483	969,143.67	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,052	53,310.96	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	7,839	234,229.32	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	6,262	39,638.46	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	13,226	304,462.52	
		AMERICOLD REALTY TRUST	10,375	325,152.50	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	8,345	292,826.05	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,088	84,234.80	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	20,000	8,200.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	3,765.91	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,244	1,147,304.72	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	3,408.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,314	660,893.04	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	1,438.78	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	9,810	97,315.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	14,299	131,121.83	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	2,361	19,619.91	

BRT APARTMENTS CORP	500	4,425.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,289	442,636.41	
CARETRUST REIT INC	4,198	63,011.98	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	1,944.99	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	1,725.30	
CHATHAM LODGING TRUST	4,019	24,797.23	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	39,263.59	
CLIPPER REALTY INC	800	3,848.00	
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	42,355.20	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	7,180	88,816.60	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,483	50,362.68	
CORECIVIC INC	5,301	59,159.16	
CORESITE REALTY CORPORATION	2,166	261,544.50	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6,389	166,305.67	
COUSINS PROPERTIES INC	7,553	210,577.64	
CUBESMART	10,448	264,125.44	
CYRUSONE INC	6,276	456,579.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,330	52,269.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	13,703	2,055,861.09	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,696	28,130.48	
DOUGLAS EMMETT INC	8,554	252,343.00	
DUKE REALTY CORP	18,801	644,874.30	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	4,292	114,982.68	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,928	201,842.32	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	6,910	53,759.80	
EPR PROPERTIES	3,634	86,198.48	
EQUINIX INC	4,425	3,031,567.50	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	6,082	207,882.76	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	9,499	574,024.57	
EQUITY RESIDENTIAL	18,477	1,182,343.23	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	4,017	43,343.43	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,528	852,400.08	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,687	594,407.43	
FARMLAND PARTNERS INC	300	1,938.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,495	242,063.70	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	6,809	245,328.27	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	65,544.57	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	18,870.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,000	24,640.00	
	11,012	275,410.12	

GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC		
GEO GROUP INC	5,536	64,826.56
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	34,514.76
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	20,044.80
GLADSTONE LAND CORP	600	8,112.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	10,370.00
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	42,912.50
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7,220	204,253.80
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	10,166	235,952.86
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	26,682	646,504.86
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	4,479.20
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,651	198,745.67
HOST HOTELS AND RESORTS INC	39,806	441,846.60
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	7,433	164,715.28
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	42,975.66
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	4,808	80,389.76
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	878	65,094.92
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	323	17,923.27
INVITATION HOMES INC	27,981	609,426.18
IRON MOUNTAIN INC	14,979	352,455.87
JBG SMITH PROPERTIES	5,796	183,965.04
KILROY REALTY CORP	5,239	323,822.59
KIMCO REALTY CORPORATION	19,534	167,992.40
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	24,783.60
LEXINGTON REALTY TRUST	12,897	130,775.58
LIFE STORAGE INC	2,449	216,173.23
LTC PROPERTIES INC	1,576	50,368.96
MACERICH COMPANY/THE	4,415	26,357.55
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,669	69,007.82
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	43,112.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	28,119	446,248.53
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,921	630,172.03
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	7,136	88,058.24
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	2,692	134,250.04
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,720	256,804.00
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,311	91,052.50
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	7,532.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	1,760	46,992.00
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,919	47,783.10
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	11,098	297,648.36

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	13,970.00
PARAMOUNT GROUP INC	8,400	70,224.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	11,136	82,517.76
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,931	62,572.05
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	1,969.22
PHYSICIANS REALTY TRUST	11,532	166,983.36
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	7,882	126,112.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	19,546.00
PRIME US REIT	15,000	10,500.00
PROLOGIS INC	38,262	3,406,848.48
PS BUSINESS PARKS INC/CA	938	116,443.32
PUBLIC STORAGE	7,836	1,467,134.28
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,764	176,260.28
REALTY INCOME CORPORATION	18,299	913,486.08
REGENCY CENTERS CORP	8,552	302,997.36
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	7,539	60,010.44
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,355	49,186.25
RETAIL VALUE INC	617	6,447.65
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,655	218,565.75
RLJ LODGING TRUST	7,377	59,311.08
RPT REALTY	2,740	14,439.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,795	76,694.80
SABRA HEALTH CARE REIT	10,004	116,446.56
SAFEHOLD INC	600	29,154.00
SAUL CENTERS INC	703	19,698.06
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	13,230.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	7,445	42,287.60
SIMON PROPERTY GROUP INC	15,773	812,151.77
SITE CENTERS CORP	5,797	28,057.48
SL GREEN REALTY CORP	4,328	193,548.16
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,896	127,296.00
STAG INDUSTRIAL INC	8,656	218,390.88
STORE CAPITAL CORP	10,261	162,021.19
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	20,640.00
SUN COMMUNITIES INC	4,973	630,278.02
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	80,845.83
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	21,071.04
TAUBMAN CENTERS INC	2,883	107,910.69
TERRENO REALTY CORP	3,957	206,080.56
UDR INC	15,754	571,712.66

	UMH PROPERTIES INC	800	9,000.00	
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	775	72,439.25	
	URBAN EDGE PROPERTIES	6,559	59,358.95	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	2,927	33,162.91	
	VENTAS INC	19,977	553,562.67	
	VEREIT INC	51,987	243,299.16	
	VICI PROPERTIES INC	25,299	394,158.42	
	VORNADO REALTY TRUST	7,768	293,397.36	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	4,229.70	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,917	107,043.09	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,598	81,730.80	
	WELLTOWER INC	21,363	941,253.78	
	WP CAREY INC	9,267	544,158.24	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	6,674	56,128.34	
	米ドル 小計	1,247,703	38,409,058.71 (4,132,814,717)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	3,629	153,034.93	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,233	19,025.16	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	18,683.70	
	CAN APARTMENT PROP	4,246	195,061.24	
	CHOICE PROPERTIES REIT	5,671	69,583.17	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	8,945	73,706.80	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	18,855.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,200	39,200.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	35,409.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	31,512.60	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,657	63,428.34	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,731	109,226.10	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,692	66,920.40	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2,479	35,424.91	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,017	50,534.75	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	303	6,108.48	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	1,557	21,128.49	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,844	63,691.76	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	4,111	37,574.54	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,629	100,363.06	
	SLATE OFFICE REIT	1,000	3,740.00	

	SLATE RETAIL REIT	500	4,400.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,256	65,836.32	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,456	63,204.24	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE INVEST	1,000	5,530.00	
	カナダドル 小計	81,567	1,351,182.99 (103,054,726)	
ユーロ	AEDIFICA	1,453	126,411.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,936	105,231.36	
	ALTAREA	80	8,464.00	
	BEFIMMO SCA	1,112	42,812.00	
	COFINIMMO	1,474	175,700.80	
	COVIVIO	2,060	122,364.00	
	EUROCOMMERCIAL	2,113	18,256.32	
	GECINA SA	3,010	332,605.00	
	HAMBORNER REIT AG	6,085	47,286.53	
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	27,241.06	
	ICADE	1,437	99,512.25	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	11,928.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	11,858	92,018.08	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,302	28,578.90	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	11,695.80	
	KLEPIERRE	10,551	170,451.40	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	9,576.10	
	MERCIALYS	2,280	17,578.80	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	18,605	134,979.27	
	MONTEA	430	33,669.00	
	NSI NV	727	26,353.75	
	RETAIL ESTATES	512	25,267.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	7,447	373,839.40	
	VASTNED RETAIL	925	13,523.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,293	175,177.86	
	WERELDHAVE NV	3,304	23,954.00	
	ユーロ 小計	133,392	2,254,475.38 (262,285,665)	
英ポンド	ASSURA PLC	116,800	89,235.20	
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,081	105,447.26	
	BRITISH LAND CO PLC	50,779	193,417.21	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	43,000	69,015.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	2,000	2,040.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19,661	19,425.06	

	DERWENT LONDON PLC	5,161	160,403.88
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	12,520.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	13,270	90,501.40
	HAMMERSON PLC	36,480	21,384.57
	INTU PROPERTIES PLC	28,500	1,556.10
	LAND SECURITIES GROUP PLC	38,148	240,027.21
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	49,553	90,731.54
	LXI REIT PLC	36,635	37,367.70
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	10,055.94
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	15,000	10,215.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	63,444	97,830.64
	RDI REIT PLC	8,020	4,138.32
	REGIONAL REIT LTD	45,664	29,955.58
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	12,933	89,755.02
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	6,217.50
	SEGRO PLC	56,237	463,055.45
	SHAFTESBURY PLC	11,737	71,360.96
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	10,000	10,100.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	93,936	107,274.91
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	21,070.00
	UNITE GROUP PLC	17,621	137,796.22
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	47,226.82
	英債券 小計	878,767	2,239,124.49 (298,049,860)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	23,209	56,397.87
	APN INDUSTRIA REIT	1,000	2,050.00
	ARENA REIT	12,763	28,078.60
	BWP TRUST	26,090	86,879.70
	CENTURIA OFFICE REIT	24,034	42,540.18
	CHARTER HALL GROUP	23,313	162,957.87
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,945	115,195.80
	CHARTER HALL RETAIL REIT	24,091	75,886.65
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	7,100	15,549.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	61,090.00
	DEXUS	55,821	487,875.54
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	18,180.00
	GOODMAN GROUP	85,465	1,106,771.75
	GPT GROUP	100,476	371,761.20
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	15,930	45,719.10
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	220.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	29,152.62

	MIRVAC GROUP	214,822	442,533.32
	NATIONAL STORAGE REIT	43,936	73,153.44
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	19,400.00
	SCENTRE GROUP	297,092	597,154.92
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	92,912.82
	STOCKLAND	139,503	371,077.98
	VICINITY CENTRES	150,809	193,789.56
	VIVA ENERGY REIT	50,503	119,692.11
	オーストラリアドル 小計	1,482,210	4,616,020.03 (318,320,741)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	32,700.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	52,430	122,686.20
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	86,057	83,905.57
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	76,088	120,599.48
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	47,310.00
	ニュージーランドドル 小計	263,575	407,201.25 (26,386,641)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	92,000	431,480.00
	FORTUNE REIT	80,000	556,800.00
	LINK REIT	110,800	7,368,200.00
	PROSPERITY REIT	60,000	144,000.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	143,190.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	61,000	225,700.00
	香港ドル 小計	440,800	8,869,370.00 (123,106,855)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	23,500	26,790.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	149,500	405,145.00
	ASCOTT TRUST	117,055	95,399.82
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	13,770.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	137,600	196,768.00
	CAPITALAND MALL TRUST	155,400	261,072.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	61,000	76,860.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	34,350	30,743.25
	ESR REIT	57,552	18,128.88
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	22,540.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	21,700.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	36,800	72,864.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	10,000	4,850.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	172,038	167,737.05

	KEPPEL DC REIT	58,300	141,086.00
	KEPPEL REIT	98,900	99,889.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	4,521.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,000	212,960.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	70,200	167,076.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,850	241,940.50
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	72,210.00
	OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	100,000	39,000.00
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	29,800	98,638.00
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	9,920.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	20,000	13,800.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	9,490.00
	SPH REIT	74,600	57,442.00
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	25,380.00
	SUNTEC REIT	147,500	181,425.00
	シンガポールドル 小計	2,142,945	2,789,145.50 (210,859,399)
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	132,000.00
	イスラエルシュケル 小計	8,000	132,000.00 (4,031,280)
	合計		5,478,909,884 (5,478,909,884)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 154銘柄	74.6%	75.4%
カナダドル	投資証券 25銘柄	1.9%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	4.7%	4.8%
英ポンド	投資証券 28銘柄	5.4%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	5.7%	5.8%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	2.2%	2.2%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	3.8%	3.8%
イスラエルシュケル	投資証券 1銘柄	0.1%	0.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,101,630,186	192,151,216
コール・ローン	355,889,796	196,989,558
国債証券	126,505,019,860	108,583,603,390
地方債証券	13,311,528,945	8,517,711,860
特殊債券	21,583,378,483	13,069,990,511
社債券	8,387,830,000	5,677,516,000
未収入金	667,981,500	-
未収利息	374,711,697	289,194,993
前払費用	4,541,029	8,769,806
流動資産合計	172,292,511,496	136,535,927,334
資産合計	172,292,511,496	136,535,927,334
負債の部		
流動負債		
未払金	137,095,650	267,801,200
未払解約金	1,107,232,306	14,451,749
未払利息	1,043	568
その他未払費用	43,086	65,632
流動負債合計	1,244,372,085	282,319,149
負債合計	1,244,372,085	282,319,149
純資産の部		
元本等		
元本	133,381,240,777	105,756,496,620
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	37,666,898,634	30,497,111,565
元本等合計	171,048,139,411	136,253,608,185
純資産合計	171,048,139,411	136,253,608,185
負債純資産合計	172,292,511,496	136,535,927,334

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	133,381,240,777口	105,756,496,620口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2824円 (10,000口当たりの純資産額 12,824円)	1口当たり純資産額 1.2884円 (10,000口当たりの純資産額 12,884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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、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</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年 4月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	163,997,039,244円
同期中における追加設定元本額	19,222,300,106円
同期中における一部解約元本額	49,838,098,573円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	4,506,040,354円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,846,558,666円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,698,259,549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)	599,400,661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)	49,601,336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)	168,249,075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)	311,686,143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)	270,606,999円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	101,709,183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)	212,238,129円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	88,745,992円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,475,358,230円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	658,742,873円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	33,591,719円
三井住友・DC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)	34,257,580円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	13,111,015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)	4,896,557円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	25,137,922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>	18,344,941,767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>	351,415,849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>	578,749,942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4 0 T <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)	2,519,139,610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)	10,665,263,520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>	520,836,297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>	336,866,364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)	9,606,037,597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>	927,922,952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>	189,230,061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>	44,401,846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>	2,006,963,386円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	2,524,154,466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>	2,386,225,311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>	1,026,373,073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>	244,033,609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>	18,430,319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>	357,572,916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>	6,279,517,945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>	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2 0 1 6 - 0 4 <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2 0 1 6 - 0 5 <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	133,381,240,777円

(2020年 4月27日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	133,381,240,777円
同期中における追加設定元本額	29,269,841,595円

