

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和1年6月13日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）
【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】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

以下、上記ファンドを総称して、「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。また、各ファンドをそれぞれ「１安定重視型」、「２やや安定型」、「３バランス型」、「４やや成長型」、「５成長重視型」と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1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

無手数料です。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2019年6月14日から2019年12月12日まで

継続申込期間は、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

(12) 【その他】

- イ 申込証拠金
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ 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、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、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、各ファンドにつき、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。
商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していま

す。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年9月14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、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

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

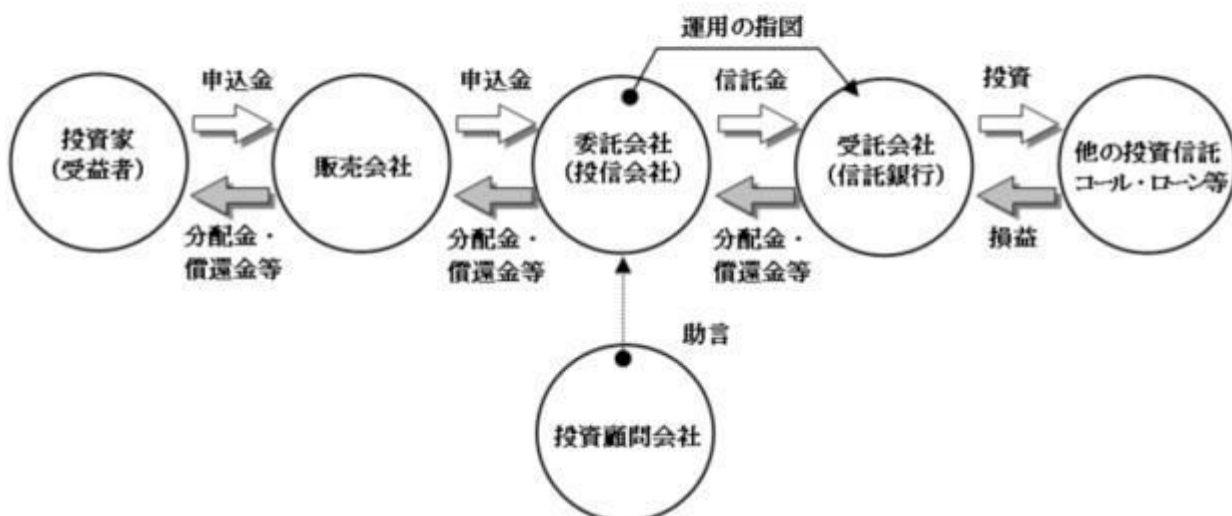
[参考情報：投資顧問会社]

以下の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。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2019年4月1日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

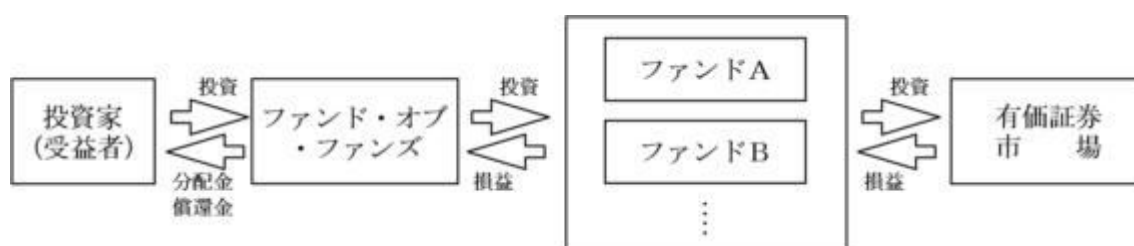
(2019年4月1日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、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、信託財産の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)等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

(1安定重視型)安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

(2やや安定型)安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

(3バランス型)信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

(4やや成長型)信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

(5成長重視型)信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

()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)イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

()基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク(標準偏差)および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

(ハ)実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ニ)投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

■投資対象とする投資信託の投資方針等

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶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)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。 ●わが国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10.03%

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。 ●保有する外貨建て資産については、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10.1%

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。 ● 保有する外貨建て資産については、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^{※1}

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(米ドルベース)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 ^{※2}	年0.39%
一般投資者の日本での購入の可否 ^{※3}	日本において一般投資者の購入が可能です。

※1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

※2 管理報酬等とはETFの運用管理費用およびその他費用をETFの平均純資産総額で除いたもので、本書の数値はETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

※3 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、円貨を外貨に交換する際に、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%

▶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	国内籍新投資信託
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。 ● わが国の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)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	国内籍新投資信託
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(REIT)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。

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) ■ 先進国債券(除く日本)(為替ヘッジあり) ■ 新興国債券

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

2 イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

3 目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。



目標リスク水準とは

目標リスク水準は各ファンドのリスク(標準偏差)の目安を表示したものです。

一般にリスクの数値が大きいほどリターン(収益)の振れ幅が大きくなる傾向があります。

1安定重視型 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

2やや安定型 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

3バランス型 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

4やや成長型 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

5成長重視型 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。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。

4

実質組入外貨建資産については、投資信託証券内で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

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

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

- 投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

[5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ]



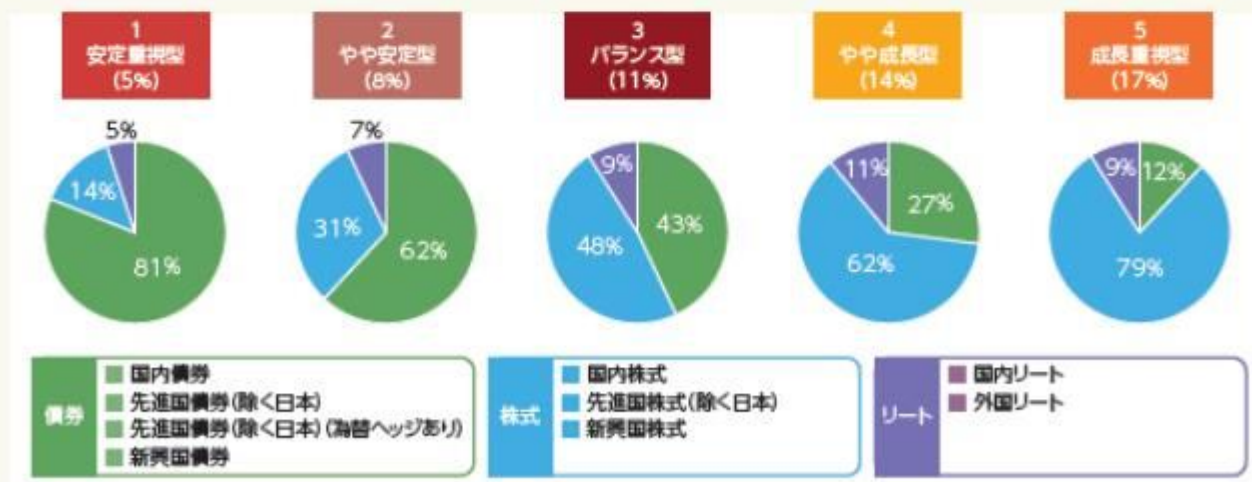
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※目標リスク水準は2019年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

ポートフォリオの基本資産配分イメージ

- 目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。



※()内の数値は目標リスク水準です。

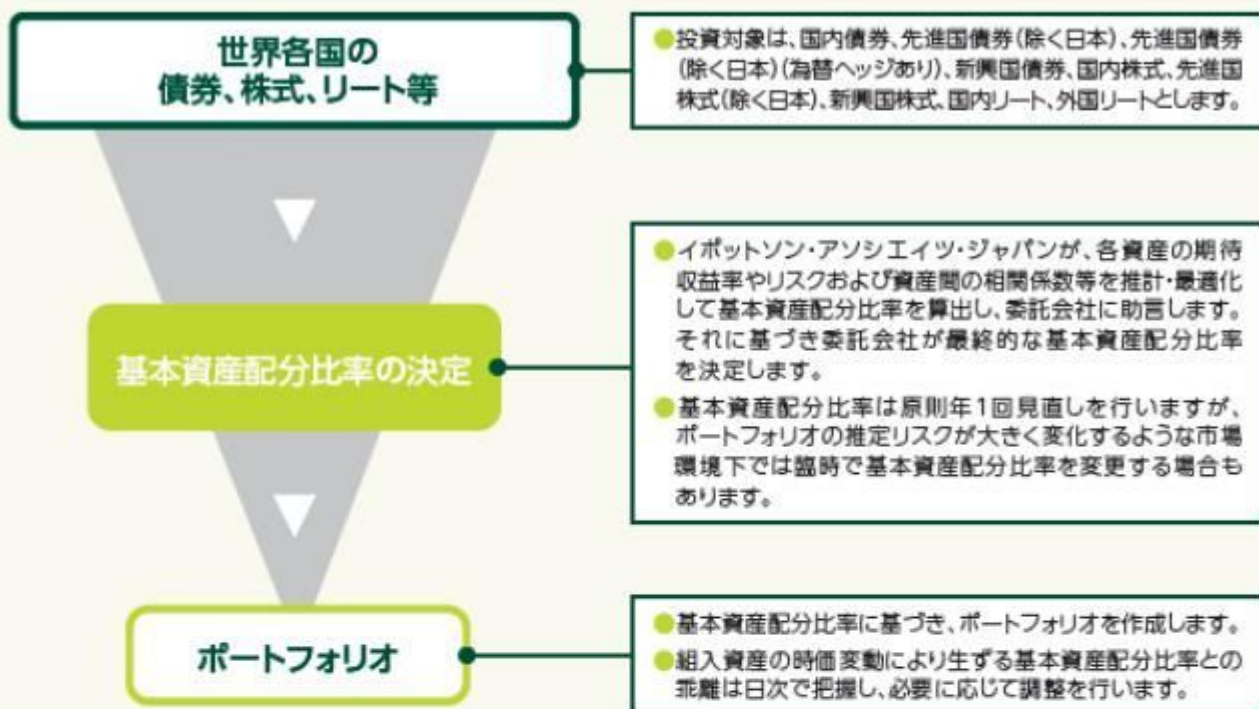
※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。

(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンのデータを基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2019年3月末現在のものであり、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とし、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの助言に基づき基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2019年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について

ibbotson.

a Morningstar company

- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。
- 1977年にロジャー・G・イボットソン(イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国 Ibbotson Associates, Inc.(現Morningstar Investment Management LLC)を設立しました。
- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、資本市場の長期的なリターンとリスクの調査研究に基づいて、中立的な立場から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

(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

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

□ 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。)

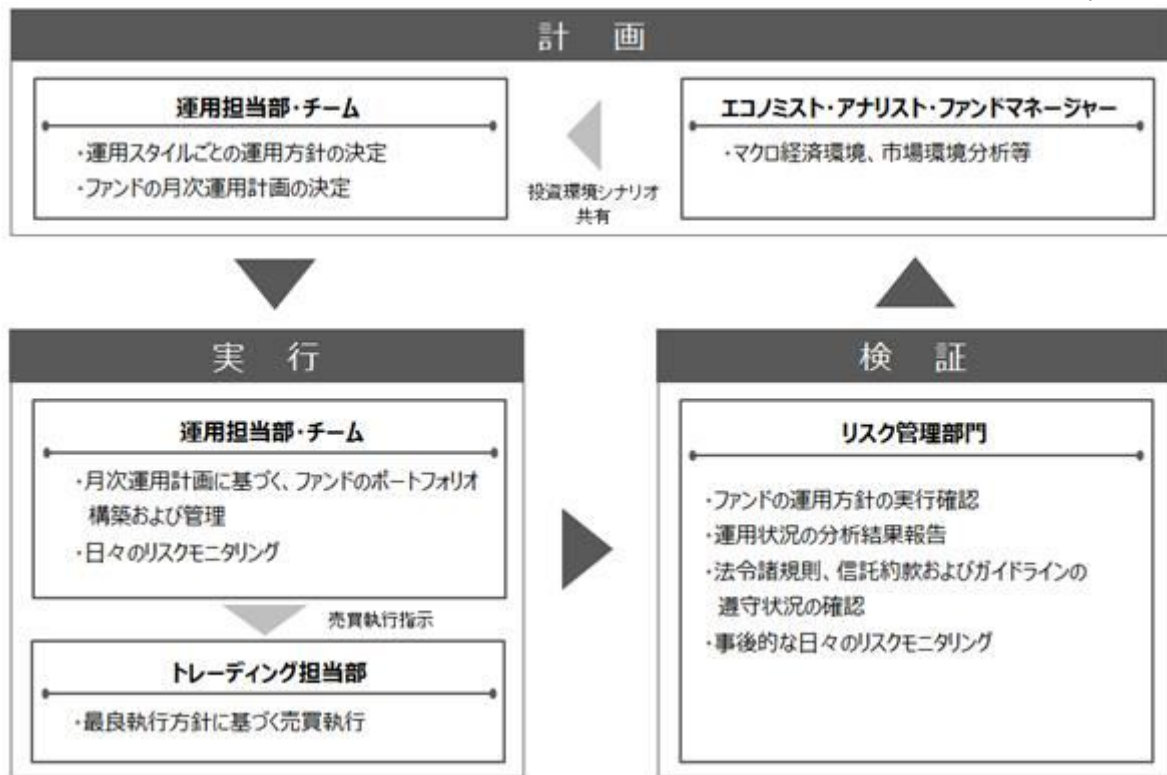
3. コール・ローン

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。

上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【配分方針】

年1回（原則として毎年9月15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 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象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 公社債の借入れの指図
 - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
 - (ロ) 公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
 - (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。
- ト 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- チ 外国為替予約取引の指図
委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の対円での為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- リ 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、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 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%以内
 - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