同期中における一部解約元本額	56,894,585,752円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30 (債券重点型)	4,960,619,822円
三井住友・DC年金バランス50 (標準型)	8,292,722,898円
三井住友・DC年金バランス70 (株式重点型)	1,724,283,160円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	723,543,579円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020 (4資産タイプ)	44,849,500円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025 (4資産タイプ)	169,123,013円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030 (4資産タイプ)	346,223,015円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035 (4資産タイプ)	355,076,247円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040 (4資産タイプ)	136,949,340円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045 (4資産タイプ)	250,983,539円
三井住友・DC年金バランスゼロ (債券型)	120,216,127円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	3,623,380,687円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	1,332,579,445円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	618,268,109円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	13,814,140円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	1,159,440,155円
三井住友・資産最適化ファンド (2やや安定型)	367,819,534円
三井住友・資産最適化ファンド (3バランス型)	512,477,144円
三井住友・資産最適化ファンド (4やや成長型)	86,973,783円
三井住友・資産最適化ファンド (5成長重視型)	7,138,094円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	46,310,563円
三井住友D S ・ 年金バランス30 (債券重点型)	3,099,040円
三井住友D S ・ 年金バランス50 (標準型)	5,101,208円
三井住友D S ・ 年金バランス70 (株式重点型)	1,062,845円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,688,392円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド < 適格機関投資家限定 >	5,908,244,271円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	15,284,484,645円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	6,538,002,991円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	15,594,252,520円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	310,135,056円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	527,038,286円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,972,815円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	223,691,964円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	103,533,600円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,857,717,650円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,979,603,373円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,449,603,074円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,079,019,613円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	2,114,879円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,354,089,917円
S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	448,466,921円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	622,144,119円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	170,571,267円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	41,651,607円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	1,741,366,557円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,265,783,446円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	884,727,878円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	200,322,382円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	17,629,769円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	304,049,534円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,571,268,063円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	257,779,674円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	379,382,709円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	1,223,935,464円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	1,463,120,766円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	4,046,048,431円
合計	105,756,496,620円

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403回利付国債(2年)	20,000,000	20,074,400	
	第404回利付国債(2年)	20,000,000	20,079,400	
	第405回利付国債(2年)	60,000,000	60,261,600	
	第407回利付国債(2年)	20,000,000	20,094,200	
	第409回利付国債(2年)	230,000,000	231,159,200	
	第410回利付国債(2年)	3,170,000,000	3,186,674,200	
	第411回利付国債(2年)	1,780,000,000	1,789,629,800	
	第130回利付国債(5年)	90,000,000	90,423,000	
	第131回利付国債(5年)	140,000,000	140,757,400	
	第132回利付国債(5年)	95,000,000	95,571,900	
	第133回利付国債(5年)	108,000,000	108,753,840	
	第134回利付国債(5年)	110,000,000	110,848,100	
	第135回利付国債(5年)	190,000,000	191,601,700	

第136回利付国債(5年)	400,000,000	403,668,000	
第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,974,000	
第138回利付国債(5年)	600,000,000	606,276,000	
第139回利付国債(5年)	100,000,000	101,117,000	
第140回利付国債(5年)	600,000,000	607,014,000	
第141回利付国債(5年)	15,000,000	15,182,700	
第142回利付国債(5年)	2,090,000,000	2,116,417,600	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	60,760,800	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	358,532,680	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	276,869,150	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	373,350,380	
第5回利付国債(40年)	245,000,000	359,434,600	
第6回利付国債(40年)	270,000,000	391,138,200	
第7回利付国債(40年)	265,000,000	370,586,600	
第8回利付国債(40年)	330,000,000	433,032,600	
第9回利付国債(40年)	498,000,000	491,824,800	
第10回利付国債(40年)	490,000,000	566,939,800	
第11回利付国債(40年)	360,000,000	405,381,600	
第12回利付国債(40年)	365,000,000	372,891,300	
第317回利付国債(10年)	55,000,000	55,993,850	
第321回利付国債(10年)	960,000,000	981,609,600	
第322回利付国債(10年)	365,000,000	372,522,650	
第323回利付国債(10年)	310,000,000	317,241,600	
第324回利付国債(10年)	390,000,000	398,271,900	
第325回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,294,993,150	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,801,800	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,651,500	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	132,948,400	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,092,909,700	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,328,265,950	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	815,854,260	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	840,085,700	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	325,259,550	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,495,500	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	350,750,800	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,670,000	

第338回利付国債(10年)	805,000,000	827,837,850	
第339回利付国債(10年)	785,000,000	808,432,250	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	794,124,100	
第341回利付国債(10年)	857,000,000	880,207,560	
第342回利付国債(10年)	890,000,000	904,302,300	
第343回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,128,603,600	
第344回利付国債(10年)	1,051,000,000	1,069,350,460	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	955,024,700	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	651,820,800	
第347回利付国債(10年)	430,000,000	438,238,800	
第348回利付国債(10年)	755,000,000	769,692,300	
第349回利付国債(10年)	690,000,000	703,613,700	
第350回利付国債(10年)	980,000,000	999,168,800	
第351回利付国債(10年)	570,000,000	581,029,500	
第352回利付国債(10年)	650,000,000	662,129,000	
第353回利付国債(10年)	800,000,000	814,304,000	
第354回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,052,626,050	
第355回利付国債(10年)	860,000,000	873,854,600	
第356回利付国債(10年)	850,000,000	862,852,000	
第357回利付国債(10年)	1,635,000,000	1,657,955,400	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	632,634,600	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	391,908,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	359,768,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	600,771,300	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	116,380,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	625,645,950	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	518,588,600	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	744,521,000	
第14回利付国債(30年)	742,000,000	971,188,960	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	618,998,700	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	589,225,500	
第19回利付国債(30年)	490,000,000	643,624,800	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	455,610,450	
第22回利付国債(30年)	315,000,000	426,598,200	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	446,999,140	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	422,526,900	

第25回利付国債(30年)	300,000,000	400,203,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	491,491,110	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	606,570,800	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	535,204,440	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	243,716,610	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	644,818,080	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	427,054,950	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	539,463,600	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	503,446,860	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	630,189,290	
第35回利付国債(30年)	390,000,000	524,358,900	
第36回利付国債(30年)	100,000,000	135,063,000	
第37回利付国債(30年)	495,000,000	660,523,050	
第38回利付国債(30年)	370,000,000	487,323,300	
第39回利付国債(30年)	170,000,000	228,126,400	
第40回利付国債(30年)	340,000,000	449,531,000	
第41回利付国債(30年)	310,000,000	403,598,300	
第42回利付国債(30年)	220,000,000	286,750,200	
第43回利付国債(30年)	315,000,000	411,506,550	
第44回利付国債(30年)	290,000,000	379,279,400	
第45回利付国債(30年)	355,000,000	448,134,250	
第46回利付国債(30年)	345,000,000	435,845,400	
第47回利付国債(30年)	330,000,000	425,333,700	
第48回利付国債(30年)	345,000,000	428,490,000	
第49回利付国債(30年)	335,000,000	416,311,200	
第50回利付国債(30年)	385,000,000	422,121,700	
第51回利付国債(30年)	405,000,000	394,012,350	
第52回利付国債(30年)	333,000,000	340,136,190	
第53回利付国債(30年)	197,000,000	206,237,330	
第54回利付国債(30年)	65,000,000	71,312,800	
第55回利付国債(30年)	425,000,000	466,624,500	
第56回利付国債(30年)	390,000,000	428,516,400	
第57回利付国債(30年)	505,000,000	555,282,850	
第58回利付国債(30年)	400,000,000	439,596,000	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	429,268,000	
第60回利付国債(30年)	360,000,000	405,900,000	

第6 1 回利付国債(30年)	315,000,000	338,417,100	
第6 2 回利付国債(30年)	115,000,000	117,370,150	
第6 3 回利付国債(30年)	380,000,000	377,533,800	
第6 4 回利付国債(30年)	335,000,000	332,376,950	
第6 5 回利付国債(30年)	295,000,000	292,672,450	
第5 6 回利付国債(20年)	818,000,000	856,486,900	
第5 9 回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,527,735,450	
第6 1 回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,256,686,650	
第6 4 回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,097,867,250	
第6 5 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,097,866,800	
第6 9 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,111,177,800	
第7 0 回利付国債(20年)	780,000,000	863,857,800	
第7 2 回利付国債(20年)	753,000,000	828,721,680	
第7 4 回利付国債(20年)	664,000,000	734,589,840	
第7 5 回利付国債(20年)	490,000,000	544,880,000	
第7 8 回利付国債(20年)	590,000,000	653,389,600	
第8 2 回利付国債(20年)	620,000,000	696,663,000	
第8 4 回利付国債(20年)	850,000,000	955,153,500	
第8 5 回利付国債(20年)	645,000,000	731,939,550	
第8 8 回利付国債(20年)	742,000,000	855,281,140	
第8 9 回利付国債(20年)	20,000,000	22,929,200	
第9 0 回利付国債(20年)	580,000,000	668,467,400	
第9 2 回利付国債(20年)	734,000,000	845,435,880	
第9 3 回利付国債(20年)	632,000,000	726,894,800	
第9 5 回利付国債(20年)	305,000,000	359,097,850	
第9 7 回利付国債(20年)	677,000,000	796,003,060	
第9 9 回利付国債(20年)	693,000,000	813,297,870	
第1 0 0 回利付国債(20年)	207,000,000	245,562,030	
第1 0 1 回利付国債(20年)	355,000,000	426,795,200	
第1 0 2 回利付国債(20年)	457,000,000	551,955,460	
第1 0 5 回利付国債(20年)	390,000,000	463,245,900	
第1 0 6 回利付国債(20年)	370,000,000	442,627,300	
第1 0 7 回利付国債(20年)	378,000,000	450,530,640	
第1 0 8 回利付国債(20年)	390,000,000	458,027,700	
第1 0 9 回利付国債(20年)	340,000,000	400,475,800	
第1 1 1 回利付国債(20年)	386,000,000	466,646,980	

第113回利付国債(20年)	427,000,000	513,920,120	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	438,438,660	
第116回利付国債(20年)	200,000,000	244,376,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	241,068,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	349,577,950	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	232,936,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	305,691,450	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	392,165,400	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	97,833,600	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	230,333,200	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	253,712,100	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	218,856,600	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	174,725,000	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	259,803,850	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	227,481,300	
第130回利付国債(20年)	135,000,000	161,956,800	
第131回利付国債(20年)	560,000,000	665,464,800	
第132回利付国債(20年)	300,000,000	357,315,000	
第133回利付国債(20年)	190,000,000	228,499,700	
第134回利付国債(20年)	200,000,000	241,094,000	
第135回利付国債(20年)	295,000,000	352,129,700	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	141,822,000	
第137回利付国債(20年)	45,000,000	53,833,050	
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,305,250	
第139回利付国債(20年)	20,000,000	23,685,000	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	635,395,800	
第141回利付国債(20年)	270,000,000	324,353,700	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	133,520,200	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	202,458,100	
第144回利付国債(20年)	170,000,000	200,294,000	
第145回利付国債(20年)	200,000,000	241,204,000	
第146回利付国債(20年)	85,000,000	102,707,200	
第147回利付国債(20年)	400,000,000	478,840,000	
第148回利付国債(20年)	229,000,000	271,442,860	
第149回利付国債(20年)	695,000,000	824,958,050	
第150回利付国債(20年)	401,000,000	470,974,500	

	第151回利付国債(20年)	730,000,000	837,448,700
	第152回利付国債(20年)	335,000,000	384,559,900
	第153回利付国債(20年)	227,000,000	264,287,020
	第154回利付国債(20年)	700,000,000	805,161,000
	第155回利付国債(20年)	330,000,000	369,771,600
	第156回利付国債(20年)	420,000,000	431,277,000
	第157回利付国債(20年)	375,000,000	372,956,250
	第158回利付国債(20年)	330,000,000	343,533,300
	第159回利付国債(20年)	448,000,000	473,432,960
	第160回利付国債(20年)	335,000,000	359,431,550
	第161回利付国債(20年)	610,000,000	644,038,000
	第162回利付国債(20年)	180,000,000	190,027,800
	第163回利付国債(20年)	720,000,000	760,017,600
	第164回利付国債(20年)	215,000,000	223,058,200
	第165回利付国債(20年)	560,000,000	580,770,400
	第166回利付国債(20年)	335,000,000	359,300,900
	第167回利付国債(20年)	500,000,000	518,115,000
	第168回利付国債(20年)	190,000,000	193,395,300
	第169回利付国債(20年)	630,000,000	629,426,700
	第170回利付国債(20年)	325,000,000	324,405,250
	第171回利付国債(20年)	425,000,000	424,209,500
	国債証券合計	97,435,000,000	108,583,603,390
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,765,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,197,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,682,000
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	530,400,000
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	652,665,000
	第688回東京都公募公債	193,500,000	194,196,600
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,955,000
	第710回東京都公募公債	100,000,000	101,685,000
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	101,888,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,142,000
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,906,000
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,763,000
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,506,000
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,518,000

第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,744,000	
第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	200,988,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,836,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,749,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,440,000	
平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	110,884,400	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,528,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,129,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	328,707,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	132,794,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	111,402,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,629,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,940,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,582,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,095,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	102,001,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,732,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,740,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,734,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,911,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,238,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,728,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,850,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	214,366,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	110,107,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	136,736,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	118,947,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,236,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,829,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,947,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,510,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,041,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,175,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,437,000	

	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,783,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	149,775,360	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,129,000	
地方債証券合計		7,900,500,000	8,517,711,860	
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	215,334,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,368,000	
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,114,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,006,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,899,000	
	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	303,675,000	
	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	101,765,000	
	第9回道路債券	100,000,000	131,877,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	156,921,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	456,636,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	240,990,000	
	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	237,196,000	
	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	136,232,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	357,801,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,936,000	
	第120回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,475,000	
	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	1,014,510,000	
	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	101,560,000	
	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	305,691,000	
	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	204,858,000	
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	306,885,000		
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	119,469,000		

第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,943,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,101,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,644,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,016,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,657,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	234,644,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,149,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,682,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,034,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,408,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,767,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,244,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,391,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,180,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	104,857,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,924,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	600,498,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,463,000	11,679,879	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,749,000	14,321,370	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,955,000	12,188,959	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,266,000	15,999,836	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,106,000	27,085,497	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,377,000	16,246,415	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,293,000	41,817,284	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,265,000	16,082,288	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,347,000	17,331,089	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,510,000	10,593,344	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,390,000	12,543,512	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,020,000	30,636,310	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,090,000	21,422,770	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,342,000	44,458,359	

第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,669,000	68,290,096	
第2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,232,000	24,940,016	
第2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,092,000	26,928,734	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,728,000	13,089,220	
第2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,947,000	30,118,481	
第3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,427,000	29,576,728	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,141,000	14,597,471	
第3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,070,000	57,830,027	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,921,000	15,515,900	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,419,000	31,358,006	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,347,000	31,138,047	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,432,000	13,907,089	
第4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,672,000	15,364,224	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,792,000	29,175,485	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,941,000	41,393,893	
第4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,082,000	34,227,002	
第4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,316,000	64,251,619	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,944,000	31,819,093	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,207,000	13,747,298	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,542,000	70,571,118	
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,135,000	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,864,000	14,502,298	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,166,000	92,327,098	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,540,000	44,021,184	
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,108,000	46,724,045	
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,006,000	90,097,009	
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,104,000	140,587,106	
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,859,000	45,115,097	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,633,000	50,909,024	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,608,000	104,184,282	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,724,000	91,251,860	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,888,000	51,681,949	
第9 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,994,000	
第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,853,000	74,655,985	
第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,087,000	90,499,028	
第1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,906,000	90,069,779	

	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,317,000	90,482,586	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,366,000	91,410,630	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,091,000	91,258,579	
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,978,000	92,401,805	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	237,836,000	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,080,000	95,633,260	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,118,000	26,954,820	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,946,000	30,308,198	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,228,000	14,872,812	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,767,000	14,298,681	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,662,000	31,097,937	
	い第810号農林債	300,000,000	300,036,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	101,902,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,168,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,108,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,458,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,347,000	
特殊債券合計		12,246,993,000	13,069,990,511	
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	199,976,000	
	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	199,978,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,494,000	
	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	101,297,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,895,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,537,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,952,000	
	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	99,933,000	
	第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,613,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,594,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,838,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,078,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,236,000	
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,819,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,470,000		

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	115,052,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	301,572,000	
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	100,007,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,330,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,794,000	
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	100,625,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,416,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,418,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,050,000	
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	99,766,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	127,556,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,751,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	100,836,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,011,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,165,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,761,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,261,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,396,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,836,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
第527回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,047,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,310,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,463,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,766,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	200,784,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,508,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,546,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	108,367,000	
第24回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,304,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	206,938,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保	100,000,000	102,376,000	

	社債			
	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	99,772,000	
社債券合計		5,500,000,000	5,677,516,000	
	合計		135,848,821,761	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（2019年 4月26日現在）	（2020年 4月27日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	312,110,255	360,106,290
金銭信託	1,047,385,769	541,173,851
コール・ローン	338,365,735	554,800,539
国債証券	160,094,281,169	151,493,147,031
未収入金	50,372,692	603,699,765
未収利息	1,301,526,987	1,214,583,803
前払費用	45,707,890	24,133,730
流動資産合計	163,189,750,497	154,791,645,009
資産合計	163,189,750,497	154,791,645,009
負債の部		
流動負債		
未払解約金	420,072,631	24,888,000
未払利息	991	1,600
その他未払費用	18,100	96,959
流動負債合計	420,091,722	24,986,559
負債合計	420,091,722	24,986,559
純資産の部		
元本等		
元本	92,111,667,202	84,222,011,513
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	70,657,991,573	70,544,646,937
元本等合計	162,769,658,775	154,766,658,450
純資産合計	162,769,658,775	154,766,658,450
負債純資産合計	163,189,750,497	154,791,645,009

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,111,667,202口	84,222,011,513口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7671円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,671円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.8376円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 18,376円)</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する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	(2020年 4月27日現在)
----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	104,217,368,782円
同期中における追加設定元本額	8,079,804,274円
同期中における一部解約元本額	20,185,505,854円
2019年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	11,016,273,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	591,416,375円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,606,544,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	811,289,304円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	91,821,119円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	8,821,430円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	29,870,669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)	83,335,203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)	103,813,269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)	54,778,231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)	127,497,633円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,013,381円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	278,321,489円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	284,675,131円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	277,435,529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)	55,042,841円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,931,733円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	77,885,818円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,430,283円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,131,556円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,104,917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>	1,736,006,800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>	11,541,133,932円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,789,213,731円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,034,779,889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>	105,186,441円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	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>	1,275,375,766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>	2,038,275,666円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,652,838,286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>	11,134,953,111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)	535,979,423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)	1,245,644,030円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	186,677,195円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	242,900,447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)	1,494,332,748円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	152,344,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,322,301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>	142,814,622円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	551,798,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	171,602,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,401,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,978,475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>	1,348,834,490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>	3,670,504,123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>	1,616,384,536円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,185,538,375円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	693,320,307円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	44,399,157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 >	40,044,700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 >	410,598,751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 >	196,656,702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 >	484,437,893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 >	824,402,719円
合計	92,111,667,202円

(2020年 4月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,111,667,202円
同期中における追加設定元本額	19,462,297,871円
同期中における一部解約元本額	27,351,953,560円
2020年 4月27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	21,729,513,907円
三井住友・D C 年金バランス30(債券重点型)	624,392,248円
三井住友・D C 年金バランス50(標準型)	1,639,945,488円
三井住友・D C 年金バランス70(株式重点型)	795,329,382円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	129,517,808円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,529,832円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,214,262円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	86,193,258円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	124,470,791円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	70,383,469円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	145,145,162円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	22,380,605円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	71,914,897円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	92,768,309円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	72,967,241円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	5,928,646円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	62,281,421円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	62,871,730円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	127,695,973円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,528,590円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,498,377円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	42,824,955円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	3,298,976円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	392,647円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	1,011,591円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	493,390円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	1,121,849円

S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,998,553,072円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	65,167,979円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	9,424,682,581円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	4,879,897,341円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	10,719,433,443円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	35,972,335円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	89,375,303円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	383,602円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	618,347,209円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	107,986,579円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,121,811,212円
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>	1,345,145,307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>	1,698,058,269円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	5,414,915,975円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	1,474,614円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	9,204,968,865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)	362,540,257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>	155,841,347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>	99,751,871円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	35,912,561円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	12,525,068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>	128,196,997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>	486,454,418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>	144,536,692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>	41,239,972円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,161,186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>	1,191,024,810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>	18,574,156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>	1,842,966,759円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定>	1,211,426,201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>	4,904,594,450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>	517,849,138円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド<適格機関投資家限定>	39,007,369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>	40,310,514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>	34,933,875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>	43,080,625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>	165,294,757円
合計	84,222,011,513円

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	3,034,218.75	
		US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,552,382.83	
		US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,733,960.95	
		US TREASURY N/B 1.125	2,100,000.00	2,127,070.32	
		US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,636,562.50	
		US TREASURY N/B 1.25	4,500,000.00	4,569,960.96	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,093,984.39	
		US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,430,187.51	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,052,812.52	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,110,000.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,093,281.25	
		US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,620,859.37	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,590,625.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,110,156.25	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,047,734.38	
		US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,745,640.63	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,066,796.89	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,604,179.70	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,104,296.89	
		US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,107,578.14	
		US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,105,000.00	
		US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,594,921.87	
		US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,066,250.00	
		US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,799,960.95	
		US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,063,593.76	
		US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,508,640.64	
		US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,621,406.25	
		US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,143,437.52	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,121,640.64	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,125,859.39	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,137,578.14	
		US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,561,062.51	
		US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,465,937.50	
		US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,359,375.00	
		US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,219,609.39	
		US TREASURY N/B 1.625	5,450,000.00	5,967,324.24	
US TREASURY N/B 1.75	10,500,000.00	10,706,718.75			

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,072,421.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,083,671.89
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,852,875.00
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,472,937.51
US TREASURY N/B 1.75	4,100,000.00	4,227,804.70
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,094,453.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,097,968.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,108,984.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,121,875.00
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,820,234.37
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,490,484.43
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	900,601.56
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,597,625.00
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,431,562.52
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,469,375.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,063,125.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,098,437.50
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,102,656.25
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,763,351.57
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,984,125.02
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,121,171.89
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,919,250.00
US TREASURY N/B 1.875	3,500,000.00	3,798,867.20
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,477,500.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,060,468.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,072,890.64
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,080,859.39
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,418,250.00
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,605,000.00
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,198,812.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,119,296.89
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,652,304.70
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,224,609.40
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,984,656.25
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,132,968.76
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,523,523.45
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,672,070.32
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,769,882.83
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,656,429.70
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,484,765.65
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,206,484.38
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,739,046.87

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,100,625.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,081,796.89
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,095,859.39
US TREASURY N/B 2.125	4,500,000.00	4,673,320.33
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,122,812.50
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,198,750.00
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,300,289.07
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,137,812.50
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,957,031.25
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,764,960.95
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,313,125.00
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,944,562.50
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,323,007.83
US TREASURY N/B 2.125	3,900,000.00	4,289,695.33
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,058,359.39
US TREASURY N/B 2.25	4,500,000.00	4,595,273.46
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,873,281.26
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,469,984.37
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,211,875.00
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,359,671.88
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,090,937.50
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,626,914.07
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,837,960.96
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,372,218.75
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,398,125.00
US TREASURY N/B 2.25	2,700,000.00	2,982,867.20
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,914,593.77
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,723,687.50
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,961,687.50
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	3,534,890.62
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	4,426,269.54
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	3,059,062.50
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,043,281.26
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,745,125.00
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,269,750.00
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,990,218.75
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	6,083,437.52
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,533,937.50
US TREASURY N/B 2.375	5,200,000.00	6,025,500.00
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,557,562.49
US TREASURY N/B 2.5	1,900,000.00	1,973,773.44
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,642,734.37
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,364,062.50

US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,195,632.84	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,742,390.64	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,565,484.38	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,271,222.64	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,750,062.50	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	5,311,421.87	
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	512,968.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,110,937.52	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,118,437.52	
US TREASURY N/B 2.625	3,000,000.00	3,117,187.50	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,267,187.52	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,551,742.19	
US TREASURY N/B 2.625	4,800,000.00	5,388,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	6,300,000.00	7,412,343.75	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,133,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	1,400,000.00	1,449,109.38	
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,115,007.82	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,159,218.76	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,111,718.75	
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,560,609.39	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,564,578.12	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,228,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,601,562.50	
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,359,218.75	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,610,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,638,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,800,000.00	3,695,781.26	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	5,188,484.39	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	2,052,421.87	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,164,375.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,357,500.00	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,182,812.50	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,471,734.38	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,237,500.00	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,837,109.37	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,733,437.52	
US TREASURY N/B 2.875	5,500,000.00	6,536,835.96	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	4,048,593.75	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	5,489,687.52	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,997,250.00	
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	1,276,453.12	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,554,687.52	

US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,533,515.62
US TREASURY N/B 3	800,000.00	1,096,718.75
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,867,187.50
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	4,191,796.89
US TREASURY N/B 3	3,700,000.00	5,195,609.37
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,554,101.57
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	3,130,703.13
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	4,433,968.75
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	7,762,921.90
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	5,490,703.14
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,094,453.14
US TREASURY N/B 3.125	5,700,000.00	6,918,820.34
US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,531,578.12
US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,394,531.25
US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	3,216,765.62
US TREASURY N/B 3.125	3,800,000.00	5,379,671.89
US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	3,515,062.51
US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	4,398,515.64
US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	4,759,226.57
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,157,531.24
US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,619,687.51
US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	5,461,312.50
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	2,267,578.12
US TREASURY N/B 3.75	2,700,000.00	4,153,570.32
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	2,284,453.12
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,576,484.38
US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	957,726.56
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	790,390.62
US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	1,124,621.09
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	2,255,093.75
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,934,843.75
US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,166,250.00
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	321,070.31
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,626,718.75
US TREASURY N/B 4.625	1,600,000.00	2,645,875.00
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,543,437.50
US TREASURY N/B 5	500,000.00	832,675.78
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	696,601.56
US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	480,325.00
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	701,328.12
US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,319,609.38
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,417,109.38
US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	957,437.50

	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	695,429.69
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,457,218.75
	米ドル 小計	636,870,000.00	719,386,791.11 (77,406,018,723)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,006,700.00
	CANADA-GOV'T 0.75	500,000.00	500,105.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,007,366.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,011,600.00
	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,047,040.00
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,347,099.00
	CANADA-GOV'T 1.25	300,000.00	319,620.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,072,600.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,046,020.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,063,050.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,144,396.00
	CANADA-GOV'T 2	900,000.00	1,006,650.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,070,070.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,529,248.00
	CANADA-GOV'T 2.25	600,000.00	691,620.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,277,492.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,891,080.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,514,458.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	769,470.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,031,950.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	2,264,550.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,305,095.00
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,360,643.50
CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	364,762.50	
CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	807,740.00	
CANADA-GOV'T 8	700,000.00	1,065,155.00	
	カナダドル 小計	32,500,000.00	37,515,580.00 (2,861,313,286)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	37,456,960.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	19,697,400.00
	MEXICAN BONOS 6.5	52,000,000.00	53,170,384.80
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	26,382,800.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,294,351.60
	MEXICAN BONOS 7.75	11,000,000.00	11,402,211.70
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	29,326,590.00
	MEXICAN BONOS 8.5	16,000,000.00	17,728,320.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	42,487,032.00
	メキシコペソ 小計	229,000,000.00	243,946,050.10

ユーロ	BELGIAN 0326 4	700,000.00	1,014,006.00
	BELGIAN 0.8	800,000.00	843,752.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	744,947.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	533,840.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,883,440.00
	BELGIAN 0304 5	1,600,000.00	2,684,208.00
	BELGIAN 0308 4	700,000.00	760,935.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,068,248.00
	BELGIAN 0321 4.25	2,300,000.00	2,455,158.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,279,680.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,896,962.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,628,205.00
	BELGIAN 0332 2.6	500,000.00	561,570.00
	BELGIAN 0333 3	700,000.00	962,962.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,036,310.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	735,805.00
	BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	465,964.00
	BELGIAN 0347 0.9	800,000.00	862,568.00
	BELGIAN 0348 1.7	300,000.00	379,680.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,501,262.00
	BELGIAN 1	1,000,000.00	1,092,390.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	452,260.00
	BELGIAN 1.6	850,000.00	1,047,829.00
	BELGIAN 1.9	500,000.00	622,920.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	751,935.00
	BELGIAN 3.75	800,000.00	1,383,968.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	995,300.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,490,835.00
	BTPS 0.35	500,000.00	476,965.00
	BTPS 0.45	1,500,000.00	1,497,000.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,972,360.00
	BTPS 0.85	700,000.00	667,464.00
	BTPS 0.9	2,250,000.00	2,249,617.50
	BTPS 0.95	2,000,000.00	1,997,880.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	1,997,940.00
	BTPS 1	1,000,000.00	1,002,700.00
	BTPS 1.2	1,000,000.00	1,006,020.00
	BTPS 1.25	1,600,000.00	1,571,344.00
	BTPS 1.35	2,000,000.00	2,016,580.00
	BTPS 1.45	2,000,000.00	2,024,400.00
	BTPS 1.45	1,800,000.00	1,811,394.00
	BTPS 1.45	1,000,000.00	1,002,470.00

BTPS 1.5	2,700,000.00	2,711,097.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,205,892.00	
BTPS 1.65	1,700,000.00	1,649,153.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,024,580.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,337,154.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,638,896.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,539,660.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,032,460.00	
BTPS 2.15	500,000.00	510,640.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,037,270.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,209,300.00	
BTPS 2.3	600,000.00	612,846.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,144,660.00	
BTPS 2.45	400,000.00	384,160.00	
BTPS 2.5	600,000.00	630,810.00	
BTPS 2.5	1,100,000.00	1,159,521.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,584,642.50	
BTPS 2.8	300,000.00	324,615.00	
BTPS 2.8	900,000.00	909,972.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,084,710.00	
BTPS 3	3,500,000.00	3,849,895.00	
BTPS 3.1	700,000.00	770,721.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,677,675.00	
BTPS 3.35	850,000.00	974,516.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	1,619,758.00	
BTPS 3.5	1,900,000.00	2,172,878.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,061,540.00	
BTPS 3.75	2,200,000.00	2,282,236.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,203,500.00	
BTPS 3.85	400,000.00	494,380.00	
BTPS 4	1,600,000.00	1,971,520.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,536,693.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,370,620.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,100,186.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,737,904.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,794,175.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,079,850.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,203,568.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,151,060.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,168,970.00	
BTPS 5	2,070,000.00	2,776,946.40	
BTPS 5	1,800,000.00	2,506,590.00	