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、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式、債券および不動産投資信託(リート)を投資対象としており、その価格は、保有する株式、債券および不動産投資信託(リート)の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

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

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 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ら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。

（二）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。

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）は、実質外貨建資産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。

（ヘ）カントリーリスク

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

（ト）市場流動性リスク

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

（チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

（リ）換金制限等に関する留意点

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。

■1安定重視型



「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。



■2やや安定型



※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。

■3バランス型



「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。



■4やや成長型



※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。

■5成長重視型



※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) 野村証券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的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】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年0.9504% [*] （税抜き0.88%）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。 *消費税率が10%となった場合は年0.968%となります。 信託報酬の実質的配分は以下の通りです。 <信託報酬の配分（税抜き）>		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.39%	ファンド運用の指図等の対価
	販売会社	年0.46%	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
上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。 委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。			
投資対象とする投資信託	年0.39%程度（最大） 管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.9894% [*] （最大）（税抜き0.919%）程度 *消費税率が10%となった場合は年1.007%となります。 実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。 ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。		

(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0.00648%^{*}（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。
*消費税率が10%となった場合は年0.0066%となります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、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、外国における資産の保管等に要する費用、およびマザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

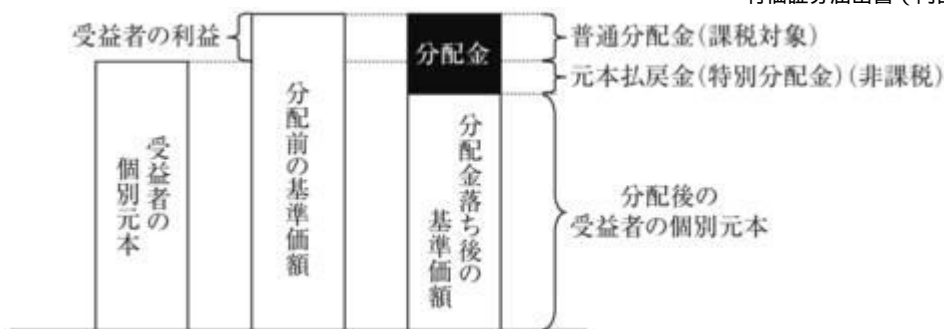
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

当ファンドは、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2019年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	8,030,534	0.99
親投資信託受益証券	日本	792,270,297	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,020,124	1.00
合計(純資産総額)		808,320,955	100.00

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

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	7,725,423	2.00
親投資信託受益証券	日本	374,449,383	97.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,814,726	0.99
合計(純資産総額)		385,989,532	100.00

三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	27,264,764	3.01
親投資信託受益証券	日本	869,700,418	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,273,043	1.02
合計(純資産総額)		906,238,225	100.00

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	17,537,809	4.03
親投資信託受益証券	日本	413,247,012	94.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,411,978	1.01
合計(純資産総額)		435,196,799	100.00

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	31,426,485	4.97
親投資信託受益証券	日本	594,178,362	94.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,370,491	1.01
合計(純資産総額)		631,975,338	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)

イ 主要投資銘柄

2019年 3月29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	361,759,204	1.3758	497,724,888	1.4141	511,563,690	63.29
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	49,744,546	1.7389	86,504,931	1.7722	88,157,284	10.91
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)	19,344,390	2.5442	49,216,508	2.5084	48,523,467	6.00
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	13,657,686	3.4486	47,099,918	3.5307	48,221,191	5.97
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	30,834,797	1.2643	38,985,040	1.2865	39,668,966	4.91
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	11,011,961	2.0484	22,557,515	2.1924	24,142,623	2.99

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	12,028,211	1.2941	15,566,573	1.3358	16,067,284	1.99
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	7,031,876	2.1034	14,791,379	2.2648	15,925,792	1.97
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	658	11,815.62	7,774,681	12,204.45	8,030,534	0.99

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.99
親投資信託受益証券	98.01
合計	99.01

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)

イ 主要投資銘柄

2019年 3月29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	108,335,193	1.3757	149,038,628	1.4141	153,196,796	39.69
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	34,471,152	1.7374	59,892,906	1.7722	61,089,775	15.83
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)	21,382,222	2.5545	54,622,649	2.5084	53,635,165	13.90
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	15,092,816	3.4469	52,024,829	3.5307	53,288,205	13.81
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	7,027,020	2.0411	14,342,948	2.1924	15,406,038	3.99
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	11,847,644	1.2642	14,978,312	1.2865	15,241,994	3.95
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	5,048,015	2.0979	10,590,384	2.2648	11,432,744	2.96

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	8,353,546	1.2923	10,796,016	1.3358	11,158,666	2.89
アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ J . P . モルガン ・ ミドル建てエマージング ・ マーケット債券 E T F	633	11,810.93	7,476,321	12,204.45	7,725,423	2.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	2.00
親投資信託受益証券	97.01
合計	99.01

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

イ 主要投資銘柄

2019年 3月29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バッシブ・マザーファンド	159,233,417	1.3757	219,061,115	1.4141	225,171,974	24.85
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）	75,035,845	2.5606	192,136,785	2.5084	188,219,913	20.77
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	53,253,083	3.4582	184,164,359	3.5307	188,020,660	20.75
日本	親投資信託受益証券	外国債券バッシブ・マザーファンド	70,938,280	1.7386	123,340,197	1.7722	125,716,819	13.87
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	39,459,214	1.2935	51,040,778	1.3358	52,709,618	5.82
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	20,607,311	2.0474	42,192,922	2.1924	45,179,468	4.99
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	15,771,655	2.0917	32,990,206	2.2648	35,719,644	3.94
アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ J . P . モルガン ・ ミドル建てエマージング ・ マーケット債券 E T F	2,234	11,806.00	26,374,609	12,204.46	27,264,764	3.01

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	6,966,438	1.2640	8,805,752	1.2865	8,962,322	0.99
----	-----------	------------------	-----------	--------	-----------	--------	-----------	------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	3.01
親投資信託受益証券	95.97
合計	98.98

三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)

イ 主要投資銘柄

2019年 3月29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)	44,719,105	2.5980	116,181,944	2.5084	112,173,402	25.78
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	31,528,958	3.4959	110,222,386	3.5307	111,319,292	25.58
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	33,800,621	1.3730	46,411,209	1.4141	47,797,458	10.98
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	26,886,576	1.7394	46,767,370	1.7722	47,648,389	10.95
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	31,734,449	1.2957	41,119,511	1.3358	42,390,876	9.74
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	11,928,121	2.0519	24,476,398	2.1924	26,151,212	6.01
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	9,508,887	2.0802	19,781,262	2.2648	21,535,727	4.95
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	1,437	11,799.88	16,956,431	12,204.45	17,537,809	4.03
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	3,288,501	1.2617	4,149,390	1.2865	4,230,656	0.97

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.03
親投資信託受益証券	94.96
合計	98.99

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

イ 主要投資銘柄

2019年 3月29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）	77,570,985	2.6401	204,800,385	2.5084	194,579,058	30.79
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	54,716,615	3.5466	194,061,379	3.5307	193,187,952	30.57
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	78,746,084	1.2988	102,279,566	1.3358	105,189,019	16.64
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	14,629,627	2.0730	30,328,649	2.1924	32,073,994	5.08
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	2,575	11,810.44	30,411,898	12,204.46	31,426,485	4.97
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	11,218,141	2.0646	23,160,974	2.2648	25,406,845	4.02
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	14,102,664	1.7401	24,541,137	1.7722	24,992,741	3.95
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	9,008,626	1.3730	12,369,382	1.4141	12,739,098	2.02
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	4,671,322	1.2591	5,881,662	1.2865	6,009,655	0.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	4.97
親投資信託受益証券	94.02
合計	98.99

【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

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 (2018年 9月18日)	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
2018年 3月末日	13,784,282		9,903	
4月末日	14,094,518		9,909	
5月末日	18,846,495		9,863	
6月末日	22,841,895		9,896	
7月末日	54,998,081		9,906	
8月末日	118,245,223		9,909	
9月末日	204,974,471		9,931	
10月末日	300,165,045		9,744	
11月末日	410,378,642		9,813	
12月末日	492,014,992		9,721	
2019年 1月末日	566,369,848		9,849	
2月末日	717,193,645		9,920	
3月末日	808,320,955		10,062	

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

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 (2018年 9月18日)	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
2018年 3月末日	31,137,457		9,876	
4月末日	31,565,978		9,970	
5月末日	29,816,180		9,901	
6月末日	36,439,670		9,933	
7月末日	47,371,515		10,015	

8月末日	75,216,609		10,021	
9月末日	113,903,469		10,140	
10月末日	158,242,667		9,783	
11月末日	202,886,725		9,891	
12月末日	226,989,173		9,581	
2019年 1月末日	293,931,266		9,802	
2月末日	354,605,392		9,955	
3月末日	385,989,532		10,074	

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

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 (2018年 9月18日)	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
2018年 3月末日	128,456,369		9,981	
4月末日	137,030,962		10,155	
5月末日	143,206,884		10,085	
6月末日	148,366,954		10,106	
7月末日	167,835,873		10,252	
8月末日	242,144,889		10,256	
9月末日	339,166,890		10,455	
10月末日	397,930,323		9,924	
11月末日	489,679,059		10,077	
12月末日	551,145,065		9,565	
2019年 1月末日	689,434,968		9,893	
2月末日	811,118,690		10,119	
3月末日	906,238,225		10,219	

三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)

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 (2018年 9月18日)	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
2018年 3月末日	118,096,101		10,007	
4月末日	124,937,509		10,237	
5月末日	129,285,201		10,158	
6月末日	136,831,464		10,158	
7月末日	145,298,327		10,359	
8月末日	171,934,646		10,357	

9月末日	219,009,049		10,619
10月末日	245,355,306		9,943
11月末日	284,415,672		10,138
12月末日	310,914,486		9,468
2019年 1月末日	369,383,050		9,886
2月末日	408,934,484		10,169
3月末日	435,196,799		10,247

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

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 (2018年 9月18日)	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
2018年 3月末日	437,933,688		10,081	
4月末日	407,939,839		10,359	
5月末日	406,338,150		10,260	
6月末日	417,528,022		10,210	
7月末日	443,530,762		10,474	
8月末日	464,739,986		10,449	
9月末日	478,889,985		10,771	
10月末日	480,421,833		9,927	
11月末日	536,666,979		10,168	
12月末日	508,143,386		9,350	
2019年 1月末日	567,128,984		9,854	
2月末日	625,687,089		10,192	
3月末日	631,975,338		10,235	

【分配の推移】

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0

【収益率の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	収益率（％）
第1期	1.1
第2期（中間期）	1.1

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

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	収益率（％）
第1期	0.2
第2期（中間期）	0.2

（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。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	収益率（％）
第1期	2.7
第2期（中間期）	0.4

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

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	収益率(%)
第1期	3.7
第2期(中間期)	0.9

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

三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

	収益率(%)
第1期	4.5
第2期(中間期)	1.4

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	197,260,985	6,814,601
第2期(中間期)	633,469,955	50,971,957

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	235,257,377	140,052,522
第2期(中間期)	282,765,982	8,087,432

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	426,008,460	139,473,752
第2期(中間期)	609,842,356	32,842,362

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	411,158,724	219,693,175
第2期（中間期）	258,852,229	34,612,699

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	762,271,388	307,261,790
第2期（中間期）	249,786,125	89,650,101

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2019年 3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （%）
株式	日本	169,309,166,050	97.09
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,073,148,778	2.91
合計（純資産総額）		174,382,314,828	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
株価指数先物取引	買建	日本	4,855,600,000	2.78
合計	買建	-	4,855,600,000	2.78

外国株式インデックス・マザーファンド

2019年 3月29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	111,976,848,433	61.55
	イギリス	11,005,222,988	6.05
	カナダ	6,748,874,497	3.71
	フランス	6,647,689,300	3.65
	スイス	6,387,973,901	3.51
	ドイツ	5,589,312,437	3.07
	オーストラリア	3,980,709,506	2.19
	オランダ	3,186,119,774	1.75
	アイルランド	3,060,869,093	1.68
	スペイン	1,968,515,053	1.08
	香港	1,813,308,875	1.00
	スウェーデン	1,611,592,396	0.89
	イタリア	1,290,344,229	0.71
	デンマーク	1,176,210,268	0.65
	シンガポール	808,721,401	0.44
	フィンランド	801,276,279	0.44
	バミューダ	732,270,772	0.40
	ベルギー	663,791,018	0.36
	ジャージー	592,190,298	0.33
	ケイマン諸島	490,258,921	0.27
	ノルウェー	480,154,993	0.26
	イスラエル	359,706,535	0.20
	キュラソー	291,688,533	0.16
	ルクセンブルグ	200,694,609	0.11
	ニュージーランド	161,349,300	0.09
	オーストリア	156,884,285	0.09
	ポルトガル	106,050,855	0.06
	リベリア	96,938,572	0.05
	パプアニューギニア	37,862,477	0.02
	英ヴァージン諸島	32,251,791	0.02
マン島	18,769,409	0.01	
モーリシャス	8,106,775	0.00	

	小計	172,482,557,573	94.81
投資証券	アメリカ	3,294,925,839	1.81
	オーストラリア	542,305,095	0.30
	フランス	211,681,626	0.12
	香港	143,607,678	0.08
	イギリス	137,354,891	0.08
	シンガポール	87,787,232	0.05
	カナダ	34,071,370	0.02
	小計	4,451,733,731	2.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,994,947,064	2.74
合計(純資産総額)		181,929,238,368	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	3,553,716,666	1.95
	買建	ドイツ	855,841,795	0.47
	買建	イギリス	311,525,775	0.17
	買建	オーストラリア	230,399,472	0.12
合計	買建	-	4,951,483,708	2.71

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		307,787,200	0.16

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2019年 3月29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	518,884,078	6.55
	韓国	405,357,397	5.12
	台湾	343,162,317	4.33

	中国	301,632,752	3.81
	インド	284,428,262	3.59
	ブラジル	216,640,941	2.74
	南アフリカ	168,789,952	2.13
	香港	145,930,478	1.84
	メキシコ	79,592,000	1.01
	タイ	72,720,805	0.92
	マレーシア	68,811,435	0.87
	インドネシア	68,158,989	0.86
	ポーランド	35,567,957	0.45
	フィリピン	34,033,602	0.43
	チリ	31,797,832	0.40
	バミューダ	28,534,109	0.36
	トルコ	16,933,943	0.21
	コロンビア	14,220,059	0.18
	アメリカ	11,251,560	0.14
	ハンガリー	9,816,587	0.12
	ギリシャ	6,961,734	0.09
	チェコ	5,200,929	0.07
	エジプト	3,972,391	0.05
	マン島	1,977,303	0.02
	ペルー	1,802,122	0.02
	シンガポール	1,131,412	0.01
	ルクセンブルグ	1,029,101	0.01
	小計	2,878,340,047	36.35
投資信託受益証券	アメリカ	171,737,530	2.17
	香港	25,276,179	0.32
	小計	197,013,709	2.49
投資証券	南アフリカ	7,006,124	0.09
	ブラジル	5,415,686	0.07
	メキシコ	2,859,860	0.04
	小計	15,281,670	0.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,827,520,951	60.97
合計(純資産総額)		7,918,156,377	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	4,824,413,429	60.92
合計	買建	-	4,824,413,429	60.92

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		4,027,526,904	50.86
	売建		22,891,393	0.28

Jリート・インデックス・マザーファンド

2019年 3月29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	12,752,590,260	97.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		289,981,047	2.22
合計(純資産総額)		13,042,571,307	100.00

外国リート・インデックス・マザーファンド

2019年 3月29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	3,934,025,645	71.74
	オーストラリア	373,689,185	6.81
	イギリス	278,867,148	5.09
	フランス	221,540,923	4.04
	シンガポール	203,606,296	3.71
	香港	126,163,725	2.30
	カナダ	102,289,992	1.87
	ベルギー	49,891,199	0.91
	スペイン	33,685,264	0.61
	ニュージーランド	26,944,785	0.49
	ドイツ	17,351,713	0.32
	オランダ	16,255,359	0.30
	アイルランド	11,329,256	0.21

	イスラエル	3,905,731	0.07
	イタリア	2,755,008	0.05
	ガーンジー	1,963,754	0.04
	マン島	1,739,922	0.03
	小計	5,406,004,905	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		77,774,132	1.42
合計(純資産総額)		5,483,779,037	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		20,903,846	0.38

国内債券パッシブ・マザーファンド

2019年 3月29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	132,391,842,170	75.01
地方債証券	日本	13,629,110,780	7.72
特殊債券	日本	21,941,972,810	12.43
社債券	日本	7,303,681,000	4.14
	オーストラリア	200,490,000	0.11
	フランス	199,642,000	0.11
	小計	7,703,813,000	4.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		839,528,552	0.48
合計(純資産総額)		176,506,267,312	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年 3月29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	76,665,986,599	45.99
	フランス	16,637,043,100	9.98
	イタリア	14,469,126,838	8.68
	イギリス	11,382,689,578	6.83
	ドイツ	10,647,163,621	6.39
	スペイン	9,316,105,783	5.59
	ベルギー	4,017,232,515	2.41

オーストラリア	3,479,584,405	2.09
カナダ	3,295,954,341	1.98
オランダ	3,104,904,257	1.86
オーストリア	2,624,714,618	1.57
アイルランド	1,367,057,871	0.82
メキシコ	1,315,785,630	0.79
フィンランド	1,165,107,583	0.70
ポーランド	1,013,528,830	0.61
南アフリカ	904,743,520	0.54
デンマーク	849,732,742	0.51
マレーシア	782,992,825	0.47
シンガポール	672,756,703	0.40
スウェーデン	598,101,142	0.36
ノルウェー	379,249,117	0.23
小計	164,689,561,618	98.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2,000,618,656	1.20
合計(純資産総額)	166,690,180,274	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年 3月29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	13,498,182,375	44.67
	フランス	2,887,338,039	9.56
	イタリア	2,536,502,597	8.39
	イギリス	2,008,148,353	6.65
	ドイツ	1,793,529,275	5.94
	スペイン	1,608,361,195	5.32
	ベルギー	736,972,570	2.44
	オーストラリア	611,230,438	2.02
	カナダ	585,566,537	1.94
	オランダ	564,828,904	1.87
	オーストリア	426,255,781	1.41
	アイルランド	405,608,590	1.34
	シンガポール	255,391,662	0.85
	メキシコ	232,511,940	0.77
	フィンランド	206,886,313	0.68
	ポーランド	179,503,330	0.59
	南アフリカ	159,354,672	0.53
	デンマーク	149,875,170	0.50
スウェーデン	105,090,960	0.35	

	ノルウェー	68,908,382	0.23
	小計	29,020,047,083	96.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,197,877,786	3.96
合計(純資産総額)		30,217,924,869	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		28,686,795,000	94.93

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年 3月29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	827,000	6,793.06	5,617,868,310	6,487.00	5,364,749,000	3.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	304,400	9,484.10	2,886,961,904	10,745.00	3,270,778,000	1.88
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	647,800	4,375.58	2,834,506,664	4,521.00	2,928,703,800	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,039,200	621.54	3,132,081,752	550.00	2,771,560,000	1.59
日本	株式	キーエンス	電気機器	36,400	61,470.28	2,237,518,400	68,970.00	2,510,508,000	1.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	498,300	4,674.36	2,329,234,321	4,703.00	2,343,504,900	1.34
日本	株式	ソニー	電気機器	497,600	5,908.12	2,939,883,882	4,645.00	2,311,352,000	1.33
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	516,100	4,165.83	2,149,987,036	3,876.00	2,000,403,600	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	626,100	3,191.16	1,997,988,786	2,995.00	1,875,169,500	1.08
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	66,400	23,330.78	1,549,164,344	25,710.00	1,707,144,000	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,947,300	187.62	1,866,359,900	171.30	1,703,972,490	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	508,300	3,110.80	1,581,223,832	3,161.00	1,606,736,300	0.92
日本	株式	三菱商事	卸売業	512,600	3,063.22	1,570,207,403	3,074.00	1,575,732,400	0.90
日本	株式	花王	化学	180,100	8,353.92	1,504,541,435	8,718.00	1,570,111,800	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	642,000	2,661.02	1,708,378,902	2,385.00	1,531,170,000	0.88
日本	株式	任天堂	その他製品	45,700	34,404.96	1,572,306,928	31,560.00	1,442,292,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	265,100	5,591.31	1,482,256,525	5,362.00	1,421,466,200	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	131,900	10,308.09	1,359,638,028	10,680.00	1,408,692,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	70,500	19,290.84	1,360,004,838	18,880.00	1,331,040,000	0.76

日本	株式	ダイキン工業	機械	101,300	12,578.07	1,274,159,070	12,970.00	1,313,861,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	233,400	5,745.85	1,341,083,400	5,512.00	1,286,500,800	0.74
日本	株式	キヤノン	電気機器	399,100	3,213.04	1,282,325,489	3,213.00	1,282,308,300	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	306,400	4,933.32	1,511,570,824	4,176.00	1,279,526,400	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	89,300	15,023.20	1,341,571,968	14,025.00	1,252,432,500	0.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	334,200	3,281.62	1,096,719,840	3,585.00	1,198,107,000	0.69
日本	株式	信越化学工業	化学	128,100	10,077.65	1,290,947,776	9,280.00	1,188,768,000	0.68
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	430,100	2,817.45	1,211,787,249	2,745.00	1,180,624,500	0.68
日本	株式	資生堂	化学	147,500	7,217.74	1,064,617,660	7,987.00	1,178,082,500	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	684,400	1,734.39	1,187,018,294	1,658.50	1,135,077,400	0.65
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	460,800	2,621.85	1,208,148,480	2,451.50	1,129,651,200	0.65

□ 種別・業種別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.13
		鉱業	0.28
		建設業	2.91
		食料品	4.24
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.30
		化学	7.17
		医薬品	5.74
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	0.94
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.55
		機械	4.79
		電気機器	12.62
		輸送用機器	7.55
		精密機器	1.99
		その他製品	1.99
		電気・ガス業	1.89
		陸運業	4.80
海運業	0.14		
空運業	0.59		
倉庫・運輸関連業	0.19		
情報・通信業	8.04		
卸売業	4.82		

	小売業	4.62
	銀行業	5.90
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	2.13
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.45
	サービス業	4.86
合計		97.09

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄 (上位30銘柄)

2019年 3月29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	208,293	19,813.93	4,127,103,921	20,946.03	4,362,912,010	2.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	319,738	12,200.02	3,900,810,250	12,978.06	4,149,579,172	2.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,234	185,595.25	3,384,143,938	196,831.88	3,589,032,606	1.97
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	105,460	15,503.08	1,634,955,154	18,374.39	1,937,763,644	1.07
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	117,727	16,090.22	1,894,253,365	15,414.29	1,814,678,260	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,796	120,873.65	1,667,573,007	129,690.70	1,789,212,968	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	13,108	121,562.90	1,593,446,591	130,110.24	1,705,485,122	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	185,027	8,738.24	1,616,810,832	8,961.33	1,658,088,487	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	146,256	12,155.62	1,777,833,061	11,177.80	1,634,820,741	0.90
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	134,947	9,493.02	1,281,055,199	10,615.75	1,432,563,885	0.79
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	77,159	15,447.58	1,191,920,458	17,166.82	1,324,574,919	0.73
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	56,950	24,044.87	1,369,355,551	22,271.25	1,268,347,881	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	109,237	10,316.52	1,126,945,750	11,493.01	1,255,462,425	0.69
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	410,419	3,105.50	1,274,556,286	3,033.35	1,244,947,223	0.68
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	254,555	5,030.06	1,280,428,654	4,693.76	1,194,821,884	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	182,041	6,575.03	1,196,925,531	6,557.28	1,193,695,483	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	200,110	5,300.88	1,060,759,577	5,894.67	1,179,584,195	0.65

アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	197,127	5,239.83	1,032,913,526	5,922.42	1,167,470,149	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	83,657	13,170.07	1,101,768,831	13,653.98	1,142,251,825	0.63
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	42,242	31,167.10	1,316,560,718	26,885.10	1,135,680,719	0.62
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	319,942	3,389.20	1,084,347,454	3,441.79	1,101,176,344	0.61
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	197,032	5,959.05	1,174,124,151	5,448.49	1,073,528,675	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	49,778	19,535.34	972,430,647	21,094.75	1,050,054,933	0.58
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	40,243	21,890.55	880,941,713	26,067.11	1,049,018,764	0.58
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	114,014	8,638.35	984,893,030	9,171.10	1,045,634,217	0.57
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	94,985	10,054.85	955,060,564	10,633.59	1,010,031,888	0.56
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	23,766	38,249.37	909,034,618	41,559.09	987,693,466	0.54
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	78,858	12,697.25	1,001,280,213	12,287.70	968,983,675	0.53
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	30,803	28,412.74	875,197,876	30,258.23	932,044,520	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	176,926	5,430.74	960,839,229	5,169.91	914,692,240	0.50

□ 種類別・業種別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.34
		素材	4.34
		資本財	6.82
		商業・専門サービス	1.14
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	1.14
		耐久消費財・アパレル	1.84
		消費者サービス	1.82
		メディア・娯楽	5.69
		小売	4.66
		食品・生活必需品小売り	1.46
		食品・飲料・タバコ	4.88
		家庭用品・パーソナル用品	2.06
		ヘルスケア機器・サービス	4.55
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.22		

	銀行	7.74
	各種金融	4.06
	保険	3.71
	不動産	0.89
	ソフトウェア・サービス	8.79
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.13
	電気通信サービス	2.37
	公益事業	3.40
	半導体・半導体製造装置	2.88
投資証券		2.45
合計		97.25

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）

2019年 3月29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	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・ 娯楽	30,400	4,518.26	137,355,322	5,005.56	152,169,024	1.92
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR	小売	6,888	18,349.87	126,393,973	19,726.25	135,874,429	1.72
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		30,510	3,772.75	115,106,629	3,864.67	117,911,136	1.49
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半 導体製造装 置	131,000	834.84	109,365,286	868.78	113,810,180	1.44
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	25,399	4,289.13	108,939,694	4,395.30	111,636,225	1.41
南アフリ カ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	2,337	21,481.30	50,201,815	25,110.32	58,682,827	0.74
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	511,000	95.37	48,735,087	96.43	49,278,183	0.62
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	32,500	1,107.30	35,987,497	1,135.44	36,901,865	0.47
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	15,240	1,916.96	29,214,513	2,189.60	33,369,504	0.42
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	27,500	1,100.37	30,260,251	1,212.50	33,343,888	0.42
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		15,000	2,125.91	31,888,681	2,030.00	30,450,106	0.38
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	369,000	80.29	29,628,336	82.01	30,262,428	0.38
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	8,733	3,093.92	27,019,268	3,130.56	27,339,220	0.35
ケイマン 諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	1,470	19,643.99	28,876,676	18,214.56	26,775,416	0.34
香港	投資信託受 益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		40,600	545.41	22,143,777	622.56	25,276,179	0.32
ブラジル	株式	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	銀行	25,800	1,024.43	26,430,378	969.12	25,003,348	0.32
ブラジル	株式	VALE SA	素材	16,900	1,435.98	24,268,112	1,401.10	23,678,691	0.30
アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI UAE ETF		13,671	1,615.14	22,080,616	1,628.22	22,259,441	0.28

インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	18,708	1,102.51	20,625,790	1,187.85	22,222,447	0.28
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	3,095	6,967.70	21,565,049	7,085.40	21,929,313	0.28
中国	株式	BANK OF CHINA LTD	銀行	422,000	49.52	20,900,771	50.76	21,421,817	0.27
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	銀行	17,820	1,145.90	20,420,017	1,199.89	21,382,083	0.27
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	95,000	184.55	17,533,014	202.48	19,236,056	0.24
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	69,800	260.08	18,153,675	257.76	17,991,788	0.23
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	エネルギー	20,800	732.88	15,243,948	797.46	16,587,276	0.21
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	4,415	3,431.46	15,149,940	3,577.00	15,792,455	0.20
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	4,835	3,180.08	15,375,693	3,220.48	15,571,035	0.20
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	電気通信サービス	178,900	79.98	14,309,620	78.61	14,064,331	0.18
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	エネルギー	15,800	810.35	12,803,545	879.88	13,902,154	0.18
インド	株式	AXIS BANK LIMITED	銀行	10,107	1,060.71	10,720,655	1,256.92	12,703,761	0.16

ロ 種類別・業種別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.30
		素材	2.61
		資本財	1.26
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	0.66
		自動車・自動車部品	0.91
		耐久消費財・アパレル	0.48
		消費者サービス	0.51
		メディア・娯楽	3.05
		小売	3.24
		食品・生活必需品小売り	0.59
		食品・飲料・タバコ	1.35
		家庭用品・パーソナル用品	0.46
		ヘルスケア機器・サービス	0.24
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.78
		銀行	6.20
		各種金融	0.94
保険	1.46		
不動産	0.98		

		ソフトウェア・サービス	0.77
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.82
		電気通信サービス	1.63
		公益事業	0.95
		半導体・半導体製造装置	2.09
投資信託受益証券			2.49
投資証券			0.19
合計			39.03

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)

2019年 3月29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	1,307	719,782.52	940,755,757	750,000	980,250,000	7.52
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,350	642,144.91	866,895,629	653,000	881,550,000	6.76
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,201	158,231.98	664,732,575	163,200	685,603,200	5.26
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,551	226,868.26	578,740,947	222,700	568,107,700	4.36
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,978	173,953.64	518,033,956	174,900	520,852,200	3.99
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,689	188,412.08	506,640,092	190,100	511,178,900	3.92
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,812	253,550.26	459,433,078	245,700	445,208,400	3.41
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,811	236,715.51	428,691,805	235,800	427,033,800	3.27
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,316	312,546.34	411,310,994	308,500	405,986,000	3.11
日本	投資証券	GLP投資法人	3,342	119,944.03	400,852,949	118,700	396,695,400	3.04
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	854	438,542.72	374,515,484	456,000	389,424,000	2.99
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,346	86,382.46	375,418,177	89,300	388,097,800	2.98
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	709	464,953.25	329,651,860	460,000	326,140,000	2.50
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	417	746,051.36	311,103,420	769,000	320,673,000	2.46
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	3,482	78,304.79	272,657,312	83,700	291,443,400	2.23
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	4,660	49,650.1	231,369,496	54,200	252,572,000	1.94
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	448	564,327.12	252,818,550	562,000	251,776,000	1.93
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	311	751,214.24	233,627,630	788,000	245,068,000	1.88
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,545	143,028.2	220,978,581	148,800	229,896,000	1.76
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	460	461,142.29	212,125,454	464,500	213,670,000	1.64
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	882	227,962.63	201,063,040	234,900	207,181,800	1.59
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,090	180,460.96	196,702,450	188,800	205,792,000	1.58
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,572	119,405.32	187,705,170	123,700	194,456,400	1.49
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,207	156,695.63	189,131,629	160,900	194,206,300	1.49
日本	投資証券	日本リート投資法人	436	402,714.32	175,583,445	427,000	186,172,000	1.43
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,387	130,109.55	180,461,959	130,600	181,142,200	1.39
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,283	131,422	168,614,426	139,600	179,106,800	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	558	288,674.91	161,080,605	303,500	169,353,000	1.30

日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	963	172,317.2	165,941,469	172,200	165,828,600	1.27
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	904	166,724.15	150,718,637	179,300	162,087,200	1.24

ロ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.78
合計	97.78

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)

2019年 3月29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	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,277	20,307.53	249,315,652	20,351.12	249,850,779	4.56
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	25,047	7,943.76	198,967,460	8,004.59	200,491,186	3.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,915	22,566.50	133,480,878	24,306.80	143,774,781	2.62
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	15,825	8,413.52	133,144,002	8,721.59	138,019,228	2.52
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	15,221	8,245.86	125,510,241	8,394.17	127,767,718	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,504	21,786.57	119,913,303	22,300.11	122,739,810	2.24
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,458	13,144.39	111,175,288	13,278.84	112,312,459	2.05
香港	投資証券	LINK REIT	86,100	1,258.86	108,387,997	1,290.98	111,153,550	2.03
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	14,153	7,131.33	100,929,748	7,242.09	102,497,406	1.87
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	12,401	7,791.08	96,617,293	8,198.83	101,673,707	1.85
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,477	17,862.02	97,830,327	18,168.32	99,507,897	1.81
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	6,319	14,978.80	94,651,092	14,828.26	93,699,800	1.71
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,610	31,335.95	81,786,853	32,205.96	84,057,577	1.53
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,643	15,298.92	71,032,904	15,897.09	73,810,225	1.35
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	219,893	311.07	68,404,082	323.99	71,244,628	1.30
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	66,206	1,018.66	67,441,948	1,058.49	70,078,680	1.28
アメリカ	投資証券	HCP, INC.	19,739	3,473.65	68,566,426	3,517.27	69,427,454	1.27
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,423	2,220.50	65,333,964	2,105.48	61,949,547	1.13
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,364	10,612.49	56,925,401	11,405.33	61,178,203	1.12
アメリカ	投資証券	WIP CAREY INC	6,706	8,364.54	56,092,619	8,692.73	58,293,493	1.06
アメリカ	投資証券	UDR INC	10,951	4,983.11	54,570,057	5,050.04	55,303,043	1.01
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,525	11,637.57	52,660,030	12,166.72	55,054,425	1.00
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	6,656	7,315.34	48,690,909	7,552.86	50,271,899	0.92
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	6,695	7,646.10	51,190,647	7,494.04	50,172,630	0.91
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,173	15,026.99	47,680,659	15,399.86	48,863,764	0.89
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	3,636	12,741.53	46,328,214	13,165.63	47,870,245	0.87
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	13,816	3,339.68	46,141,145	3,421.82	47,275,889	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,079	10,869.03	44,334,802	11,285.46	46,033,404	0.84

アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	11,379	3,943.47	44,872,784	3,954.57	44,999,094	0.82
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,467	12,174.49	42,208,967	12,777.16	44,298,444	0.81

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.58
合計	98.58

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2019年 3月29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	104.60	2,123,380,000	104.27	2,116,823,100	0.800	2023/6/20	1.20
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	100.65	1,912,442,100	102.22	1,942,275,000	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	104.10	1,873,908,000	103.09	1,855,746,000	1.200	2021/6/20	1.05
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	108.30	1,575,808,650	107.14	1,558,916,100	1.700	2022/12/20	0.88
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	102.41	1,536,255,000	101.33	1,519,965,000	1.300	2020/3/19	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,441,000,000	100.95	1,454,689,500	102.31	1,474,344,740	0.100	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,400,000,000	100.71	1,409,940,000	102.29	1,432,186,000	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	1,398,000,000	100.89	1,410,442,200	102.35	1,430,880,960	0.100	2026/12/20	0.81
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,390,000,000	101.09	1,405,257,500	102.38	1,423,179,300	0.100	2027/3/20	0.81
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	103.94	1,418,849,250	103.49	1,412,706,750	0.800	2022/9/20	0.80
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	1,365,000,000	101.29	1,382,652,200	101.91	1,391,112,450	0.100	2028/12/20	0.79
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,350,000,000	101.01	1,363,743,800	102.19	1,379,578,500	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.78	1,346,423,000	104.53	1,343,274,750	0.800	2023/9/20	0.76
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,270,000,000	100.05	1,270,635,000	102.09	1,296,644,600	0.100	2028/6/20	0.73
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,250,000,000	101.30	1,266,327,000	102.27	1,278,400,000	0.100	2026/6/20	0.72
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	105.34	1,279,917,450	104.81	1,273,550,850	1.000	2023/3/20	0.72
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,195,000,000	104.03	1,243,158,500	102.93	1,230,025,450	1.300	2021/3/20	0.70
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	1,200,000,000	100.47	1,205,685,400	102.00	1,224,108,000	0.100	2028/9/20	0.69

日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	1,105,000,000	103.00	1,138,150,000	103.84	1,147,465,150	0.400	2025/6/20	0.65
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	1,107,000,000	102.49	1,134,564,300	103.47	1,145,479,320	0.300	2025/12/20	0.65
日本	国債証券	第69回利付国債（20年）	1,020,000,000	112.72	1,149,815,400	111.51	1,137,412,200	2.100	2024/3/20	0.64
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	1,110,000,000	100.89	1,119,911,500	101.31	1,124,640,900	0.100	2023/6/20	0.64
日本	国債証券	第64回利付国債（20年）	1,025,000,000	110.62	1,133,926,750	109.47	1,122,108,500	1.900	2023/9/20	0.64
日本	国債証券	第65回利付国債（20年）	1,020,000,000	111.09	1,133,189,400	110.00	1,122,071,400	1.900	2023/12/20	0.64
日本	国債証券	第322回利付国債（10年）	1,065,000,000	103.90	1,106,588,250	103.26	1,099,793,550	0.900	2022/3/20	0.62
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	1,055,000,000	104.11	1,098,360,500	104.21	1,099,510,450	0.600	2024/6/20	0.62
日本	国債証券	第129回利付国債（5年）	1,080,000,000	100.76	1,088,208,000	100.72	1,087,776,000	0.100	2021/9/20	0.62
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	1,030,000,000	100.76	1,037,828,000	102.37	1,054,493,400	0.100	2027/6/20	0.60
日本	国債証券	第317回利付国債（10年）	1,005,000,000	104.09	1,046,154,750	103.20	1,037,180,100	1.100	2021/9/20	0.59
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	103.83	1,038,300,000	102.85	1,028,550,000	1.200	2021/6/30	0.58

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	75.01
地方債証券	7.72
特殊債券	12.43
社債券	4.36
合計	99.52

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2019年 3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	7,300,000	11,081.65	808,960,604	11,553.36	843,395,668	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,500,000	10,925.00	819,375,627	11,118.94	833,920,767	2.250	2024/1/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	7,200,000	11,142.35	802,249,594	11,284.56	812,488,421	2.875	2021/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,900,000	10,746.85	741,533,298	11,132.81	768,164,395	2.375	2027/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,102.46	688,353,043	11,360.86	704,373,756	2.750	2023/11/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	10,769.49	678,478,402	11,097.26	699,127,744	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,100,000	11,107.67	677,567,936	11,355.66	692,695,527	2.750	2023/8/31	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	13,857.17	692,858,772	13,791.65	689,582,844	3.000	2022/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	10,554.45	654,376,229	11,002.75	682,170,556	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,000,000	11,104.20	666,252,159	11,336.58	680,195,278	2.750	2023/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,208.25	672,495,347	11,215.19	672,911,559	3.625	2020/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	10,435.66	647,011,006	10,850.13	672,708,659	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,700,000	11,459.72	653,204,571	11,795.28	672,331,464	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,800,000	11,141.21	646,190,543	11,332.25	657,270,643	2.625	2025/12/31	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,100,000	19,909.67	617,199,782	21,125.12	654,878,933	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	10,946.38	623,944,158	11,248.14	641,144,140	2.500	2024/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	10,860.37	608,180,804	11,174.43	625,768,559	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	10,642.03	606,595,905	10,898.69	621,225,774	1.750	2023/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,072.98	609,014,269	11,155.36	613,544,919	2.625	2020/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,600,000	10,594.34	593,283,171	10,937.71	612,512,189	2.000	2025/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,772.09	592,465,490	11,021.82	606,200,503	2.000	2023/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000	13,975.13	600,930,752	14,087.73	605,772,648	2.250	2024/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,100,000	11,083.39	565,252,993	11,787.48	601,161,726	3.125	2044/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,800,000	20,168.75	564,725,145	20,974.65	587,290,435	5.750	2032/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,300,000	10,976.86	581,773,595	11,045.23	585,397,678	2.000	2020/11/30	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	3,800,000	14,855.02	564,490,973	15,308.92	581,739,045	2.750	2027/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,091.19	565,650,998	11,375.60	580,156,004	2.750	2024/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000	15,096.92	573,683,003	15,100.65	573,825,001	4.250	2023/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,613.41	551,897,775	11,033.96	573,766,276	2.250	2027/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,200,000	10,576.13	549,958,921	11,013.15	572,684,123	2.250	2027/8/15	0.34