BTPS 5	1,700,000.00	2,371,551.00
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,326,024.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,223,100.00
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,382,346.00
BTPS 6	2,200,000.00	3,066,954.00
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,273,121.00
BTPS 7.25	400,000.00	539,952.00
BTPS 9	300,000.00	381,285.00
BUNDESÖBL-173 0	2,200,000.00	2,213,090.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,030,450.00
BUNDESÖBL-176 0	2,000,000.00	2,034,940.00
DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,500,368.00
DEUTSCHLAND REP 0	500,000.00	524,215.00
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	308,400.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,800,000.00	1,910,754.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,101,405.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,035,831.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,645,775.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,400,000.00	1,496,656.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,624,215.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,173,400.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,396,382.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,236,427.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,250,000.00	1,740,375.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	500,000.00	531,495.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,388,686.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,181,140.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,319,020.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	3,000,000.00	3,284,820.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,636,155.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,455,902.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,658,138.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	3,586,779.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,142,828.00
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,122,640.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,792,099.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,307,504.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,400,000.00	2,444,470.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,150,000.00	2,339,962.50
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,488,051.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,487,010.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,510,008.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	834,480.00

DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,521,140.00	
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	404,396.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	420,192.00	
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	841,376.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	540,425.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	227,790.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,058,910.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,051,870.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,098,340.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	760,230.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	741,822.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,038,920.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,229,270.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,400,000.00	1,407,126.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,020,420.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,225,256.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,029,760.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,069,120.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,220,160.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	1,996,240.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,400,000.00	2,470,800.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,026,498.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,500,000.00	1,568,910.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,300,000.00	3,456,915.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,671,600.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,700,000.00	1,819,000.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,197,702.50	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,706,400.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	1,700,000.00	1,929,993.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,734,920.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,650,000.00	4,215,421.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	1,400,000.00	1,714,160.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,210,780.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,300,000.00	2,527,240.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,500,000.00	1,859,970.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,105,528.00	
FRANCE O.A.T. 2	1,900,000.00	2,559,300.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	2,033,570.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,774,884.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,367,090.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	2,550,000.00	3,109,189.50	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,354,350.00	

FRANCE O.A.T. 3.25	2,500,000.00	2,642,575.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,566,596.00
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,066,225.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,400,000.00	3,542,936.00
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,276,280.00
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,762,728.30
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,972,942.00
FRANCE O.A.T. 4.25	3,000,000.00	3,502,050.00
FRANCE O.A.T. 4.5	2,900,000.00	5,220,348.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,646,830.00
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,124,367.50
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,556,749.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,046,580.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	762,804.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	403,432.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	715,848.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	743,715.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,062,310.00
IRISH GOVT 1.1	600,000.00	648,288.00
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	467,812.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	352,554.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,289,650.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	726,798.00
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	570,835.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	561,250.00
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	1,015,976.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,800,000.00	1,818,216.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,021,210.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,039,890.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,300,000.00	1,362,062.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,200,000.00	1,271,292.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	330,810.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	900,000.00	974,349.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,089,010.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,721,216.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,108,940.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,595,625.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,338,730.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,067,552.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	837,448.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	783,643.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,366,533.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,100,000.00	1,855,194.00

NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,019,333.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,874.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	838,032.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	893,188.50	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	958,230.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	747,404.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,084,200.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	288,292.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	400,000.00	518,604.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,201,563.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,078,130.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	600,000.00	788,538.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	1,005,756.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,211,859.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,056,600.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,083,690.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,581,258.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,160,847.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	652,530.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,463,370.00	
SPANISH GOV'T 0	500,000.00	488,880.00	
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	993,390.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,013,660.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	503,985.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,019,020.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,807,352.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,091,220.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,673,680.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	628,956.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,045,116.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,262,688.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,320,648.00	
SPANISH GOV'T 1.85	400,000.00	433,264.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,200,000.00	1,294,248.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,863,608.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,172,720.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,700,000.00	1,953,385.00	
SPANISH GOV'T 2.7	850,000.00	1,059,057.50	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,316,552.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,793,456.00	
SPANISH GOV'T 3.45	900,000.00	1,357,533.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,158,685.00	

	SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,375,406.00
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,285,940.00
	SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,184,984.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,388,330.00
	SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,750,185.00
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,420,115.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,030,610.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,077,116.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,570,805.00
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	2,850,228.00
	SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,311,950.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,423,740.00
	SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	660,300.00
	SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,149,586.00
	ユーロ 小計	389,840,000.00	462,342,377.70 (53,788,912,221)
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,817,784.00
	UK TSY GILT 0.625	1,000,000.00	1,023,220.00
	UK TSY GILT 0.75	750,000.00	765,892.50
	UK TSY GILT 0.875	2,000,000.00	2,118,020.00
	UK TSY GILT 1	1,300,000.00	1,345,097.00
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,078,680.00
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,084,610.00
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	2,076,448.00
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	874,450.50
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,243,380.00
	UK TSY GILT 1.625	300,000.00	402,975.00
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,247,508.00
	UK TSY GILT 1.75	1,500,000.00	1,786,140.00
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	973,192.50
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,212,706.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,895,966.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,950,928.00
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,448,148.00
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,518,624.00
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,730,717.00
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	3,396,219.00
	UK TSY GILT 3.75	1,500,000.00	1,574,640.00
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	3,112,304.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,609,920.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,895,312.00
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,437,447.00
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,308,564.00

	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,642,599.00	
	UK TSY GILT 4.25	850,000.00	1,419,542.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,217,085.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,830,905.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,787,256.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,778,998.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,711,721.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,454,880.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,685,693.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	2,086,692.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,603,927.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	971,750.00	
	UK TSY GILT 8	820,000.00	891,979.60	
	英ポンド 小計	51,420,000.00	74,011,921.10 (9,851,726,817)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,284,320.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	4,400,000.00	4,745,752.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,450,660.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,701,400.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,647,760.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	7,259,536.00	
	スウェーデンクローナ 小計	33,000,000.00	38,089,428.00 (407,937,773)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,113,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,689,350.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,179,700.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,941,380.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,287,400.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	4,000,000.00	4,408,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,390,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,219,900.00	
	ノルウェークローネ 小計	31,200,000.00	33,229,730.00 (336,949,462)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	8,100,000.00	8,578,710.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,336,500.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,711,600.00	
	DENMARK - BULLET 3	5,000,000.00	5,249,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	19,651,800.00	
	デンマーククローネ 小計	34,600,000.00	45,527,610.00 (710,230,716)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	3,045,570.00	
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,030,280.00	

	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,878,990.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,266,640.00
	POLAND GOVT BOND 2.75	1,000,000.00	1,123,740.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,701,090.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,700,000.00	3,009,636.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,312,440.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,693,448.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,400,000.00	1,912,974.00
	ポーランドズロチ 小計	30,900,000.00	33,974,808.00 (871,453,825)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	1,400,000.00	1,479,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	1,028,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,575,675.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,000,000.00	2,229,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,557,765.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,738,680.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,700,000.00	1,952,620.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,093,536.80
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,300,000.00	1,524,510.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	962,160.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,809,315.20
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,145,100.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,497,530.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	850,000.00	1,095,055.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,635,888.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,150,000.00	2,600,210.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,984,640.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	2,300,000.00	2,948,370.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,308,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	1,800,000.00	1,902,582.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,801,875.00
	オーストラリアドル 小計	34,950,000.00	40,871,512.00 (2,818,499,467)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,122,729.30
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,283,160.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	502,800.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	899,850.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	470,000.00
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	772,341.50
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	849,440.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	822,250.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,764,000.00
		7,450,000.00	8,486,570.80

シンガポールドル 小計			(641,584,752)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,154,543.90
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,311,592.37
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,658,482.46
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,627,186.00
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	3,520,177.20
マレーシアリングgit 小計		28,200,000.00	30,271,981.93 (747,112,514)
合計			151,493,147,031 (151,493,147,031)

（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 209銘柄	50.0%	51.1%
カナダドル	国債証券 26銘柄	1.8%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券 268銘柄	34.8%	35.5%
英ポンド	国債証券 40銘柄	6.4%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 21銘柄	1.8%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 9銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（2019年 4月26日現在）	（2020年 4月27日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	50,359,494	32,532,938
金銭信託	415,258,078	159,106,806
コール・ローン	134,152,199	163,113,095
国債証券	29,078,480,015	25,938,280,709
派生商品評価勘定	41,355,593	229,869,827
未収入金	-	96,724,472
未収利息	230,974,541	161,207,253
前払費用	16,985,596	51,268,250

	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
流動資産合計	29,967,565,516	26,832,103,350
資産合計	29,967,565,516	26,832,103,350
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	127,368,030	21,944,210
未払金	7,120,428	11,869,938
未払解約金	373,800,000	1,000,000
未払利息	393	470
その他未払費用	10,280	37,917
流動負債合計	508,299,131	34,852,535
負債合計	508,299,131	34,852,535
純資産の部		
元本等		
元本	20,968,888,985	17,571,381,562
剰余金		
剰余金又は欠損金()	8,490,377,400	9,225,869,253
元本等合計	29,459,266,385	26,797,250,815
純資産合計	29,459,266,385	26,797,250,815
負債純資産合計	29,967,565,516	26,832,103,350

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2019年 4月26日現在)	(2020年 4月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,968,888,985口	17,571,381,562口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4049円 (10,000口当たりの純資産額 14,049円)	1口当たり純資産額 1.5251円 (10,000口当たりの純資産額 15,251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 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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	(2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437
	米ドル	13,705,195,380	-	13,824,746,000	119,550,620
	カナダドル	564,236,800	-	563,312,000	924,800
	メキシコペソ	245,669,510	-	252,439,000	6,769,490
	ユーロ	11,360,099,278	-	11,331,018,000	29,081,278
	英ポンド	1,977,945,825	-	1,973,759,000	4,186,825
	スウェーデンク ローナ	106,512,530	-	104,219,000	2,293,530
	ノルウェークロー ネ	73,408,590	-	73,302,000	106,590
	デンマーククロー ネ	152,034,610	-	151,606,000	428,610
	ポーランドズロチ	190,955,820	-	191,004,000	48,180
	オーストラリアド ル	622,982,500	-	618,649,000	4,333,500
	シンガポールドル	253,660,600	-	253,952,000	291,400
	南アフリカランド	165,396,120	-	166,104,000	707,880
合計		29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437

(2020年 4月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	26,365,178,617	-	26,157,253,000	207,925,617
	米ドル	13,266,376,055	-	13,253,699,700	12,676,355
	カナダドル	489,764,751	-	488,762,500	1,002,251
	メキシコペソ	182,319,145	-	173,401,800	8,917,345
	ユーロ	9,565,089,604	-	9,377,810,000	187,279,604
	英ポンド	1,657,387,598	-	1,652,853,600	4,533,998
	スウェーデンク ローナ	74,345,751	-	73,363,500	982,251

ノルウェークローネ	57,075,892	-	56,018,900	1,056,992
デンマーククローネ	127,934,163	-	125,580,000	2,354,163
ポーランドズロチ	150,308,989	-	148,397,700	1,911,289
オーストラリアドル	469,908,634	-	489,474,000	19,565,366
シンガポールドル	221,622,520	-	221,449,400	173,120
南アフリカランド	103,045,515	-	96,441,900	6,603,615
合計	26,365,178,617	-	26,157,253,000	207,925,617

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年 4月27日 至 2020年 4月27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)

(2019年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	37,484,650,129円
同期中における追加設定元本額	4,051,374,366円
同期中における一部解約元本額	20,567,135,510円

2019年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	4,528,795,593円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,212,263,331円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	30,628,517円
イオン・バランス戦略ファンド	484,931,670円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	405,127,343円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	119,950,191円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	175,969,660円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	36,277,400円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	8,715,362円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,505,272円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,306,637,177円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,816,640円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,862,382,122円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,845,668,421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>	80,321,679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>	699,835,651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>	335,294,032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>	825,768,924円
合計	20,968,888,985円

(2020年 4月27日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,968,888,985円
同期中における追加設定元本額	12,117,777,948円
同期中における一部解約元本額	15,515,285,371円
2020年 4月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	3,835,598,494円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,261,229,504円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	1,053,241,195円
イオン・バランス戦略ファンド	700,079,802円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	75,282,771円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	6,884,036円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	14,628,114円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	6,002,931円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	6,248,863円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,750,221円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,092,313,139円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,809,280円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,304,141,102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>	138,639,058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>	482,245,788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>	580,287,264円
合計	17,571,381,562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	400,000.00	403,250.00	
		US TREASURY N/B 1.125	300,000.00	303,421.87	
		US TREASURY N/B 1.125	800,000.00	809,312.50	
		US TREASURY N/B 1.125	400,000.00	405,156.25	
		US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	505,078.12	
		US TREASURY N/B 1.25	200,000.00	203,109.37	
		US TREASURY N/B 1.25	900,000.00	935,226.56	
		US TREASURY N/B 1.375	850,000.00	860,691.41	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,027,500.00	
		US TREASURY N/B 1.375	950,000.00	982,804.68	
		US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	207,250.00	
		US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	311,015.62	
		US TREASURY N/B 1.5	550,000.00	560,097.65	
		US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	613,359.37	
		US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,028,906.25	
		US TREASURY N/B 1.5	1,200,000.00	1,243,031.25	
		US TREASURY N/B 1.5	1,150,000.00	1,210,375.00	
		US TREASURY N/B 1.5	1,450,000.00	1,541,757.81	
		US TREASURY N/B 1.5	230,000.00	245,237.50	
		US TREASURY N/B 1.5	460,000.00	499,423.43	
		US TREASURY N/B 1.625	1,700,000.00	1,754,054.69	
		US TREASURY N/B 1.625	1,300,000.00	1,345,093.75	
		US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	828,687.50	
		US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,040,546.88	
		US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	1,041,953.13	
		US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	836,687.50	
		US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	640,265.62	
		US TREASURY N/B 1.625	650,000.00	694,687.50	
		US TREASURY N/B 1.625	700,000.00	750,312.50	
		US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	536,601.56	
		US TREASURY N/B 1.625	1,050,000.00	1,149,667.97	