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.80
合計	98.80

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）

2019年 3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2,100,000	11,064.59	232,356,455	11,115.47	233,424,977	2.375	2020/12/31	0.77
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	1,600,000	13,519.35	216,309,650	13,564.70	217,035,337	1.750	2023/5/25	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,700,000	10,931.40	185,833,886	11,553.36	196,407,210	2.875	2028/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,800,000	10,341.45	186,146,213	10,623.82	191,228,833	1.625	2026/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,700,000	10,886.55	185,071,489	10,987.14	186,781,429	1.500	2020/5/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	1,500,000	11,938.08	179,071,266	12,376.25	185,643,782	3.375	2048/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,600,000	11,111.60	177,785,603	11,549.89	184,798,350	2.875	2028/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,500,000	11,104.20	166,563,039	11,360.86	170,413,005	2.750	2023/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,500,000	10,889.15	163,337,393	10,991.47	164,872,177	1.625	2020/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,500,000	10,824.12	162,361,896	10,948.12	164,221,844	1.375	2020/8/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,400,000	11,099.00	155,386,000	11,141.48	155,980,838	2.625	2020/8/15	0.52
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	700,000	20,359.90	142,519,310	20,974.65	146,822,609	5.750	2032/10/25	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,400,000	10,065.40	140,915,679	10,485.95	146,803,352	1.500	2026/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,300,000	10,785.10	140,206,382	11,025.29	143,328,844	2.000	2022/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	1,200,000	11,350.46	136,205,541	11,376.47	136,517,700	3.625	2021/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,200,000	10,718.30	128,619,651	11,132.81	133,593,807	2.375	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,200,000	10,623.96	127,487,554	11,033.96	132,407,602	2.250	2027/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,200,000	10,763.42	129,161,144	11,021.82	132,261,927	2.000	2023/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,200,000	10,577.86	126,934,407	11,002.75	132,033,010	2.250	2027/11/15	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 6.5	800,000	15,726.82	125,814,569	16,483.64	131,869,181	6.500	2027/11/1	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,200,000	10,849.27	130,191,270	10,975.87	131,710,446	1.625	2020/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,200,000	10,718.33	128,620,068	10,949.85	131,398,286	1.750	2022/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,200,000	10,442.57	125,310,935	10,817.18	129,806,274	1.625	2023/10/31	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.5	900,000	13,370.27	120,332,434	13,956.32	125,606,927	1.500	2031/5/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,100,000	11,080.79	121,888,697	11,401.62	125,417,833	2.750	2025/2/28	0.42
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 4.25	600,000	20,160.91	120,965,512	20,744.89	124,469,389	4.250	2036/3/7	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	800,000	14,799.75	118,398,017	15,339.43	122,715,515	2.500	2030/5/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	800,000	14,963.39	119,707,143	15,308.92	122,471,378	2.750	2027/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,100,000	10,703.59	117,739,579	11,070.38	121,774,239	2.250	2025/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	600,000	19,501.11	117,006,682	20,148.82	120,892,954	4.750	2035/4/25	0.40

□ 種類別の投資比率

2019年 3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.04
合計	96.04

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)

2019年 3月29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	305	日本円	4,835,563,440	4,855,600,000	2.78

(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

2019年 3月29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 1906	買建	227	米ドル	31,739,071	3,522,719,490	32,018,350	3,553,716,666	1.95
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1906	買建	212	ユーロ	6,874,124	856,240,885	6,870,920	855,841,795	0.47
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1906	買建	19	オーストラリアドル	2,924,185.5	229,957,948	2,929,800	230,399,472	0.12
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1906	買建	30	英ポンド	2,134,575	309,470,683	2,148,750	311,525,775	0.17

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2019年 3月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,900,000.00	209,627,000	210,824,000	0.11
	カナダドル	買建	140,000.00	11,508,000	11,566,800	0.00
	ユーロ	買建	290,000.00	35,980,300	36,122,400	0.01
	英ポンド	買建	140,000.00	20,353,200	20,294,400	0.01
	スイスフラン	買建	90,000.00	9,977,400	10,035,900	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	260,000.00	3,091,400	3,104,400	0.00
	ノルウェークローネ	買建	70,000.00	894,600	898,800	0.00
	デンマーククローネ	買建	10,000.00	166,200	166,800	0.00
	オーストラリアドル	買建	100,000.00	7,813,000	7,862,000	0.00
	香港ドル	買建	330,000.00	4,636,500	4,662,900	0.00
	シンガポールドル	買建	20,000.00	1,626,800	1,637,200	0.00
	イスラエルシェケル	買建	20,000.00	607,400	611,600	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

2019年 3月29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 1906	買建	830	米ドル	43,026,765	4,775,540,647	43,467,100	4,824,413,429	60.92

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2019年 3月29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	36,530,855.78	4,017,308,815	4,027,526,904	50.86
	米ドル	売建	207,549.38	23,000,000	22,882,319	0.28
	ブラジルリアル	売建	319.30	8,815	9,074	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

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

2019年 3月29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	158,141.08	17,500,000	17,546,432	0.31
	ユーロ	買建	11,259.10	1,400,000	1,402,432	0.02
	オーストラリアドル	買建	18,502.02	1,450,000	1,454,628	0.02
	香港ドル	買建	35,410.76	500,000	500,354	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。

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

2019年 3月29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	120,200,000.00	13,387,639,206	13,330,180,000	44.11
	カナダドル	売建	6,900,000.00	584,261,640	569,871,000	1.88
	メキシコペソ	売建	41,000,000.00	235,633,806	234,110,000	0.77
	ユーロ	売建	88,900,000.00	11,291,553,490	11,073,384,000	36.64
	英ポンド	売建	13,400,000.00	1,982,492,480	1,942,062,000	6.42
	スウェーデンクローナ	売建	8,800,000.00	106,373,520	105,072,000	0.34

ノルウェークローネ	売建	5,400,000.00	70,394,400	69,336,000	0.22
デンマーククローネ	売建	8,900,000.00	151,543,860	148,452,000	0.49
ポーランドズロチ	売建	6,400,000.00	188,623,936	185,472,000	0.61
オーストラリアドル	売建	7,800,000.00	616,547,100	613,002,000	2.02
シンガポールドル	売建	3,100,000.00	255,547,880	253,642,000	0.83
南アフリカランド	売建	21,400,000.00	168,707,756	162,212,000	0.53

(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: 2019年3月29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

■ 1 安定重視型



※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
2018年9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。

■ 2 やや安定型



※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
2018年9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。

■ 3 バランス型



※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
2018年9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。

■ 4 やや成長型



※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
2018年9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。

■ 5 成長重視型



※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
2018年9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

■ 1安定重視型

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	98.01
投資信託受益証券	アメリカ	0.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.00
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	63.29
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	10.91
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)	6.00
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	5.97
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	4.91
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	2.99
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	1.99
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	1.97
アメリカ	投資信託受益証券	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	0.99

■ 2やや安定型

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	97.01
投資信託受益証券	アメリカ	2.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.99
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	39.69
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	15.83
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)	13.90
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	13.81
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	3.99
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	3.95
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	2.96
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	2.89
アメリカ	投資信託受益証券	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	2.00

■ 3バランス型

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	95.97
投資信託受益証券	アメリカ	3.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.02
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	24.85
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)	20.77
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	20.75
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	13.87
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	5.82
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	4.99
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	3.94
アメリカ	投資信託受益証券	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	3.01
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	0.99

※比率は、各ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■ 4 やや成長型

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	94.96
投資信託受益証券	アメリカ	4.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.01
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)	25.78
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	25.58
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	10.98
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	10.95
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	9.74
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	6.01
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	4.95
アメリカ	投資信託受益証券	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	4.03
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	0.97

■ 5 成長重視型

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	94.02
投資信託受益証券	アメリカ	4.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.01
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)	30.79
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	30.57
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	16.64
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	5.08
アメリカ	投資信託受益証券	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	4.97
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	4.02
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	3.95
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	2.02
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	0.95

※比率は、各ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■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	1.20
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	0.100	2028/03/20	1.10
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	1.05
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	0.88
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2020/03/19	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.84
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	0.100	2026/12/20	0.81
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	0.100	2027/03/20	0.81
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	0.800	2022/09/20	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 2.875	2.875	2028/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/01/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2021/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2027/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/08/31	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2027/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/04/30	0.41

■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 2.375	2.375	2020/12/31	0.77
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	1.750	2023/05/25	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/02/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2020/05/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	3.375	2048/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/05/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2020/07/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1.375	2020/08/31	0.54

※比率は、各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。

■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(%)
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.1% 6/18/2050	5.100	2050/06/18	0.94
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 8.75% 11/21/2033	8.750	2033/11/21	0.74
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25% 6/23/2047	5.250	2047/06/23	0.74
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.63% 11/18/2050	5.630	2050/11/18	0.71
ポーランド	国債証券	POLAND (REPUBLIC OF) 5% 3/23/2022	5.000	2022/03/23	0.70
コロンビア	国債証券	COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5% 6/15/2045	5.000	2045/06/15	0.64
バーミンガム(英領)	政府機関債	IMDB GLOBAL INVESTMENTS LTD RegS 4.4% 3/9/2023	4.400	2023/03/09	0.60
エクアドル	国債証券	ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS 7.88% 1/23/2028	7.880	2028/01/23	0.58
カザフスタン	国債証券	KAZAKHSTAN (REPUBLIC OF) MTN RegS 5.13% 7/21/2025	5.130	2025/07/21	0.57
イラク	国債証券	IRAQ (REPUBLIC OF) RegS 5.8% 1/15/2028	5.800	2028/01/15	0.57

※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

※国・地域は発行国基準です。

■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	3.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.88
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.59
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.44
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.34
日本	株式	ソニー	電気機器	1.33
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.08
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	0.98

※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(2.78%)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	2.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.97
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	1.07
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	1.00
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	0.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.90
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	0.79

※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(2.71%)を行っています。

※比率は、各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。

■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	TENCENT HOLDINGS LIMITED	メディア・娯楽	1.92
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	小売	1.72
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	1.49
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	1.44
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	1.41
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	小売	0.74
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	0.62
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	0.47
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	0.42
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	0.42

※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(60.92%)を行っています。

■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	7.52
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.76
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.26
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4.36
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.99
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.92
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.41
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3.27
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.11
日本	投資証券	GLP投資法人	3.04

■外国リート・インデックス・マザーファンド

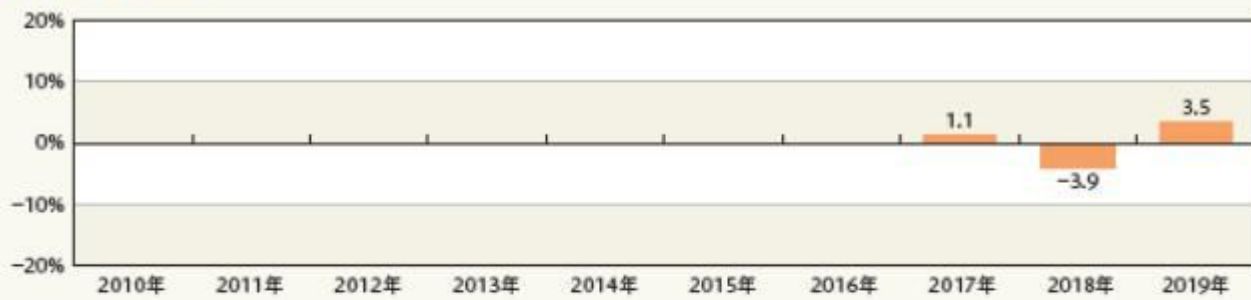
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	4.56
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	3.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.62
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.52
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.24
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.05
香港	投資証券	LINK REIT	2.03
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1.87
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	1.85

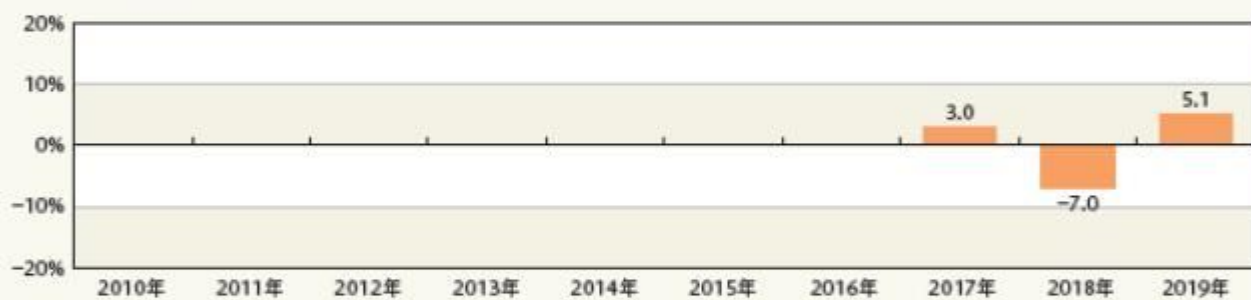
※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

1 安定重視型



2 やや安定型



3 バランス型



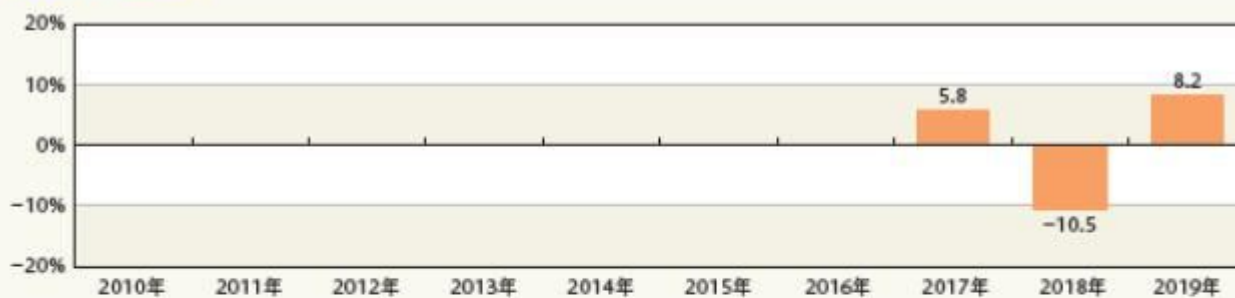
※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。

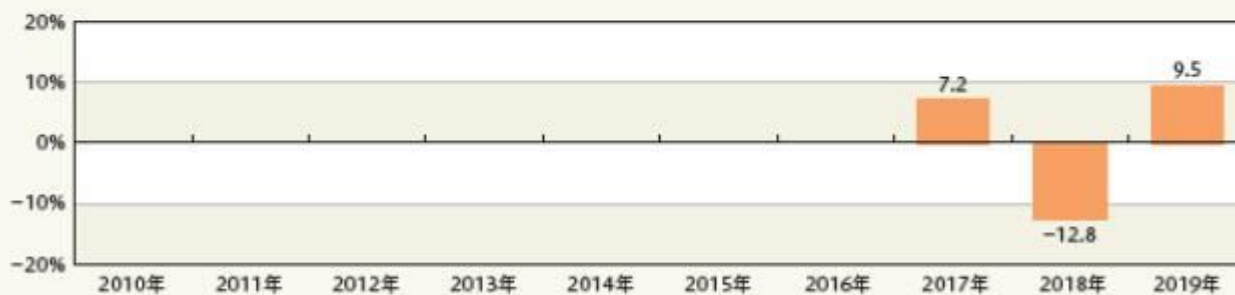
※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年3月29日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

■ 4 やや成長型



■ 5 成長重視型



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

※2017年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2017年9月14日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2019年のファンドの収益率は、年初から2019年3月29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または委託会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が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。）。

□ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

八 申込手数料

無手数料です。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

申込手数料、申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友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、解約請求の受け付けは行いません。

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。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

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

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、「1安定重視型」は「最適安定重視」、「2やや安定型」は「最適やや安定」、「3バランス型」は「最適バランス」、「4やや成長型」は「最適やや成長」、「5成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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】

2017年9月14日から2037年9月15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。

(4)【計算期間】

毎年9月16日から翌年9月15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10億口を下回るようになったとき、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発送します。
 - c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
 - e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
- 委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- 委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
 - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
 - c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)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、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知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であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

す。

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 . 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期(平成29年 9月14日から平成30年 9月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		(平成30年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金		8,977
コール・ローン		2,823,416
投資信託受益証券		1,593,827
親投資信託受益証券		184,201,977
流動資産合計		188,628,197
資産合計		188,628,197
負債の部		
流動負債		
未払解約金		48,677
未払受託者報酬		7,330
未払委託者報酬		207,733
未払利息		7
その他未払費用		1,416
流動負債合計		265,163
負債合計		265,163
純資産の部		
元本等		
元本		190,446,384
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		2,083,350
元本等合計		188,363,034
純資産合計		188,363,034
負債純資産合計		188,628,197

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
営業収益	
受取配当金	8,975
受取利息	1
有価証券売買等損益	195,087
為替差損益	10,776
営業収益合計	175,335
営業費用	
支払利息	223
受託者報酬	8,259
委託者報酬	234,151
その他費用	8,257
営業費用合計	250,890
営業利益又は営業損失 ()	426,225
経常利益又は経常損失 ()	426,225
当期純利益又は当期純損失 ()	426,225
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 ()	46,370
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,451
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,451
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,708,946
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,708,946
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2,083,350

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期	
	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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	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	第1期	
	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		190,446,384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	2,083,350円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9891円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,891円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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（458,464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（222,622円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は681,086円（1万口当たり35.75円）ではありますが、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1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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す。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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1期(自平成29年9月14日 至平成30年9月18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	18,064円
親投資信託受益証券	146,067円
合計	164,131円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自平成29年9月14日 至平成30年9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成30年9月18日現在)
期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	195,260,985円
期中一部解約元本額	6,814,601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	134	14,252.24	
		米ドル 小計	134	14,252.24 (1,593,827)	
投資信託受益証券合計				1,593,827 (1,593,827)	
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)	4,267,987	11,586,304	
		外国株式インデックス・マザーファンド	3,100,399	11,211,662	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	86,822,932	118,860,593	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	11,784,259	20,529,357	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	7,392,488	9,283,486	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	1,753,162	3,577,677	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	2,581,881	5,387,611	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,894,371	3,765,287	
親投資信託受益証券合計			120,597,479	184,201,977	
合計				185,795,804 (1,593,827)	

(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 1銘柄	0.8%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (平成30年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金		21,365
コール・ローン		4,421,227
投資信託受益証券		1,653,299
親投資信託受益証券		91,960,491
流動資産合計		98,056,382
資産合計		98,056,382
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,434,493
未払受託者報酬		6,637
未払委託者報酬		188,265
未払利息		12
その他未払費用		1,261
流動負債合計		2,630,668
負債合計		2,630,668
純資産の部		
元本等		
元本		95,204,855
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		220,859
元本等合計		95,425,714
純資産合計		95,425,714
負債純資産合計		98,056,382

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
営業収益	
受取配当金	21,357
受取利息	4
有価証券売買等損益	832,229
為替差損益	821
営業収益合計	811,689
営業費用	
支払利息	323
受託者報酬	9,596
委託者報酬	271,964
その他費用	41,545
営業費用合計	323,428
営業利益又は営業損失（ ）	1,135,117
経常利益又は経常損失（ ）	1,135,117
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,135,117
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（ ）	1,595,346
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	685,417
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	685,417
剰余金減少額又は欠損金増加額	924,787
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	924,787
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（ ）	220,859

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期
	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	(平成30年 9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	95,204,855口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0023円
	(10,000口当たりの純資産額 10,023円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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(454,312円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,917円)、収益調整金(221,376円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は681,605円(1万口当たり71.58円)ではありますが、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1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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	33,470円
親投資信託受益証券	707,188円
合計	673,718円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 （平成30年 9月18日現在）
期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	233,257,377円
期中一部解約元本額	140,052,522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・米ドル建てエマーシング・マーケット債券ETF	139	14,784.04	
		米ドル 小計	139	14,784.04 (1,653,299)	
投資信託受益証券合計				1,653,299 (1,653,299)	
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）	5,029,645	13,653,977	
		外国株式インデックス・マザーファンド	3,653,198	13,210,694	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	27,382,925	37,487,224	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	8,659,258	15,085,293	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	2,950,441	3,705,163	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	1,259,560	2,570,384	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	1,649,949	3,442,948	
		エマーシング株式インデックス・マザーファンド	2,156,052	2,804,808	
親投資信託受益証券合計			52,741,028	91,960,491	
合計				93,613,790 (1,653,299)	

（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 1銘柄	1.7%	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

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月18日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	129,631
コール・ローン	5,206,866
投資信託受益証券	7,957,245
親投資信託受益証券	281,631,985
流動資産合計	294,925,727
資産合計	294,925,727
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	27,299
未払委託者報酬	773,405
未払利息	14
その他未払費用	5,423
流動負債合計	806,141
負債合計	806,141
純資産の部	
元本等	
元本	286,534,708
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	7,584,878
元本等合計	294,119,586
純資産合計	294,119,586
負債純資産合計	294,925,727

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
営業収益	
受取配当金	129,574
受取利息	35
有価証券売買等損益	310,478
為替差損益	84,846
営業収益合計	96,023
営業費用	
支払利息	1,202
受託者報酬	36,581
委託者報酬	1,036,358
その他費用	77,819
営業費用合計	1,151,960
営業利益又は営業損失（ ）	1,247,983
経常利益又は経常損失（ ）	1,247,983
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,247,983
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,982,686
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,896,348
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	9,896,348
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,046,173
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,046,173
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（ ）	7,584,878

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期	
	自平成29年9月14日 至平成30年9月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	
	(平成30年9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		286,534,708口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0265円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,265円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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(1,680,171円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(54,532円)、収益調整金(5,850,175円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は7,584,878円(1万口当たり264.69円)ですが、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1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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1期（自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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	275,229円
親投資信託受益証券	2,751,644円
合計	2,476,415円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 （平成30年 9月18日現在）
期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	424,008,460円
期中一部解約元本額	139,473,752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	669	71,154.84	
	米ドル 小計		669	71,154.84 (7,957,245)	
投資信託受益証券合計				7,957,245 (7,957,245)	
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）	23,159,228	62,870,356	
		外国株式インデックス・マザーファンド	16,822,085	60,832,023	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	52,529,180	71,912,447	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	23,249,844	40,503,553	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	2,202,839	2,766,325	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	5,488,414	11,200,206	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	6,739,312	14,062,922	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	13,440,044	17,484,153	
親投資信託受益証券合計			143,630,946	281,631,985	
合計				289,589,230 (7,957,245)	

（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 1銘柄	2.7%	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

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		（平成30年 9月18日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		170,176
コール・ローン		4,348,934
投資信託受益証券		7,219,802
親投資信託受益証券		187,459,921
流動資産合計		199,198,833
資産合計		199,198,833
負債の部		
流動負債		
未払解約金		48,801
未払受託者報酬		23,388
未払委託者報酬		662,542
未払利息		12
その他未払費用		4,626
流動負債合計		739,369
負債合計		739,369
純資産の部		
元本等		
元本		191,465,549
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,993,915
元本等合計		198,459,464
純資産合計		198,459,464
負債純資産合計		199,198,833

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
営業収益	
受取配当金	169,904
受取利息	48
有価証券売買等損益	3,150,064
為替差損益	61,827
営業収益合計	3,381,843
営業費用	
支払利息	1,516
受託者報酬	35,662
委託者報酬	1,010,366
その他費用	85,549
営業費用合計	1,133,093
営業利益又は営業損失()	2,248,750
経常利益又は経常損失()	2,248,750
当期純利益又は当期純損失()	2,248,750
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()	1,244,442
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,609,817
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	15,609,817
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,620,210
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,620,210
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()	6,993,915

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期	
	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	
	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		191,465,549口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0365円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,365円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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（1,413,380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（5,580,535円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は6,993,915円（1万口当たり365.27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1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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1期(自平成29年9月14日 至平成30年9月18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	359,535円
親投資信託受益証券	2,071,349円
合計	1,711,814円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自平成29年9月14日 至平成30年9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成30年9月18日現在)
期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	409,158,724円
期中一部解約元本額	219,693,175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	607	64,560.52	
	米ドル 小計		607	64,560.52 (7,219,802)	
投資信託受益証券合計				7,219,802 (7,219,802)	
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)	19,292,606	52,373,637	
		外国株式インデックス・マザーファンド	14,016,857	50,687,758	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	15,552,434	21,291,282	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	12,296,695	21,422,072	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	1,542,455	1,937,014	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	4,478,450	9,139,172	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	5,275,024	11,007,392	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	15,067,718	19,601,594	
親投資信託受益証券合計			87,522,239	187,459,921	
合計				194,679,723 (7,219,802)	

(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 1銘柄	3.6%	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

該当事項はありません。

【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (平成30年 9月18日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	596,785
コール・ローン	6,945,237
投資信託受益証券	23,455,438
親投資信託受益証券	447,128,136
未収入金	490,000
流動資産合計	478,615,596
資産合計	478,615,596
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,224,186
未払受託者報酬	72,281
未払委託者報酬	2,047,904
未払利息	19
その他未払費用	14,418
流動負債合計	3,358,808
負債合計	3,358,808
純資産の部	
元本等	
元本	455,009,598
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	20,247,190
元本等合計	475,256,788
純資産合計	475,256,788
負債純資産合計	478,615,596

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
営業収益	
受取配当金	595,684
受取利息	171
有価証券売買等損益	1,660,598
為替差損益	317,325
営業収益合計	747,418
営業費用	
支払利息	3,702
受託者報酬	98,830
委託者報酬	2,800,002
その他費用	112,659
営業費用合計	3,015,193
営業利益又は営業損失 ()	3,762,611
経常利益又は経常損失 ()	3,762,611
当期純利益又は当期純損失 ()	3,762,611
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	4,729,924
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,460,896
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	34,460,896
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,181,019
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,181,019
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 ()	20,247,190

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	
	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		455,009,598口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0445円
	(10,000口当たりの純資産額	10,445円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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(3,914,880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(16,332,310円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は20,247,190円(1万口当たり444.96円)ですが、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1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

項目	第1期 自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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1期(自平成29年9月14日 至平成30年9月18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	1,420,201円
親投資信託受益証券	3,174,142円
合計	1,753,941円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自平成29年9月14日 至平成30年9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (平成30年9月18日現在)
期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	760,271,388円
期中一部解約元本額	307,261,790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	1,972	209,741.92	
		米ドル 小計	1,972	209,741.92 (23,455,438)	
投資信託受益証券合計				23,455,438 (23,455,438)	
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)	54,814,758	148,805,623	
		外国株式インデックス・マザーファンド	40,131,729	145,124,358	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	6,718,967	9,198,265	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	10,677,614	18,601,471	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	3,669,123	4,607,684	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	9,108,096	18,586,891	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	11,069,429	23,098,577	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	60,808,108	79,105,267	
親投資信託受益証券合計			196,997,824	447,128,136	
合計				470,583,574 (23,455,438)	

(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 1銘柄	4.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）」「三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）」「三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）」「三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）」および「三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）」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」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「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」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