US TREASURY N/B 1.75	800,000.00	815,750.00
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	205,578.12
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	618,703.12
US TREASURY N/B 1.75	300,000.00	309,445.31
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,036,328.13
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,040,625.00
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,044,531.25
US TREASURY N/B 1.75	800,000.00	886,312.49
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	615,796.87
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	720,234.37
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	515,078.12
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	309,468.75
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,032,812.50
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,038,359.38
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	319,875.00
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	651,234.37
US TREASURY N/B 2	800,000.00	816,125.00
US TREASURY N/B 2	800,000.00	819,437.50
US TREASURY N/B 2	250,000.00	256,738.28
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,027,500.00
US TREASURY N/B 2	700,000.00	721,000.00
US TREASURY N/B 2	600,000.00	619,125.00
US TREASURY N/B 2	700,000.00	727,835.94
US TREASURY N/B 2	1,400,000.00	1,460,921.87
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,048,593.74
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,066,484.38
US TREASURY N/B 2	500,000.00	533,867.19
US TREASURY N/B 2	600,000.00	641,296.87
US TREASURY N/B 2	600,000.00	649,734.37
US TREASURY N/B 2	900,000.00	987,257.81
US TREASURY N/B 2	320,000.00	386,075.00
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	818,375.00
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,025,156.25
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	410,906.25
US TREASURY N/B 2.125	750,000.00	773,964.84
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	832,750.00
US TREASURY N/B 2.125	1,100,000.00	1,154,656.25
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,817,140.62
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	856,250.00
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	752,992.19
US TREASURY N/B 2.125	1,250,000.00	1,347,851.56
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	540,156.25

US TREASURY N/B 2.125	720,000.00	791,943.74
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	611,671.87
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	510,585.94
US TREASURY N/B 2.25	550,000.00	588,843.75
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	1,072,578.13
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	867,687.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	976,851.56
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	543,906.25
US TREASURY N/B 2.25	720,000.00	791,662.49
US TREASURY N/B 2.25	450,000.00	502,628.90
US TREASURY N/B 2.25	920,000.00	1,034,712.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	1,014,890.62
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	372,093.75
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	758,789.06
US TREASURY N/B 2.375	100,000.00	101,968.75
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	510,820.31
US TREASURY N/B 2.375	400,000.00	416,125.00
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,086,328.13
US TREASURY N/B 2.375	750,000.00	847,031.25
US TREASURY N/B 2.375	800,000.00	927,000.00
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	648,984.36
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	1,038,828.13
US TREASURY N/B 2.5	300,000.00	321,843.75
US TREASURY N/B 2.5	830,000.00	902,171.09
US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	770,492.19
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	1,006,382.81
US TREASURY N/B 2.5	190,000.00	244,276.17
US TREASURY N/B 2.5	500,000.00	646,562.50
US TREASURY N/B 2.5	600,000.00	777,281.25
US TREASURY N/B 2.625	700,000.00	719,414.06
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	415,625.00
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	554,726.56
US TREASURY N/B 2.625	550,000.00	617,460.93
US TREASURY N/B 2.625	1,200,000.00	1,349,250.00
US TREASURY N/B 2.625	800,000.00	941,250.00
US TREASURY N/B 2.75	850,000.00	879,816.40
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	971,648.44
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	977,273.44
US TREASURY N/B 2.75	500,000.00	557,031.25
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	672,187.50
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	674,062.50
US TREASURY N/B 2.75	850,000.00	993,570.30
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	527,968.75

US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	409,617.18
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	820,968.75
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	728,765.62
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	982,265.62
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,123,515.62
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	675,000.00
US TREASURY N/B 2.875	640,000.00	757,350.00
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	831,960.94
US TREASURY N/B 2.875	200,000.00	269,906.25
US TREASURY N/B 2.875	400,000.00	548,968.75
US TREASURY N/B 2.875	750,000.00	1,041,093.75
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	992,796.87
US TREASURY N/B 3	620,000.00	705,976.56
US TREASURY N/B 3	400,000.00	548,359.37
US TREASURY N/B 3	900,000.00	1,251,562.50
US TREASURY N/B 3	610,000.00	852,332.02
US TREASURY N/B 3	600,000.00	842,531.25
US TREASURY N/B 3	250,000.00	355,410.15
US TREASURY N/B 3	620,000.00	882,289.06
US TREASURY N/B 3	400,000.00	572,125.00
US TREASURY N/B 3	480,000.00	690,037.49
US TREASURY N/B 3	550,000.00	794,707.03
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	825,187.50
US TREASURY N/B 3.125	750,000.00	910,371.08
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	417,703.12
US TREASURY N/B 3.125	150,000.00	209,179.68
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	559,437.50
US TREASURY N/B 3.125	500,000.00	707,851.56
US TREASURY N/B 3.125	600,000.00	878,765.62
US TREASURY N/B 3.375	450,000.00	659,777.34
US TREASURY N/B 3.375	640,000.00	982,550.00
US TREASURY N/B 3.5	100,000.00	144,691.40
US TREASURY N/B 3.625	650,000.00	980,332.03
US TREASURY N/B 3.625	500,000.00	758,515.62
US TREASURY N/B 3.75	550,000.00	846,097.65
US TREASURY N/B 3.875	420,000.00	639,646.87
US TREASURY N/B 4.25	350,000.00	551,769.53
US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	638,484.37
US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	316,156.25
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	481,980.46
US TREASURY N/B 4.375	360,000.00	586,968.75
US TREASURY N/B 4.5	350,000.00	544,250.00

	US TREASURY N/B 4.625	300,000.00	496,101.56
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	278,640.62
	US TREASURY N/B 5.25	260,000.00	365,096.87
	US TREASURY N/B 5.375	240,000.00	360,243.74
	US TREASURY N/B 5.5	300,000.00	420,796.87
	US TREASURY N/B 6.5	700,000.00	973,601.56
	US TREASURY N/B 8	1,500,000.00	1,681,406.25
	米ドル 小計	108,680,000.00	123,196,258.64 (13,255,917,429)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	400,000.00	401,340.00
	CANADA-GOV'T 0.75	200,000.00	200,736.60
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	301,740.00
	CANADA-GOV'T 1	350,000.00	362,680.50
	CANADA-GOV'T 1.5	150,000.00	153,088.50
	CANADA-GOV'T 1.5	500,000.00	518,150.00
	CANADA-GOV'T 1.5	190,000.00	201,979.50
	CANADA-GOV'T 1.75	280,000.00	291,300.80
	CANADA-GOV'T 2	200,000.00	210,740.00
	CANADA-GOV'T 2	200,000.00	223,700.00
	CANADA-GOV'T 2	40,000.00	48,520.00
	CANADA-GOV'T 2.25	440,000.00	480,620.80
	CANADA-GOV'T 2.25	190,000.00	219,013.00
	CANADA-GOV'T 2.5	250,000.00	271,130.00
	CANADA-GOV'T 2.75	350,000.00	367,710.00
	CANADA-GOV'T 2.75	300,000.00	413,034.00
	CANADA-GOV'T 3.25	450,000.00	464,377.50
	CANADA-GOV'T 3.5	200,000.00	301,940.00
	CANADA-GOV'T 4	250,000.00	384,182.50
	CANADA-GOV'T 5	220,000.00	358,166.60
	CANADA-GOV'T 5.75	160,000.00	258,476.80
	カナダドル 小計	5,620,000.00	6,432,627.10 (490,616,468)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	2,000,000.00	2,341,060.00
	MEXICAN BONOS 5.75	4,500,000.00	4,431,915.00
	MEXICAN BONOS 6.5	5,000,000.00	5,050,166.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	4,090,029.60
	MEXICAN BONOS 7.5	4,700,000.00	4,959,966.40
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,049,058.60
	MEXICAN BONOS 7.75	3,000,000.00	3,109,694.10
	MEXICAN BONOS 7.75	4,900,000.00	4,801,664.84
	MEXICAN BONOS 8	4,500,000.00	4,887,765.00
	MEXICAN BONOS 8	1,500,000.00	1,639,455.00
	MEXICAN BONOS 8.5	2,500,000.00	2,770,050.00

	MEXICAN BONOS 8.5	1,000,000.00	1,062,175.80
	メキシコペソ 小計	38,600,000.00	40,193,000.34 (173,231,831)
ユーロ	BELGIAN 0.1	150,000.00	149,805.00
	BELGIAN 0.2	400,000.00	408,400.00
	BELGIAN 0.4	50,000.00	48,272.00
	BELGIAN 0.8	100,000.00	105,469.00
	BELGIAN 0.8	100,000.00	106,421.00
	BELGIAN 0.8	360,000.00	384,364.80
	BELGIAN 0291 5.5	120,000.00	173,006.40
	BELGIAN 0304 5	250,000.00	419,407.50
	BELGIAN 0308 4	300,000.00	326,115.00
	BELGIAN 0320 4.25	200,000.00	344,708.00
	BELGIAN 0321 4.25	100,000.00	106,746.00
	BELGIAN 0324 4.5	100,000.00	127,968.00
	BELGIAN 0325 4.25	200,000.00	223,172.00
	BELGIAN 0328 2.25	100,000.00	108,547.00
	BELGIAN 0332 2.6	100,000.00	112,314.00
	BELGIAN 0333 3	120,000.00	165,079.20
	BELGIAN 0338 0.5	100,000.00	103,631.00
	BELGIAN 0347 0.9	250,000.00	269,552.50
	BELGIAN 1	200,000.00	214,466.00
	BELGIAN 1	250,000.00	273,097.50
	BELGIAN 1.6	140,000.00	172,583.60
	BELGIAN 1.9	150,000.00	186,876.00
	BELGIAN 2.15	200,000.00	300,774.00
	BELGIAN 3.75	100,000.00	172,996.00
	BTPS 0.35	400,000.00	397,556.00
	BTPS 0.45	500,000.00	499,000.00
	BTPS 0.65	300,000.00	295,854.00
	BTPS 0.95	400,000.00	399,588.00
	BTPS 1.25	500,000.00	491,045.00
	BTPS 1.35	350,000.00	352,901.50
	BTPS 1.35	500,000.00	478,405.00
	BTPS 1.45	700,000.00	708,540.00
	BTPS 1.45	500,000.00	503,165.00
	BTPS 1.45	100,000.00	90,789.00
	BTPS 1.5	600,000.00	602,466.00
	BTPS 1.6	590,000.00	592,896.90
	BTPS 1.65	400,000.00	388,036.00
	BTPS 1.85	300,000.00	307,374.00
	BTPS 2	220,000.00	226,287.60
	BTPS 2.05	150,000.00	153,966.00

BTPS 2.15	100,000.00	102,128.00	
BTPS 2.2	400,000.00	414,908.00	
BTPS 2.25	250,000.00	251,937.50	
BTPS 2.3	800,000.00	817,128.00	
BTPS 2.45	250,000.00	260,150.00	
BTPS 2.5	350,000.00	367,972.50	
BTPS 2.5	350,000.00	368,938.50	
BTPS 2.7	330,000.00	337,375.50	
BTPS 2.8	140,000.00	141,551.20	
BTPS 2.95	150,000.00	162,706.50	
BTPS 3	200,000.00	219,994.00	
BTPS 3.1	100,000.00	110,103.00	
BTPS 3.25	160,000.00	178,952.00	
BTPS 3.35	250,000.00	286,622.50	
BTPS 3.45	200,000.00	231,394.00	
BTPS 3.75	400,000.00	412,308.00	
BTPS 3.75	300,000.00	330,525.00	
BTPS 3.85	100,000.00	123,595.00	
BTPS 4	280,000.00	345,016.00	
BTPS 4.5	200,000.00	220,582.00	
BTPS 4.5	200,000.00	233,354.00	
BTPS 4.75	300,000.00	315,912.00	
BTPS 4.75	300,000.00	335,301.00	
BTPS 4.75	500,000.00	615,970.00	
BTPS 4.75	200,000.00	275,446.00	
BTPS 5	200,000.00	215,106.00	
BTPS 5	400,000.00	536,608.00	
BTPS 5	250,000.00	348,137.50	
BTPS 5	410,000.00	571,962.30	
BTPS 5.25	360,000.00	465,847.20	
BTPS 5.5	350,000.00	389,042.50	
BTPS 5.75	200,000.00	280,276.00	
BTPS 6	250,000.00	348,517.50	
BTPS 6.5	550,000.00	735,421.50	
BTPS 9	350,000.00	444,832.50	
BUNDESÖBL-174 0	200,000.00	202,030.00	
BUNDESÖBL-175 0	200,000.00	202,804.00	
BUNDESÖBL-178 0	300,000.00	307,446.00	
BUNDESSCHATZANW 0	500,000.00	503,755.00	
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	312,546.00	
DEUTSCHLAND REP 0	150,000.00	157,264.50	
DEUTSCHLAND REP 0	100,000.00	104,785.00	

DEUTSCHLAND REP 0	30,000.00	30,840.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	424,612.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	427,780.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	450,000.00	482,170.50
DEUTSCHLAND REP 0.5	450,000.00	476,239.50
DEUTSCHLAND REP 0.5	250,000.00	267,260.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	200,000.00	216,562.00
DEUTSCHLAND REP 1	100,000.00	107,414.00
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	218,188.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	200,000.00	278,460.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	450,000.00	473,697.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	350,000.00	372,046.50
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	427,288.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	654,342.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	600,000.00	632,460.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	100,000.00	109,494.00
DEUTSCHLAND REP 2	250,000.00	261,612.50
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	218,154.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	200,000.00	207,986.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	200,000.00	332,558.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	400,000.00	683,196.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	250,000.00	261,672.50
DEUTSCHLAND REP 3.25	350,000.00	624,991.50
DEUTSCHLAND REP 4	270,000.00	468,396.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	250,000.00	471,605.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	150,000.00	261,907.50
DEUTSCHLAND REP 4.75	250,000.00	508,687.50
DEUTSCHLAND REP 5.5	200,000.00	330,678.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	609,674.10
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	251,668.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	100,000.00	166,896.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	240,000.00	365,073.60
FINNISH GOV'T 0.875	100,000.00	106,542.00
FINNISH GOV'T 1.125	100,000.00	113,895.00
FINNISH GOV'T 1.375	50,000.00	64,189.50
FINNISH GOV'T 1.5	100,000.00	105,891.00
FINNISH GOV'T 1.625	100,000.00	105,187.00
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	219,668.00
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	152,046.00
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	123,637.00
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	703,563.00
FRANCE O.A.T. 0	250,000.00	252,552.50
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	708,036.00

FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	304,191.00	
FRANCE O.A.T. 0	150,000.00	152,520.00	
FRANCE O.A.T. 0	400,000.00	399,248.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	330,000.00	339,735.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	540,000.00	563,554.80	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,150,000.00	1,204,682.50	
FRANCE O.A.T. 0.75	400,000.00	427,456.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	300,000.00	321,000.00	
FRANCE O.A.T. 1	500,000.00	536,025.00	
FRANCE O.A.T. 1	330,000.00	357,244.80	
FRANCE O.A.T. 1.25	300,000.00	340,587.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	580,000.00	660,939.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	650,000.00	750,691.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	350,000.00	428,540.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	650,000.00	695,669.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	750,000.00	824,100.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	150,000.00	185,997.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	150,000.00	207,286.50	
FRANCE O.A.T. 2	300,000.00	404,100.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	700,000.00	749,210.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	430,000.00	477,411.80	
FRANCE O.A.T. 2.5	550,000.00	686,257.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	430,000.00	524,294.70	
FRANCE O.A.T. 3	250,000.00	267,717.50	
FRANCE O.A.T. 3.25	450,000.00	475,663.50	
FRANCE O.A.T. 3.25	300,000.00	486,354.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	850,000.00	1,042,516.50	
FRANCE O.A.T. 3.75	100,000.00	104,204.00	
FRANCE O.A.T. 4	340,000.00	556,967.60	
FRANCE O.A.T. 4	50,000.00	100,829.50	
FRANCE O.A.T. 4	300,000.00	637,059.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	700,410.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	550,000.00	990,066.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	360,000.00	596,754.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	200,000.00	299,954.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	400,000.00	677,476.00	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	539,544.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	254,268.00	
IRISH GOVT 0.8	100,000.00	102,264.00	
IRISH GOVT 1.1	130,000.00	140,462.40	
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	117,518.00	
IRISH GOVT 2	200,000.00	257,930.00	

IRISH GOVT 2.4	100,000.00	121,133.00
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	228,334.00
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	224,500.00
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	380,991.00
NETHERLANDS GOVT 0	250,000.00	252,530.00
NETHERLANDS GOVT 0	170,000.00	173,605.70
NETHERLANDS GOVT 0.25	450,000.00	467,950.50
NETHERLANDS GOVT 0.5	120,000.00	127,129.20
NETHERLANDS GOVT 0.5	60,000.00	66,162.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	550,000.00	595,435.50
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	108,901.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	200,000.00	215,152.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	100,000.00	106,375.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	210,000.00	281,133.30
NETHERLANDS GOVT 2.75	200,000.00	344,592.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	350,000.00	366,383.50
NETHERLANDS GOVT 3.75	200,000.00	223,898.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	160,000.00	291,265.60
NETHERLANDS GOVT 4	200,000.00	337,308.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	150,000.00	218,428.50
REP OF AUSTRIA 0.5	150,000.00	157,131.00
REP OF AUSTRIA 0.5	150,000.00	157,621.50
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	212,940.00
REP OF AUSTRIA 0.75	400,000.00	427,088.00
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	216,840.00
REP OF AUSTRIA 1.5	100,000.00	129,651.00
REP OF AUSTRIA 1.75	300,000.00	323,439.00
REP OF AUSTRIA 2.4	150,000.00	197,134.50
REP OF AUSTRIA 3.15	100,000.00	167,626.00
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	220,338.00
REP OF AUSTRIA 3.5	400,000.00	422,640.00
REP OF AUSTRIA 3.8	140,000.00	316,251.60
REP OF AUSTRIA 4.15	200,000.00	332,438.00
REP OF AUSTRIA 4.85	200,000.00	261,012.00
SPANISH GOV'T 0.25	400,000.00	397,356.00
SPANISH GOV'T 0.35	300,000.00	300,699.00
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	302,049.00
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	503,985.00
SPANISH GOV'T 0.6	300,000.00	291,729.00
SPANISH GOV'T 0.75	400,000.00	403,804.00
SPANISH GOV'T 1.3	350,000.00	363,916.00
SPANISH GOV'T 1.4	350,000.00	366,117.50
SPANISH GOV'T 1.45	200,000.00	209,652.00

	SPANISH GOV'T 1.45	280,000.00	294,011.20
	SPANISH GOV'T 1.5	200,000.00	210,448.00
	SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	316,452.00
	SPANISH GOV'T 1.85	150,000.00	162,474.00
	SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	647,124.00
	SPANISH GOV'T 1.95	350,000.00	383,684.00
	SPANISH GOV'T 2.35	300,000.00	344,715.00
	SPANISH GOV'T 2.7	210,000.00	261,649.50
	SPANISH GOV'T 2.75	400,000.00	441,248.00
	SPANISH GOV'T 2.9	210,000.00	269,018.40
	SPANISH GOV'T 3.45	130,000.00	196,088.10
	SPANISH GOV'T 3.8	350,000.00	397,652.50
	SPANISH GOV'T 4.2	280,000.00	403,099.20
	SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	342,891.00
	SPANISH GOV'T 4.65	250,000.00	303,470.00
	SPANISH GOV'T 4.7	250,000.00	398,055.00
	SPANISH GOV'T 4.8	100,000.00	116,679.00
	SPANISH GOV'T 4.9	200,000.00	322,682.00
	SPANISH GOV'T 5.15	300,000.00	406,122.00
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	346,186.00
	SPANISH GOV'T 5.75	300,000.00	462,390.00
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	661,020.00
	SPANISH GOV'T 6	400,000.00	572,652.00
	ユーロ 小計	67,320,000.00	79,317,885.30 (9,227,842,775)
英bond	UK TSY GILT 0.5	470,000.00	474,643.60
	UK TSY GILT 0.625	190,000.00	194,411.80
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	204,238.00
	UK TSY GILT 0.875	230,000.00	243,572.30
	UK TSY GILT 1	250,000.00	258,672.50
	UK TSY GILT 1.25	150,000.00	161,802.00
	UK TSY GILT 1.25	70,000.00	78,512.00
	UK TSY GILT 1.5	170,000.00	184,383.70
	UK TSY GILT 1.5	200,000.00	244,288.00
	UK TSY GILT 1.625	80,000.00	127,192.80
	UK TSY GILT 1.625	250,000.00	280,422.50
	UK TSY GILT 1.625	40,000.00	53,730.00
	UK TSY GILT 1.75	280,000.00	291,085.20
	UK TSY GILT 1.75	180,000.00	214,336.80
	UK TSY GILT 1.75	240,000.00	311,421.60
	UK TSY GILT 1.75	220,000.00	315,242.40
	UK TSY GILT 2	150,000.00	165,369.00

	UK TSY GILT 2.25	250,000.00	268,145.00
	UK TSY GILT 2.5	220,000.00	405,752.60
	UK TSY GILT 2.75	300,000.00	334,188.00
	UK TSY GILT 3.25	240,000.00	377,793.60
	UK TSY GILT 3.5	250,000.00	413,745.00
	UK TSY GILT 3.5	310,000.00	726,088.20
	UK TSY GILT 3.75	150,000.00	157,464.00
	UK TSY GILT 3.75	220,000.00	427,941.80
	UK TSY GILT 4	250,000.00	572,840.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	261,354.00
	UK TSY GILT 4.25	250,000.00	363,490.00
	UK TSY GILT 4.25	160,000.00	250,300.80
	UK TSY GILT 4.25	220,000.00	367,411.00
	UK TSY GILT 4.25	360,000.00	613,962.00
	UK TSY GILT 4.25	150,000.00	283,090.50
	UK TSY GILT 4.25	170,000.00	337,592.80
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	444,588.00
	UK TSY GILT 4.5	150,000.00	233,416.50
	UK TSY GILT 4.5	200,000.00	363,686.00
	UK TSY GILT 4.75	200,000.00	293,164.00
	UK TSY GILT 4.75	210,000.00	365,171.10
	UK TSY GILT 5	300,000.00	370,137.00
	UK TSY GILT 6	250,000.00	373,750.00
	UK TSY GILT 8	250,000.00	271,945.00
	英債券 小計	8,830,000.00	12,680,341.10 (1,687,880,203)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	400,000.00	428,432.00
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	350,000.00	377,093.50
	SWEDISH GOVRNMNT 1	1,620,000.00	1,747,299.60
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	900,000.00	957,942.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	850,000.00	969,238.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,200,000.00	1,297,164.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	600,000.00	946,896.00
	スウェーデンクローナ 小計	5,920,000.00	6,724,065.10 (72,014,737)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	250,000.00	264,150.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	800,000.00	843,280.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,059,900.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	400,000.00	430,400.00
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	100,000.00	108,940.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	600,000.00	628,740.00
	NORWEGIAN GOV'T 2	400,000.00	440,880.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	800,000.00	878,000.00

	NORWEGIAN GOV'T 3.75	800,000.00	829,320.00
ノルウェークローネ 小計		5,150,000.00	5,483,610.00 (55,603,805)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	1,350,000.00	1,429,785.00
	DENMARK - BULLET 0.5	1,500,000.00	1,598,100.00
	DENMARK - BULLET 1.5	150,000.00	160,095.00
	DENMARK - BULLET 1.75	400,000.00	447,440.00
	DENMARK - BULLET 3	1,100,000.00	1,154,780.00
	DENMARK - BULLET 4.5	1,400,000.00	2,620,240.00
	DENMARK - BULLET 7	420,000.00	563,556.00
デンマーククローネ 小計		6,320,000.00	7,973,996.00 (124,394,337)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.75	300,000.00	304,557.00
	POLAND GOVT BOND 2.25	700,000.00	744,275.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	600,000.00	650,532.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	800,000.00	871,104.00
	POLAND GOVT BOND 2.75	220,000.00	247,222.80
	POLAND GOVT BOND 3.25	350,000.00	390,635.00
	POLAND GOVT BOND 4	1,000,000.00	1,114,680.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	800,000.00	862,488.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	500,000.00	561,135.00
ポーランドズロチ 小計		5,270,000.00	5,746,628.80 (147,401,028)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.25	170,000.00	174,822.22
	AUSTRALIAN GOVT. 2	300,000.00	308,580.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	110,000.00	115,549.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	350,000.00	390,145.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	280,000.00	323,092.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	300,000.00	328,641.60
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	450,000.00	516,870.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	465,230.40
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	150,000.00	180,405.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	30,000.00	36,075.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	258,473.60
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	400,000.00	451,600.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	450,000.00	535,185.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	257,660.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	408,972.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	280,000.00	338,632.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	500,000.00	640,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	500,000.00	577,050.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	500,000.00	528,495.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	100,000.00	112,075.00

オーストラリアドル 小計		5,970,000.00	6,948,503.32 (479,168,788)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	300,000.00	303,597.00
	SINGAPORE GOV'T 2.125	400,000.00	432,400.00
	SINGAPORE GOV'T 2.25	150,000.00	153,099.45
	SINGAPORE GOV'T 2.625	250,000.00	283,000.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	320,790.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	100,000.00	125,700.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	257,100.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	340,000.00	395,933.40
	SINGAPORE GOV'T 3	150,000.00	165,501.75
	SINGAPORE GOV'T 3.125	200,000.00	212,360.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	250,000.00	316,250.00
シンガポールドル 小計		2,640,000.00	2,965,731.60 (224,209,308)
合計			25,938,280,709 (25,938,280,709)

(注)金額欄の()内は、外貨建保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 165銘柄	49.5%	51.1%
カナダドル	国債証券 21銘柄	1.8%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	0.6%	0.7%
ユーロ	国債証券 233銘柄	34.4%	35.6%
英ポンド	国債証券 41銘柄	6.3%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 11銘柄	0.8%	0.9%

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。

【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6期中間計算期間(2020年4月28日から2020年10月27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。

【アセットアロケーション・ファンド(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	6,314,948
コール・ローン	263,128,679
投資証券	1,533,611,560
親投資信託受益証券	9,910,522,310
派生商品評価勘定	14,816,186
未収入金	32,000,000
流動資産合計	11,760,393,683
資産合計	
11,760,393,683	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	34,488,905
未払受託者報酬	2,105,959
未払委託者報酬	63,178,734
未払利息	580
その他未払費用	423,598
流動負債合計	100,197,776
負債合計	
100,197,776	
純資産の部	
元本等	
元本	11,462,743,982
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	197,451,925
元本等合計	11,660,195,907
純資産合計	
11,660,195,907	
負債純資産合計	11,760,393,683

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
営業収益	
受取配当金	23,814,167
有価証券売買等損益	497,268,232
為替差損益	14,764,128
営業収益合計	506,318,271
営業費用	
支払利息	100,316
受託者報酬	2,105,959
委託者報酬	63,178,734
その他費用	564,831
営業費用合計	65,949,840
営業利益又は営業損失（ ）	440,368,431
経常利益又は経常損失（ ）	440,368,431
中間純利益又は中間純損失（ ）	440,368,431
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（ ）	71,512,319
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	213,887,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,483,272
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	39,997,410
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,485,862
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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（ ）	197,451,925

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2020年 4月28日から2020年10月27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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	11,462,743,982口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0172円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,172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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、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）

第6期中間計算期間（2020年10月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,260,636,256	-	1,245,820,070	14,816,186
	米ドル	1,260,636,256	-	1,245,820,070	14,816,186
	合計	1,260,636,256	-	1,245,820,070	14,816,186

（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) 中間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。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。

・ 中間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) 中間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、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)
期首元本額	13,933,783,423円
期中追加設定元本額	144,267,083円
期中一部解約元本額	2,615,306,524円

【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	7,120,670
コール・ローン	187,899,060
投資証券	1,734,063,372
親投資信託受益証券	6,588,969,533
派生商品評価勘定	17,077,676
未収入金	14,000,000
流動資産合計	8,549,130,311
資産合計	
8,549,130,311	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,556,564
未払受託者報酬	1,528,404
未払委託者報酬	45,852,221
未払利息	414
その他未払費用	307,363
流動負債合計	64,244,966
負債合計	
64,244,966	
純資産の部	
元本等	
元本	8,258,422,263
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	226,463,082
元本等合計	8,484,885,345
純資産合計	
8,484,885,345	
負債純資産合計	8,549,130,311

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
営業収益	
受取配当金	29,162,116
有価証券売買等損益	617,276,066
為替差損益	14,197,158
営業収益合計	632,241,024
営業費用	
支払利息	72,757
受託者報酬	1,528,404
委託者報酬	45,852,221
その他費用	459,383
営業費用合計	47,912,765
営業利益又は営業損失()	584,328,259
経常利益又は経常損失()	584,328,259
中間純利益又は中間純損失()	584,328,259
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()	85,127,901
期首剰余金又は期首欠損金()	328,493,306
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,756,030
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,853,213
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,902,817
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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()	226,463,082

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2020年 4月28日から2020年10月27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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	8,258,422,263口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0274円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,274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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、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）

第6期中間計算期間（2020年10月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,453,055,296	-	1,435,977,620	17,077,676
	米ドル	1,453,055,296	-	1,435,977,620	17,077,676
	合計	1,453,055,296	-	1,435,977,620	17,077,676

（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) 中間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。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。

・ 中間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) 中間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、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)
期首元本額	9,718,712,784円
期中追加設定元本額	148,411,806円
期中一部解約元本額	1,608,702,327円

【アセットアロケーション・ファンド(成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	4,286,329
コール・ローン	99,614,076
投資証券	982,261,207
親投資信託受益証券	3,478,065,351
派生商品評価勘定	8,540,084
未収入金	34,500,000
流動資産合計	4,607,267,047
資産合計	
	4,607,267,047
負債の部	
流動負債	
未払解約金	31,622,694
未払受託者報酬	884,302
未払委託者報酬	26,529,079
未払利息	219
その他未払費用	177,746
流動負債合計	59,214,040
負債合計	
	59,214,040
純資産の部	
元本等	
元本	4,435,092,884
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	112,960,123
元本等合計	4,548,053,007
純資産合計	
	4,548,053,007
負債純資産合計	
	4,607,267,047