（単位：円）	
（平成30年 9月18日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,857,844,318
株式	178,319,347,240
派生商品評価勘定	110,901,680
未収入金	253,564,782
未収配当金	72,300,585
差入委託証拠金	56,845,000
流動資産合計	181,670,803,605
資産合計	181,670,803,605
負債の部	
流動負債	
前受金	111,095,000
未払金	10,056,959
未払解約金	73,030,593
未払利息	8,045
その他未払費用	18,114
流動負債合計	194,208,711
負債合計	194,208,711
純資産の部	
元本等	
元本	66,849,199,400
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	114,627,395,494
元本等合計	181,476,594,894
純資産合計	181,476,594,894
負債純資産合計	181,670,803,605

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成30年 9月18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 2,784,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,849,199,400口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.7147円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,147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 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>
	(1) 金融商品の内容

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成30年 9月18日現在)
-----	-----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月18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	3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680
	東証株価指数先物	3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680
	合計	3,016,228,320	-	3,127,130,000	110,901,680

(注)1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,555,837,479円
同期中における追加設定元本額	11,599,504,362円
同期中における一部解約元本額	22,306,142,441円
平成30年 9月18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	10,110,015,968円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	720,304,579円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,474,932,392円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,575,339,657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)	109,573,345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)	7,031,846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)	23,342,106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)	58,890,208円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	81,862,705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)	47,949,422円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	119,707,931円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,741,573,278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	6,576,334,078円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	462,418,998円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	647,481,975円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	628,146,538円
イオン・バランス戦略ファンド	30,183,406円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,524,546円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,267,987円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,029,645円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	23,159,228円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,292,606円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	54,814,758円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	4,575,879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)	6,276,338,555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 >	25,930,420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 >	782,961,562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 >	3,655,636,480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 >	2,525,914,762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 >	9,281,043,684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 >	57,070,190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 >	224,385,726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 >	779,654円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,025,940,455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 >	55,784,848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 >	380,046,357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 >	1,094,310,631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 >	968,009,581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 >	3,183,125,486円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	2,904,791円

三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,354,601,775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>	67,722,044円
S M A M・バランスファンドV A 20 <適格機関投資家専用>	108,024,599円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	104,572,701円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	47,179,642円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	22,068,903円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	213,768,667円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	387,184,313円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T <適格機関投資家専用>	162,473,705円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A 2 <適格機関投資家専用>	115,344,686円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A 2 <適格機関投資家専用>	59,920,850円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A 2 <適格機関投資家専用>	10,985,484円
S M A M・アセットバランスファンドV A 30 L 2 <適格機関投資家専用>	76,185,056円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L 2 <適格機関投資家専用>	968,969,824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)	205,175,335円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T 2 <適格機関投資家専用>	19,535,802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>	1,730,910,414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>	249,740,027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>	1,683,022,698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>	156,929,929円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	13,174,879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>	127,663,987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>	61,164,812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>	152,667,380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>	20,857円
合計	66,849,199,400円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,280.00	11,480,000	
日本水産	89,500	647.00	57,906,500	
マルハニチロ	15,100	4,040.00	61,004,000	
カネコ種苗	3,800	1,578.00	5,996,400	
サカタのタネ	11,400	3,850.00	43,890,000	
ホクト	8,000	1,941.00	15,528,000	
日鉄鉱業	2,400	5,110.00	12,264,000	

三井松島産業	5,100	1,867.00	9,521,700
国際石油開発帝石	387,300	1,350.00	522,855,000
石油資源開発	12,200	2,508.00	30,597,600
K & O エナジーグループ	5,200	1,699.00	8,834,800
ヒノキヤグループ	2,500	2,924.00	7,310,000
ショーボンドホールディングス	7,500	8,690.00	65,175,000
ミライト・ホールディングス	24,000	1,804.00	43,296,000
タマホーム	8,000	1,018.00	8,144,000
T A T E R U	11,600	443.00	5,138,800
安藤・間	64,700	833.00	53,895,100
東急建設	30,300	1,072.00	32,481,600
コムシスホールディングス	27,200	3,235.00	87,992,000
ミサワホーム	8,300	850.00	7,055,000
高松コンストラクショングループ	5,000	2,980.00	14,900,000
東建コーポレーション	2,900	7,270.00	21,083,000
大成建設	79,000	5,010.00	395,790,000
大林組	237,700	1,067.00	253,625,900
清水建設	242,500	989.00	239,832,500
飛鳥建設	79,900	180.00	14,382,000
長谷工コーポレーション	92,700	1,478.00	137,010,600
松井建設	10,800	894.00	9,655,200
銭高組	1,400	5,060.00	7,084,000
鹿島建設	349,000	795.00	277,455,000
不動テトラ	71,700	210.00	15,057,000
鉄建建設	5,100	2,871.00	14,642,100
西松建設	19,100	2,737.00	52,276,700
三井住友建設	58,800	734.00	43,159,200
大豊建設	29,000	646.00	18,734,000
前田建設工業	57,400	1,472.00	84,492,800
奥村組	13,500	3,440.00	46,440,000
東鉄工業	9,400	2,971.00	27,927,400
イチケン	2,000	2,225.00	4,450,000
浅沼組	36,000	350.00	12,600,000
戸田建設	93,200	792.00	73,814,400
熊谷組	12,300	2,964.00	36,457,200
北野建設	21,000	402.00	8,442,000
三井ホーム	13,000	978.00	12,714,000
矢作建設工業	12,500	838.00	10,475,000
ピーエス三菱	12,800	546.00	6,988,800
日本ハウスホールディングス	19,700	575.00	11,327,500
大東建託	28,400	15,020.00	426,568,000
新日本建設	12,300	1,144.00	14,071,200

N I P P O	18,100	2,111.00	38,209,100
東亜道路工業	2,200	3,560.00	7,832,000
前田道路	25,000	2,278.00	56,950,000
日本道路	2,400	6,030.00	14,472,000
東亜建設工業	6,800	2,461.00	16,734,800
若築建設	5,800	1,594.00	9,245,200
東洋建設	31,700	435.00	13,789,500
五洋建設	95,800	716.00	68,592,800
世紀東急工業	13,900	696.00	9,674,400
福田組	2,600	5,410.00	14,066,000
住友林業	50,600	1,881.00	95,178,600
日成ビルド工業	12,800	1,059.00	13,555,200
巴コーポレーション	14,300	472.00	6,749,600
大和ハウス工業	234,900	3,249.00	763,190,100
ライト工業	15,300	1,470.00	22,491,000
積水ハウス	259,100	1,709.00	442,801,900
北陸電気工事	7,400	1,026.00	7,592,400
ユアテック	13,200	910.00	12,012,000
中電工	9,500	2,631.00	24,994,500
関電工	30,500	1,133.00	34,556,500
きんでん	52,700	1,776.00	93,595,200
東京エネシス	10,800	1,088.00	11,750,400
トーエネック	2,700	3,180.00	8,586,000
住友電設	7,700	1,823.00	14,037,100
日本電設工業	11,800	2,222.00	26,219,600
協和エクシオ	29,100	3,260.00	94,866,000
新日本空調	7,300	1,651.00	12,052,300
N D S	1,600	6,660.00	10,656,000
九電工	15,600	4,500.00	70,200,000
三機工業	16,500	1,193.00	19,684,500
日揮	68,600	2,365.00	162,239,000
中外炉工業	3,200	2,959.00	9,468,800
ヤマト	9,100	686.00	6,242,600
太平電業	5,500	2,753.00	15,141,500
高砂熱学工業	21,600	2,048.00	44,236,800
朝日工業社	2,300	3,300.00	7,590,000
明星工業	15,800	898.00	14,188,400
大気社	10,000	3,595.00	35,950,000
ダイダン	5,700	2,755.00	15,703,500
日比谷総合設備	9,000	1,877.00	16,893,000
東芝プラントシステム	17,000	2,426.00	41,242,000
O S J Bホールディングス	42,700	294.00	12,553,800

千代田化工建設	52,700	849.00	44,742,300
新興プランテック	16,100	1,054.00	16,969,400
日本製粉	22,300	1,929.00	43,016,700
日清製粉グループ本社	86,600	2,295.00	198,747,000
日東富士製粉	1,200	5,290.00	6,348,000
昭和産業	6,000	2,938.00	17,628,000
鳥越製粉	9,400	1,001.00	9,409,400
中部飼料	8,700	1,500.00	13,050,000
フィード・ワン	52,400	215.00	11,266,000
日本甜菜製糖	5,000	1,941.00	9,705,000
三井製糖	5,400	3,120.00	16,848,000
日新製糖	3,800	2,203.00	8,371,400
森永製菓	16,800	4,090.00	68,712,000
中村屋	2,600	4,800.00	12,480,000
江崎グリコ	19,900	5,350.00	106,465,000
名糖産業	4,800	1,703.00	8,174,400
井村屋グループ	3,200	3,340.00	10,688,000
不二家	5,000	2,483.00	12,415,000
山崎製パン	58,100	2,260.00	131,306,000
モロゾフ	1,600	5,730.00	9,168,000
亀田製菓	4,400	5,070.00	22,308,000
寿スピリッツ	6,700	4,775.00	31,992,500
カルビー	32,600	3,600.00	117,360,000
森永乳業	14,400	2,957.00	42,580,800
六甲バター	5,600	2,466.00	13,809,600
ヤクルト本社	41,400	8,790.00	363,906,000
明治ホールディングス	46,900	7,450.00	349,405,000
雪印メグミルク	17,200	2,832.00	48,710,400
プリマハム	49,000	518.00	25,382,000
日本ハム	30,500	4,035.00	123,067,500
丸大食品	39,000	450.00	17,550,000
S Foods	4,900	4,715.00	23,103,500
伊藤ハム米久ホールディングス	43,200	774.00	33,436,800
サッポロホールディングス	26,200	2,296.00	60,155,200
アサヒグループホールディングス	149,200	4,961.00	740,181,200
キリンホールディングス	322,400	2,819.00	908,845,600
宝ホールディングス	53,700	1,484.00	79,690,800
オエノンホールディングス	24,800	403.00	9,994,400
養命酒製造	3,200	2,450.00	7,840,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,300	3,040.00	165,072,000
サントリー食品インターナショナル	47,300	4,610.00	218,053,000
ダイドーグループホールディングス	3,500	5,600.00	19,600,000

伊藤園	23,700	4,645.00	110,086,500
キーコーヒー	7,000	2,127.00	14,889,000
日清オイリオグループ	8,200	3,210.00	26,322,000
不二製油グループ本社	19,400	3,430.00	66,542,000
かどや製油	1,200	6,100.00	7,320,000
J - オイルミルズ	3,500	3,720.00	13,020,000
キッコーマン	51,000	6,500.00	331,500,000
味の素	164,400	1,914.50	314,743,800
キューピー	39,800	2,636.00	104,912,800
ハウス食品グループ本社	27,100	3,305.00	89,565,500
カゴメ	28,700	3,215.00	92,270,500
焼津水産化学工業	5,600	1,049.00	5,874,400
アリアケジャパン	6,300	10,580.00	66,654,000
ニチレイ	33,900	2,876.00	97,496,400
東洋水産	38,900	4,455.00	173,299,500
日清食品ホールディングス	27,700	7,590.00	210,243,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,500.00	13,500,000
一正蒲鉾	4,200	1,055.00	4,431,000
フジッコ	7,800	2,334.00	18,205,200
ロック・フィールド	7,600	1,785.00	13,566,000
日本たばこ産業	411,400	2,989.50	1,229,880,300
ケンコーマヨネーズ	5,000	2,772.00	13,860,000
わらべや日洋ホールディングス	5,200	2,229.00	11,590,800
なとり	5,300	1,820.00	9,646,000
北の達人コーポレーション	23,600	610.00	14,396,000
ユーグレナ	29,400	851.00	25,019,400
ミヨシ油脂	5,300	1,279.00	6,778,700
理研ビタミン	3,000	3,760.00	11,280,000
片倉工業	10,000	1,344.00	13,440,000
ゲンゼ	5,500	5,740.00	31,570,000
東洋紡	28,000	1,855.00	51,940,000
ユニチカ	23,100	685.00	15,823,500
富士紡ホールディングス	4,500	3,285.00	14,782,500
倉敷紡績	74,000	300.00	22,200,000
シキボウ	5,900	1,322.00	7,799,800
日本毛織	22,900	918.00	21,022,200
帝国繊維	7,900	2,738.00	21,630,200
帝人	60,600	2,212.00	134,047,200
東レ	540,200	859.10	464,085,820
サカイオーベックス	2,700	2,369.00	6,396,300
住江織物	2,700	3,205.00	8,653,500
アツギ	7,200	1,169.00	8,416,800