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
営業収益	
受取配当金	19,878,069
有価証券売買等損益	461,836,676
為替差損益	7,911,902
営業収益合計	473,802,843
営業費用	
支払利息	43,118
受託者報酬	884,302
委託者報酬	26,529,079
その他費用	298,551
営業費用合計	27,755,050
営業利益又は営業損失 ()	446,047,793
経常利益又は経常損失 ()	446,047,793
中間純利益又は中間純損失 ()	446,047,793
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 ()	107,437,041
期首剰余金又は期首欠損金 ()	306,503,321
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,852,692
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,570,816
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	281,876
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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 ()	112,960,123

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第6期中間計算期間 自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> <p>(2) 計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2020年 4月28日から2020年10月27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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	4,435,092,884口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0255円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,255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6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、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）

第6期中間計算期間（2020年10月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	726,633,664	-	718,093,580	8,540,084
	米ドル	726,633,664	-	718,093,580	8,540,084
合計		726,633,664	-	718,093,580	8,540,084

（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) 中間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。

中間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。

中間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。

- ・ 中間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。

・中間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)中間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、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第6期中間計算期間 (2020年10月27日現在)
期首元本額	5,918,683,057円
期中追加設定元本額	83,763,931円
期中一部解約元本額	1,567,354,104円

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位:円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	520,313
コール・ローン	1,643,516,714
株式	168,193,849,410
派生商品評価勘定	1,470,200
未収入金	118,990,403
未収配当金	1,482,941,425
前払金	42,025,000
流動資産合計	171,483,313,465
資産合計	
171,483,313,465	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,709,700
未払金	835,000
未払解約金	90,673,961
未払利息	3,628
その他未払費用	13,869
流動負債合計	135,236,158
負債合計	
135,236,158	
純資産の部	
元本等	

(2020年10月27日現在)

元本	64,799,111,589
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	106,548,965,718
元本等合計	171,348,077,307
純資産合計	171,348,077,307
負債純資産合計	171,483,313,465

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年10月27日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,784,400,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	64,799,111,589口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.6443円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 26,443円)</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2020年10月27日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

(2020年10月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,197,339,500	-	3,155,100,000	42,239,500
	東証株価指数先物	3,197,339,500	-	3,155,100,000	42,239,500
合計		3,197,339,500	-	3,155,100,000	42,239,500

（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）

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,420,614,464円
同期中における追加設定元本額	5,277,634,753円
同期中における一部解約元本額	6,899,137,628円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,748,018,374円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	955,457,892円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,551,516,402円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,250,205,814円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	129,567,289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）	5,980,871円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	24,082,321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）	66,794,457円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	128,652,411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）	94,681,909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）	192,651,670円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,499,460,208円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,791,398,856円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	541,659,218円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	571,234,983円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	373,064,036円
イオン・バランス戦略ファンド	98,095,198円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	18,309,477円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	117,721,778円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	92,517,428円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	307,946,108円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	153,501,664円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	169,984,133円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,531,662円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	106,905,628円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	5,700,451円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	30,075,603円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	24,485,610円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,056,977円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,381,246,808円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	20,118,488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＞	172,986,824円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,678,522,249円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,123,943,710円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	7,942,113,123円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	51,276,484円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	202,569,932円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	540,428円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	852,104,059円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	55,253,345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＞	341,176,214円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,003,227,262円

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	797,393,401円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,519,983,011円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	804,861円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	55,089,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,029,821円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	42,618,511円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,322,488円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	161,554,907円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	323,957,046円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	94,007,603円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,654,165円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,439,355円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	60,999,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	809,292,075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)	185,098,010円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	2,304,218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>	523,855,551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>	168,320,287円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,370,714,161円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	97,147,851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>	19,299,496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>	62,862,379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>	85,838,320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>	369,187,777円
合計	64,799,111,589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)

(2020年10月27日現在)

資産の部

流動資産

預金	1,946,556,970
コール・ローン	189,182,000
株式	229,358,608,632
投資証券	5,568,524,380
派生商品評価勘定	45,409,252
未収入金	60,566,289
未収配当金	169,940,659
差入委託証拠金	1,265,610,318
流動資産合計	238,604,398,500

資産合計

238,604,398,500

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	33,590,220
前受金	11,815,522
未払金	50,937,281
未払解約金	64,859,377

(2020年10月27日現在)

未払利息	417
その他未払費用	3,370
流動負債合計	161,206,187
負債合計	161,206,187
純資産の部	
元本等	
元本	60,359,801,487
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	178,083,390,826
元本等合計	238,443,192,313
純資産合計	238,443,192,313
負債純資産合計	238,604,398,500

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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	（2020年10月27日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		60,359,801,487口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.9504円
	(10,000口当たりの純資産額)	39,504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	（2020年10月27日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年10月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,607,713,345	-	3,619,528,867	11,815,522
	SPMINI 2012	2,714,493,580	-	2,756,463,696	41,970,116
	DJ EUR 2012	608,334,752	-	579,414,633	28,920,119
	FTSE 2012	161,790,291	-	157,331,076	4,459,215
	SPI200 2012	123,094,722	-	126,319,462	3,224,740
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	131,919,690	-	131,923,200	3,510

米ドル	88,032,000	-	88,032,000	-
ユーロ	37,165,500	-	37,170,000	4,500
オーストラリアドル	6,722,190	-	6,721,200	990
合計	3,739,633,035	-	3,751,452,067	11,819,032

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,066,751,593円
同期中における追加設定元本額	10,159,479,500円
同期中における一部解約元本額	7,866,429,606円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,234,833,952円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	316,524,059円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,287,684,783円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	853,997,847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)	76,238,871円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,683,758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)	7,226,501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)	21,880,887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)	53,208,556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)	46,342,783円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	95,409,689円
外国株式指数ファンド	566,803,365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	7,558,888,021円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	319,378,197円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	336,876,422円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	219,815,631円
イオン・バランス戦略ファンド	38,995,034円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,077,810円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	86,499,650円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	69,379,004円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	223,396,011円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	108,648,619円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	119,605,514円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,804,102円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	108,501,162円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	1,894,570円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	8,493,227円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	6,504,575円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,843,120円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	998,891円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,014,833,714円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	6,618,123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>	59,688,739円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,178,090,940円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,225,455,397円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,231,882,242円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	16,031,634円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	90,424,216円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	274,725円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	653,937,511円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	55,865,581円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	154,273,858円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	679,107,005円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	525,419,123円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,246,157,297円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	516,296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)	260,225,425円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	108,578,998円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	14,449,068円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,124,088円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	5,922,681円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	34,637,551円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	90,090,104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>	344,659,288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>	110,332,710円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,838,650,287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 >	205,492,491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 >	1,934,655,588円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	12,034,551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 >	38,268,600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 >	52,223,598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 >	348,445,447円
合計	60,359,801,487円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	376,241,400
コール・ローン	2,196,794,361
株式	6,291,590,022
投資信託受益証券	355,854,708
投資証券	502,902,579
派生商品評価勘定	106,647,846
未収配当金	3,105,847
差入委託証拠金	1,023,900,035
流動資産合計	10,857,036,798
資産合計	10,857,036,798
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,101,235
前受金	103,471,576
未払金	6,319,863
未払解約金	32,025,450
未払利息	4,849
その他未払費用	19,336
流動負債合計	166,942,309
負債合計	166,942,309
純資産の部	
元本等	
元本	7,574,727,124
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,115,367,365
元本等合計	10,690,094,489
純資産合計	10,690,094,489
負債純資産合計	10,857,036,798

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
-----	--------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年10月27日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,574,727,124口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4113円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,113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	(2020年10月27日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年10月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,443,298,824	-	3,546,770,400	103,471,576
	MSCIE 2012	3,443,298,824	-	3,546,770,400	103,471,576
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,351,609,183	-	2,328,298,347	23,310,836
	米ドル	2,351,609,183	-	2,328,298,347	23,310,836
	売建	174,009,183	-	172,623,312	1,385,871
	米ドル	174,000,000	-	172,614,129	1,385,871
	ブラジルリアル	9,183	-	9,183	-
合計		5,968,917,190	-	6,047,692,059	81,546,611

(注) 1.時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,713,549,870円
同期中における追加設定元本額	2,484,245,085円
同期中における一部解約元本額	623,067,831円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,322,269,590円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,986,825,614円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	582,328,774円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	620,246,155円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	408,119,266円
イオン・バランス戦略ファンド	43,931,778円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,604,975円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,689,664円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,903,375円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	157,516,604円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	106,574,279円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	175,295,432円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	41,272,496円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,609,064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>	30,540,058円
合計	7,574,727,124円

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	34,578,462
投資証券	6,650,081,850
未収配当金	58,481,227
前払金	1,536,000
差入委託証拠金	10,050,000

(2020年10月27日現在)

流動資産合計	6,754,727,539
資産合計	6,754,727,539
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,542,600
未払金	16,775,453
未払解約金	7,758,445
未払利息	76
その他未払費用	585
流動負債合計	26,077,159
負債合計	26,077,159
純資産の部	
元本等	
元本	3,208,122,883
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,520,527,497
元本等合計	6,728,650,380
純資産合計	6,728,650,380
負債純資産合計	6,754,727,539

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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	（2020年10月27日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		3,208,122,883口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0974円
	(10,000口当たりの純資産額)	20,974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	（2020年10月27日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年10月27日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	51,117,600	-	49,575,000	1,542,600
	東証REIT指数先物	51,117,600	-	49,575,000	1,542,600
合計		51,117,600	-	49,575,000	1,542,600

（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)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,079,734,759円
同期中における追加設定元本額	1,479,131,773円
同期中における一部解約元本額	350,743,649円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	482,680,706円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	508,540,611円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	344,584,419円
イオン・バランス戦略ファンド	61,689,790円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,399,102,436円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,801,392円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	32,439,361円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	21,797,432円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	70,042,133円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	35,494,972円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	27,193,507円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,157,972円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,300,787円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	468,319円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	328,136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>	51,926,820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>	18,060,516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>	54,393,792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>	77,119,782円
合計	3,208,122,883円

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	58,098,286
コール・ローン	19,090,098

(2020年10月27日現在)

投資証券	7,725,039,880
派生商品評価勘定	10,507
未収入金	3,624,653
未収配当金	7,980,126
流動資産合計	7,813,843,550
資産合計	7,813,843,550
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,531,660
未払利息	42
その他未払費用	113
流動負債合計	6,531,815
負債合計	6,531,815
純資産の部	
元本等	
元本	4,292,530,574
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,514,781,161
元本等合計	7,807,311,735
純資産合計	7,807,311,735
負債純資産合計	7,813,843,550

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27日
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年10月27日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		4,292,530,574口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.8188円
	(10,000口当たりの純資産額)	18,188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	(2020年10月27日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年10月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	10,000,000	-	10,010,507	10,507	
	米ドル	10,000,000	-	10,010,507	10,507	
	合計	10,000,000	-	10,010,507	10,507	

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,351,152,062円
同期中における追加設定元本額	1,393,553,041円
同期中における一部解約元本額	452,174,529円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	54,039,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	60,808,013円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,552,987円
イオン・バランス戦略ファンド	27,818,448円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,780,523,935円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	3,396,483円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	37,713,690円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	24,934,485円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,985,804円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	40,573,325円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	31,745,060円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	46,700,785円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	539,804円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	534,217円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	359,935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>	45,797,620円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	15,506,108円
合計	4,292,530,574円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	442,395,677
国債証券	102,665,238,560
地方債証券	8,896,013,040
特殊債券	14,697,370,014
社債券	4,856,493,000
未収入金	204,620,700
未収利息	291,857,110
前払費用	5,638,580
流動資産合計	132,059,626,681
資産合計	132,059,626,681
負債の部	
流動負債	
未払解約金	73,679,094
未払利息	976
その他未払費用	3,556
流動負債合計	73,683,626
負債合計	73,683,626
純資産の部	
元本等	
元本	103,135,532,281
剰余金	
剰余金又は欠損金()	28,850,410,774
元本等合計	131,985,943,055
純資産合計	131,985,943,055
負債純資産合計	132,059,626,681

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27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	（2020年10月27日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		103,135,532,281口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2797円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,797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	（2020年10月27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）

（2020年10月27日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,756,496,620円
同期中における追加設定元本額	7,976,266,062円
同期中における一部解約元本額	10,597,230,401円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	5,461,813,931円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	9,523,028,387円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,051,125,304円

(2020年10月27日現在)	
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)	638,210,701円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	44,825,386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)	183,831,182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)	376,698,418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)	444,544,264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)	180,287,546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)	310,587,170円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	130,365,235円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,304,305,608円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	359,390,382円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	16,075,994円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	21,393,696円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	926,807,654円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	278,793,091円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	407,983,142円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	82,595,147円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,428,353円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	68,922,917円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	32,444,734円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	62,878,980円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	15,195,481円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,598,454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>	5,903,494,951円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	15,033,115,815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>	6,671,933,163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>	16,568,040,090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>	316,664,963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>	562,134,212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>	1,942,066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>	247,763,633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>	116,400,712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>	1,898,215,882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>	2,091,820,730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>	2,497,380,975円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	9,257,374,244円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	1,655,317円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,347,376,271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>	462,970,340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>	611,807,188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>	179,467,790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>	43,699,763円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,645,045,565円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	2,235,716,134円

(2020年10月27日現在)	
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	857,156,886円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	211,492,420円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,262,253円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	299,050,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,607,236,661円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	35,292,927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>	281,734,923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>	923,805,032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>	1,276,510,418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>	2,981,839,770円
合計	103,135,532,281円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年10月27日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	280,398,906
コール・ローン	185,850,791
国債証券	161,978,448,631
未収利息	1,069,081,464
前払費用	28,316,883
流動資産合計	163,542,096,675
資産合計	163,542,096,675
負債の部	
流動負債	
未払解約金	26,291,174
未払利息	410
その他未払費用	1,784
流動負債合計	26,293,368
負債合計	26,293,368
純資産の部	
元本等	
元本	86,219,416,883
剰余金	
剰余金又は欠損金()	77,296,386,424
元本等合計	163,515,803,307
純資産合計	163,515,803,307
負債純資産合計	163,542,096,675

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27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	(2020年10月27日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	86,219,416,883口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8965円
	(10,000口当たりの純資産額 18,965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	(2020年10月27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。

項目	(2020年10月27日現在)
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)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,222,011,513円
同期中における追加設定元本額	6,150,771,509円
同期中における一部解約元本額	4,153,366,139円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	22,822,722,037円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	668,641,305円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,820,087,033円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	911,256,189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)	136,082,096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)	7,332,179円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	29,616,147円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	90,819,167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)	150,028,845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)	89,322,300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)	173,305,471円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,430,953円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,781,471円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	166,515,461円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	110,227,379円
イオン・バランス戦略ファンド	168,534,312円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	8,609,765円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	54,316,399円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,408,566円

(2020年10月27日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	77,548,377円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	23,732,024円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,199,507円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,569,339円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	66,288,911円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	3,984,438円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	12,040,861円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	6,838,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,437,654円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,015,536,434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>	57,240,371円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,829,334,853円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,855,578,685円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	11,097,003,273円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	34,927,566円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	92,654,350円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	364,139円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	681,183,193円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,038,834円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,124,758,075円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,406,378,119円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,677,971,883円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,327,265,153円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,096,475円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,868,987,729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)	369,158,976円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	154,186,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	94,448,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,742,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,403,524円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	113,100,839円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	454,669,380円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	131,335,823円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,665,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,430,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,133,541,676円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	2,406,342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>	1,181,708,925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>	1,161,981,223円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,988,172,499円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	512,837,829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>	129,884,781円

(2020年10月27日現在)	
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 >	53,989,150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 >	164,904,647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 >	226,803,676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 >	1,183,048,932円
合計	86,219,416,883円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年10月27日現在)

資産の部

流動資産

預金	62,210,268
コール・ローン	277,702,080
国債証券	22,562,251,598
派生商品評価勘定	77,571,028
未収利息	156,921,350
前払費用	8,112,929
流動資産合計	23,144,769,253

資産合計

23,144,769,253

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	11,014,131
未払解約金	23,570,000
未払利息	613
その他未払費用	2,765
流動負債合計	34,587,509

負債合計

34,587,509

純資産の部

元本等

元本	14,982,181,274
剰余金	
剰余金又は欠損金()	8,128,000,470
元本等合計	23,110,181,744

純資産合計

23,110,181,744

負債純資産合計

23,144,769,253

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月28日 至 2020年10月27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	(2020年10月27日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		14,982,181,274口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.5425円
	(10,000口当たりの純資産額)	15,425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	(2020年10月27日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(2020年10月27日現在)
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)

(2020年10月27日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,838,740,097	-	22,772,183,200	66,556,897
	米ドル	10,101,852,544	-	10,035,738,300	66,114,244
	カナダドル	429,322,380	-	429,499,900	177,520
	メキシコペソ	170,107,611	-	178,043,200	7,935,589
	ユーロ	9,359,220,586	-	9,360,645,000	1,424,414
	英ポンド	1,482,144,066	-	1,481,412,600	731,466
	スウェーデンクローナ	71,208,873	-	72,299,700	1,090,827
	ノルウェークローネ	47,938,505	-	47,968,200	29,695
	デンマーククローネ	125,786,455	-	125,874,000	87,545
	ポーランドズロチ	148,604,217	-	146,718,600	1,885,617
	オーストラリアドル	594,306,755	-	586,238,000	8,068,755
	シンガポールドル	218,911,254	-	218,164,700	746,554
	イスラエルシェケル	89,336,851	-	89,581,000	244,149
	合計	22,838,740,097	-	22,772,183,200	66,556,897

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2020年10月27日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,571,381,562円
同期中における追加設定元本額	2,645,525,090円
同期中における一部解約元本額	5,234,725,378円
2020年10月27日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,160,618,757円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	596,034,827円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,695,902円
イオン・バランス戦略ファンド	490,659,677円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	835,273,192円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	280,706,033円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	458,518,895円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	97,350,302円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,661,459円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	18,386,865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>	5,033,719,490円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	1,370,846円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,062,694,232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>	106,403,632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>	339,084,327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>	469,002,838円
合計	14,982,181,274円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2020年11月30日現在

資産総額	11,660,853,375円
負債総額	32,839,912円
純資産総額（ - ）	11,628,013,463円
発行済口数	11,210,286,927口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0373円
（1万口当たり純資産額）	（10,373円）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2020年11月30日現在

資産総額	8,452,898,829円
負債総額	38,940,923円
純資産総額（ - ）	8,413,957,906円
発行済口数	7,942,031,990口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0594円
（1万口当たり純資産額）	（10,594円）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2020年11月30日現在

資産総額	4,522,792,064円
負債総額	29,947,035円
純資産総額（ - ）	4,492,845,029円
発行済口数	4,219,171,680口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0649円
（1万口当たり純資産額）	（10,649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します。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2020年11月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

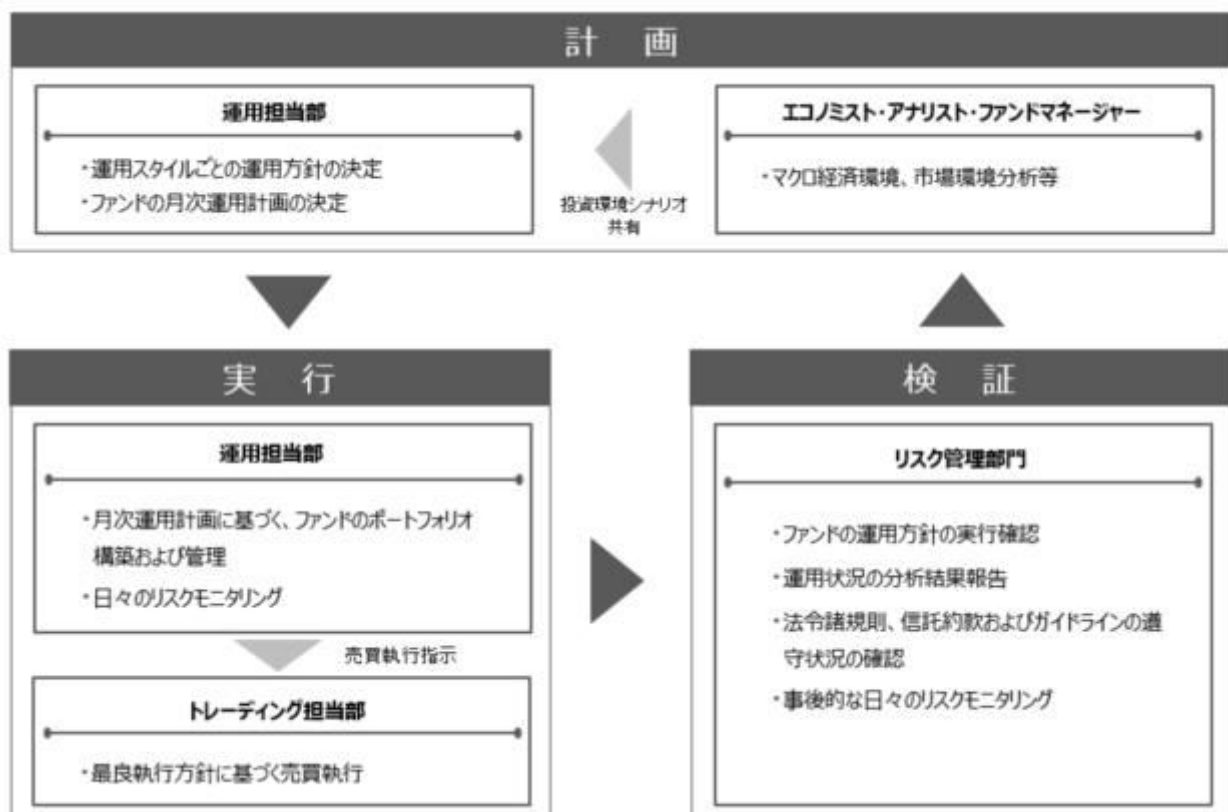
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年11月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	755	8,126,541
単位型株式投資信託	119	568,200
追加型公社債投資信託	1	29,069
単位型公社債投資信託	185	476,425
合計	1,060	9,200,237

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第35期（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第36期中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785

未収投資助言報酬		285,668	299,826
未収収益		44,150	37,702
その他の流動資産		31,771	40,119
流動資産合計		22,771,504	45,664,712
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		173,517	101,609
器具備品		751,471	783,224
土地		-	710
リース資産		-	968
建設仮勘定		-	66,498
有形固定資産合計		924,988	953,010
無形固定資産			
ソフトウェア		479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定		183,528	508,733
のれん		-	34,397,824
顧客関連資産		-	17,785,166
電話加入権		44	12,739
商標権		60	54
無形固定資産合計		663,501	53,613,651
投資その他の資産			
投資有価証券		10,829,628	19,436,480
関係会社株式		10,252,067	11,246,398
長期差入保証金		2,004,451	2,523,637
長期前払費用		97,107	113,852
会員権		7,819	90,479
繰延税金資産		1,426,381	-
貸倒引当金		-	20,750
投資その他の資産合計		24,617,457	33,390,098
固定資産合計		26,205,946	87,956,760
資産合計		48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

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

その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	39,156,499		54,615,133	
運用受託報酬	6,277,217		9,389,058	
投資助言報酬	1,332,888		1,303,595	
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料	182,502		181,061	
その他	49,507		32,421	
営業収益計	46,998,614		65,521,269	
営業費用				
支払手数料	18,499,433		24,888,040	
広告宣伝費	361,696		447,024	
公告費	125		-	
調査費				
調査費	1,752,905		3,214,679	
委託調査費	6,050,441		7,702,309	
営業雑経費				
通信費	46,551		70,007	
印刷費	338,465		612,249	
協会費	24,700		45,117	
諸会費	23,756		32,199	
情報機器関連費	2,872,416		4,349,174	
販売促進費	49,118		68,688	
その他	148,307		154,201	
営業費用合計	30,167,918		41,583,691	

一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022
事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

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

法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

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

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権につい

ては個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

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

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

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

3 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	当事業年度 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)

建物	- 千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	- 千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	102,695千円

2 合併関連費用

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

当事業年度の合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

3 本社移転費用

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

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

当社は2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019年 3月22日

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

2019年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
2020年6月29日開催の第35回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

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

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369

子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

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

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、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（2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

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

当事業年度（2020年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839

(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842
確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.000%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

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

	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
--	-------------------------	-------------------------

法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1
その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計

外部顧客への 営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269
----------------	------------	-----------	-----------	---------	------------

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09円

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

2. 当社は、2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2)企業結合を行った主な理由

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

(3)企業結合日

2019年4月1日

(4)企業結合の法的形式

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

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 2019年1月16日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 2019年1月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

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

4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1) 合併比率

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

(2) 合併比率の算定方法

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

(3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1) 発生したのれん

37,043,811千円

(2) 発生原因

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

(3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	30,600,006
顧客分別金信託	300,033
前払費用	491,960
未収委託者報酬	8,462,795
未収運用受託報酬	2,637,333
未収投資助言報酬	403,508
未収収益	39,908
その他	127,104
流動資産合計	43,062,650
固定資産	
有形固定資産	2,622,154

無形固定資産		
のれん		33,074,831
顧客関連資産		16,728,528
その他		1,741,538
無形固定資産合計		51,544,898
投資その他の資産		
投資有価証券		21,128,629
関係会社株式		11,246,398
その他		2,228,340
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		34,582,618
固定資産合計		88,749,672
資産合計		131,812,323
負債の部		
流動負債		
リース債務		266
顧客からの預り金		2,366
その他の預り金		118,688
未払金		3,919,626
未払費用		4,532,572
未払法人税等		330,248
前受収益		28,358
賞与引当金		1,343,147
その他	2	25,119
流動負債合計		10,300,393
固定負債		
繰延税金負債		3,126,317
退職給付引当金		5,442,936
賞与引当金		7,383
その他		150,104
固定負債合計		8,726,742
負債合計		19,027,135
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		90,555,984
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		17,495,141
利益剰余金合計		19,316,346
株主資本合計		111,872,330
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		912,856
評価・換算差額等合計		912,856
純資産合計		112,785,187
負債純資産合計		131,812,323

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			23,512,538
運用受託報酬			4,131,413
投資助言報酬			637,750
その他の営業収益			115,543
営業収益計			28,397,245
営業費用			18,361,605
一般管理費	1		11,009,285
営業損失()			973,645
営業外収益	2		130,819
営業外費用	3		22,619
経常損失()			865,445
特別損失	4		179,016
税引前中間純損失()			1,044,462
法人税、住民税及び事業税			223,963
法人税等調整額			110,573
法人税等合計			113,390
中間純損失()			1,157,852

(3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当中間期変動額								
剰余金の配当								711,271
中間純損失()								1,157,852
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	-	-	-	-	-	-	-	1,869,124
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	17,495,141

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

当中間期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
中間純損失（ ）	1,157,852	1,157,852			1,157,852
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			535,001	535,001	535,001
当中間期変動額合計	1,869,124	1,869,124	535,001	535,001	1,334,122
当中間期末残高	19,316,346	111,872,330	912,856	912,856	112,785,187

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

其他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 2～50年

器具備品 3～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当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。

(追加情報)

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

(中間貸借対照表関係)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	991,194千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額109,041千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	288,293千円
無形固定資産	1,209,507千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	4,544千円
受取配当金	5,845千円
投資有価証券償還益	9,936千円
投資有価証券売却益	59,364千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	1千円
投資有価証券売却損	21,377千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	51,972千円
本社移転費用	127,044千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	33,870,060株	-	-	33,870,060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

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

(リース取引関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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	1,192,635千円
1年超	4,091,860千円
合 計	5,284,495千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第36期中間会計期間(2020年9月30日)

2020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、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	30,600,006	30,600,006	-
(2)顧客分別金信託	300,033	300,033	-
(3)未収委託者報酬	8,462,795	8,462,795	-
(4)未収運用受託報酬	2,637,333	2,637,333	-
(5)未収投資助言報酬	403,508	403,508	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	21,083,260	21,083,260	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,006,627	2,006,627	-
資産計	65,493,564	65,493,564	-
(1)顧客からの預り金	2,366	2,366	-
(2)未払金			
未払手数料	3,761,585	3,761,585	-
負債計	3,763,951	3,763,951	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

 その他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

 長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

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

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

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

(有価証券関係)

第36期中間会計期間（2020年9月30日）

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの 投資信託等	16,043,944	14,414,570	1,629,373
小計	16,043,944	14,414,570	1,629,373
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	5,039,315	5,294,354	255,038
小計	5,039,315	5,294,354	255,038
合計	21,083,260	19,708,925	1,374,335

(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	23,512,538	4,131,413	637,750	115,543	28,397,245

(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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,329円93銭
1株当たり中間純損失()	34円18銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純損失については、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。

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

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

	第46期 （平成30年3月31日）	第47期 （平成31年3月31日）
資産の部		

流動資産			
現金・預金		21,360,895	20,475,527
前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

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

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

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

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		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主な原因別の内訳

(単位：千円)

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：千円)

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に 係る事務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	3,987,525	未払 手数料 料	573,578
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に 係る事務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 1	1,969,101	未払 手数料 料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

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

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円(2020年9月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2020年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
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社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	
フィデリティ証券株式会社	10,007百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	

資本金の額は、2020年9月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)
該当ありません。

第3【その他】

- 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
 - (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
 - (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
 - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。
 - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
 - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
 - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
 - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべき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

2020年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2020年6月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 菅野 雅子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の2019年4月27日から2020年4月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の2020年4月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2020年6月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 菅野 雅子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2019年4月27日から2020年4月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2020年4月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2020年6月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 菅野 雅子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド(成長型)の2019年4月27日から2020年4月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド(成長型)の2020年4月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月20日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020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（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示

は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月8日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の2020年4月28日から2020年10月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の2020年10月27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（2020年4月28日から2020年10月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2020年12月8日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2020年4月28日から2020年10月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2020年10月27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（2020年4月28日から2020年10月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月8日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の2020年4月28日から2020年10月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の2020年10月27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（2020年4月28日から2020年10月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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