ダイニック	5,200	919.00	4,778,800
セーレン	16,900	1,841.00	31,112,900
小松精練	13,000	989.00	12,857,000
ワコールホールディングス	20,200	3,275.00	66,155,000
ホギメディカル	9,400	3,915.00	36,801,000
レナウン	32,300	122.00	3,940,600
T S Iホールディングス	25,500	768.00	19,584,000
マツオカコーポレーション	1,900	3,350.00	6,365,000
三陽商会	4,900	2,130.00	10,437,000
オンワードホールディングス	44,200	726.00	32,089,200
ルックホールディングス	3,600	1,256.00	4,521,600
ゴールドウイン	4,200	7,210.00	30,282,000
デサント	16,800	2,227.00	37,413,600
特種東海製紙	4,100	4,545.00	18,634,500
王子ホールディングス	311,000	802.00	249,422,000
日本製紙	33,100	2,025.00	67,027,500
三菱製紙	12,900	637.00	8,217,300
北越コーポレーション	40,200	636.00	25,567,200
中越パルプ工業	3,700	1,571.00	5,812,700
巴川製紙所	19,000	273.00	5,187,000
大王製紙	28,600	1,635.00	46,761,000
レンゴー	70,500	912.00	64,296,000
トーモク	5,100	2,035.00	10,378,500
ザ・パック	5,300	3,465.00	18,364,500
クラレ	116,500	1,643.00	191,409,500
旭化成	463,600	1,657.50	768,417,000
共和レザー	6,300	991.00	6,243,300
昭和電工	46,200	5,310.00	245,322,000
住友化学	544,000	628.00	341,632,000
住友精化	3,100	5,910.00	18,321,000
日産化学	42,800	5,900.00	252,520,000
ラサ工業	3,200	2,256.00	7,219,200
クレハ	6,300	7,860.00	49,518,000
テイカ	6,300	2,509.00	15,806,700
石原産業	13,600	1,579.00	21,474,400
日東エフシー	7,100	763.00	5,417,300
日本曹達	51,000	673.00	34,323,000
東ソー	107,000	1,690.00	180,830,000
トクヤマ	21,700	3,005.00	65,208,500
セントラル硝子	15,600	2,834.00	44,210,400
東亜合成	43,800	1,270.00	55,626,000
大阪ソーダ	7,500	2,940.00	22,050,000

関東電化工業	18,200	1,155.00	21,021,000
デンカ	27,300	3,735.00	101,965,500
信越化学工業	122,500	9,649.00	1,182,002,500
日本カーバイド工業	3,200	1,708.00	5,465,600
堺化学工業	5,200	2,738.00	14,237,600
第一稀元素化学工業	6,300	1,309.00	8,246,700
エア・ウォーター	60,800	2,000.00	121,600,000
大陽日酸	57,100	1,668.00	95,242,800
日本化学工業	2,900	3,640.00	10,556,000
日本パーカラライジング	38,900	1,495.00	58,155,500
高压ガス工業	12,300	911.00	11,205,300
四国化成工業	10,600	1,516.00	16,069,600
ステラ ケミファ	4,000	3,750.00	15,000,000
保土谷化学工業	3,100	3,105.00	9,625,500
日本触媒	11,600	8,440.00	97,904,000
大日精化工業	5,700	3,355.00	19,123,500
カネカ	99,000	1,033.00	102,267,000
三菱瓦斯化学	61,100	2,295.00	140,224,500
三井化学	67,100	2,789.00	187,141,900
J S R	74,600	2,089.00	155,839,400
東京応化工業	12,000	3,265.00	39,180,000
大阪有機化学工業	7,200	1,325.00	9,540,000
三菱ケミカルホールディングス	497,400	1,002.50	498,643,500
K Hネオケム	10,700	4,275.00	45,742,500
ダイセル	100,300	1,283.00	128,684,900
住友ベークライト	60,000	1,052.00	63,120,000
積水化学工業	150,800	1,976.00	297,980,800
日本ゼオン	62,800	1,153.00	72,408,400
アイカ工業	20,900	4,465.00	93,318,500
宇部興産	37,300	2,734.00	101,978,200
積水樹脂	11,400	2,051.00	23,381,400
タキロンシーアイ	16,400	644.00	10,561,600
旭有機材	5,100	2,613.00	13,326,300
日立化成	36,400	2,149.00	78,223,600
ニチバン	4,100	2,531.00	10,377,100
リケンテクノス	18,300	580.00	10,614,000
大倉工業	4,100	2,081.00	8,532,100
積水化成品工業	10,000	981.00	9,810,000
群栄化学工業	2,300	3,320.00	7,636,000
ミライアル	3,500	1,138.00	3,983,000
ダイキョーニシカワ	14,300	1,351.00	19,319,300
森六ホールディングス	3,900	3,025.00	11,797,500

日本化薬	48,200	1,311.00	63,190,200
カーリットホールディングス	8,100	976.00	7,905,600
日本精化	8,000	1,345.00	10,760,000
扶桑化学工業	6,900	2,715.00	18,733,500
トリケミカル研究所	1,800	4,185.00	7,533,000
A D E K A	32,100	1,871.00	60,059,100
日油	28,800	3,675.00	105,840,000
新日本理化	17,300	224.00	3,875,200
ハリマ化成グループ	8,000	963.00	7,704,000
花王	174,600	9,223.00	1,610,335,800
第一工業製薬	16,000	680.00	10,880,000
三洋化成工業	4,500	5,490.00	24,705,000
大日本塗料	9,600	1,293.00	12,412,800
日本ペイントホールディングス	57,300	4,175.00	239,227,500
関西ペイント	78,000	2,087.00	162,786,000
中国塗料	21,100	1,200.00	25,320,000
日本特殊塗料	5,000	2,436.00	12,180,000
藤倉化成	12,300	658.00	8,093,400
太陽ホールディングス	5,600	4,310.00	24,136,000
D I C	31,400	3,860.00	121,204,000
サカタインクス	15,100	1,391.00	21,004,100
東洋インキS Cホールディングス	14,100	2,929.00	41,298,900
T & K T O K A	5,700	1,143.00	6,515,100
富士フイルムホールディングス	147,400	5,077.00	748,349,800
資生堂	141,100	7,838.00	1,105,941,800
ライオン	98,900	2,463.00	243,590,700
高砂香料工業	4,500	3,965.00	17,842,500
マンダム	13,700	3,495.00	47,881,500
ミルボン	8,800	4,950.00	43,560,000
ファンケル	17,200	5,060.00	87,032,000
コーセー	12,000	19,900.00	238,800,000
シーズ・ホールディングス	8,600	3,900.00	33,540,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,300	3,785.00	114,685,500
ノエビアホールディングス	4,400	6,170.00	27,148,000
エステー	5,500	2,035.00	11,192,500
アグロ カネショウ	3,300	2,536.00	8,368,800
コニシ	11,600	1,729.00	20,056,400
長谷川香料	8,400	2,238.00	18,799,200
星光P M C	5,500	1,049.00	5,769,500
小林製薬	19,900	8,060.00	160,394,000
荒川化学工業	6,900	1,840.00	12,696,000
メック	5,400	1,795.00	9,693,000

日本高純度化学	3,200	2,397.00	7,670,400
タカラバイオ	18,500	2,921.00	54,038,500
J C U	8,700	2,612.00	22,724,400
O A T アグリオ	1,500	2,696.00	4,044,000
デクセリアルズ	18,800	1,123.00	21,112,400
アース製薬	5,400	5,090.00	27,486,000
北興化学工業	10,800	575.00	6,210,000
大成ラミック	3,000	3,175.00	9,525,000
クミアイ化学工業	28,900	760.00	21,964,000
日本農薬	19,700	801.00	15,779,700
アキレス	6,200	2,327.00	14,427,400
有沢製作所	13,300	954.00	12,688,200
日東電工	53,600	8,351.00	447,613,600
レック	4,200	5,470.00	22,974,000
きもと	18,500	298.00	5,513,000
藤森工業	5,800	3,605.00	20,909,000
前澤化成工業	7,200	1,230.00	8,856,000
J S P	4,300	2,804.00	12,057,200
エフピコ	5,800	7,090.00	41,122,000
天馬	5,900	1,977.00	11,664,300
信越ポリマー	14,400	897.00	12,916,800
東リ	23,500	363.00	8,530,500
ニフコ	26,100	3,065.00	79,996,500
日本バルカー工業	6,000	3,065.00	18,390,000
ユニ・チャーム	150,800	3,847.00	580,127,600
協和発酵キリン	88,000	2,079.00	182,952,000
武田薬品工業	261,600	4,737.00	1,239,199,200
アステラス製薬	698,200	1,952.00	1,362,886,400
大日本住友製薬	52,600	2,361.00	124,188,600
塩野義製薬	100,000	7,124.00	712,400,000
田辺三菱製薬	85,900	1,837.00	157,798,300
あすか製薬	8,800	1,441.00	12,680,800
日本新薬	18,600	6,880.00	127,968,000
中外製薬	73,700	6,780.00	499,686,000
科研製薬	12,900	5,810.00	74,949,000
エーザイ	84,900	10,655.00	904,609,500
ロート製薬	39,200	3,855.00	151,116,000
小野薬品工業	167,700	3,044.00	510,478,800
久光製薬	21,000	8,460.00	177,660,000
持田製薬	5,000	8,720.00	43,600,000
参天製薬	134,500	1,738.00	233,761,000
扶桑薬品工業	3,500	2,907.00	10,174,500

日本ケミファ	1,500	4,705.00	7,057,500
ツムラ	25,600	4,000.00	102,400,000
日医工	18,500	1,648.00	30,488,000
キッセイ薬品工業	12,700	3,360.00	42,672,000
生化学工業	14,000	1,645.00	23,030,000
栄研化学	11,600	2,485.00	28,826,000
鳥居薬品	4,600	2,691.00	12,378,600
JCRファーマ	5,000	5,620.00	28,100,000
東和薬品	3,400	7,710.00	26,214,000
富士製薬工業	5,600	1,718.00	9,620,800
沢井製薬	14,500	6,000.00	87,000,000
ゼリア新薬工業	15,300	2,405.00	36,796,500
第一三共	203,200	4,580.00	930,656,000
キョーリン製薬ホールディングス	19,800	2,297.00	45,480,600
大幸薬品	4,700	1,933.00	9,085,100
ダイト	4,300	3,335.00	14,340,500
大塚ホールディングス	135,200	5,259.00	711,016,800
大正製薬ホールディングス	15,800	13,070.00	206,506,000
ペプチドリーム	32,700	4,255.00	139,138,500
日本コークス工業	75,000	112.00	8,400,000
昭和シェル石油	66,400	2,345.00	155,708,000
ニチレキ	9,800	1,230.00	12,054,000
ユシロ化学工業	5,100	1,534.00	7,823,400
富士石油	20,100	448.00	9,004,800
MORESCO	3,800	1,644.00	6,247,200
出光興産	59,500	5,940.00	353,430,000
JXTGホールディングス	1,132,000	802.00	907,864,000
コスモエネルギーホールディングス	20,100	4,210.00	84,621,000
横浜ゴム	41,200	2,356.00	97,067,200
東洋ゴム工業	37,100	1,955.00	72,530,500
ブリヂストン	218,200	4,182.00	912,512,400
住友ゴム工業	63,900	1,656.00	105,818,400
オカモト	25,000	1,223.00	30,575,000
ニッタ	7,800	4,000.00	31,200,000
住友理工	14,700	1,070.00	15,729,000
三ツ星ベルト	18,000	1,365.00	24,570,000
バンドー化学	14,200	1,272.00	18,062,400
日東紡績	10,500	2,646.00	27,783,000
AGC	71,200	4,545.00	323,604,000
日本板硝子	35,600	1,212.00	43,147,200
日本山村硝子	47,000	187.00	8,789,000
日本電気硝子	30,400	3,445.00	104,728,000

オハラ	3,000	3,150.00	9,450,000
住友大阪セメント	135,000	484.00	65,340,000
太平洋セメント	44,800	3,385.00	151,648,000
日本ヒューム	10,500	1,000.00	10,500,000
日本コンクリート工業	20,500	362.00	7,421,000
三谷セキサン	4,200	2,891.00	12,142,200
アジアパイルホールディングス	11,700	813.00	9,512,100
東海カーボン	64,300	2,091.00	134,451,300
日本カーボン	3,500	7,250.00	25,375,000
東洋炭素	4,300	3,270.00	14,061,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,900	7,030.00	27,417,000
TOTO	54,500	4,810.00	262,145,000
日本碍子	86,200	1,769.00	152,487,800
日本特殊陶業	59,700	3,215.00	191,935,500
MARUWA	2,500	7,000.00	17,500,000
品川リフラクトリーズ	2,400	4,525.00	10,860,000
黒崎播磨	1,600	8,690.00	13,904,000
ヨータイ	5,800	852.00	4,941,600
ニッカトー	3,900	1,258.00	4,906,200
フジインコーポレーテッド	6,300	2,850.00	17,955,000
ニチアス	39,000	1,471.00	57,369,000
ニチハ	10,700	2,976.00	31,843,200
新日鐵住金	314,200	2,271.50	713,705,300
神戸製鋼所	128,700	948.00	122,007,600
中山製鋼所	12,400	701.00	8,692,400
合同製鐵	4,600	2,315.00	10,649,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	189,500	2,469.00	467,875,500
日新製鋼	19,000	1,589.00	30,191,000
東京製鐵	37,300	849.00	31,667,700
共英製鋼	7,900	2,066.00	16,321,400
大和工業	14,900	3,215.00	47,903,500
東京鐵鋼	3,800	1,628.00	6,186,400
大阪製鐵	5,500	2,099.00	11,544,500
淀川製鋼所	9,800	2,657.00	26,038,600
丸一鋼管	24,900	3,415.00	85,033,500
モリ工業	2,800	3,020.00	8,456,000
大同特殊鋼	12,500	5,200.00	65,000,000
日本冶金工業	59,100	331.00	19,562,100
山陽特殊製鋼	8,200	2,545.00	20,869,000
愛知製鋼	3,900	4,170.00	16,263,000
日立金属	75,200	1,354.00	101,820,800
大平洋金属	4,500	3,700.00	16,650,000

新日本電工	50,400	283.00	14,263,200
栗本鐵工所	4,400	1,806.00	7,946,400
三菱製鋼	6,100	2,111.00	12,877,100
日本精線	1,600	4,075.00	6,520,000
シンニッタン	13,300	501.00	6,663,300
大紀アルミニウム工業所	13,800	742.00	10,239,600
日本軽金属ホールディングス	208,300	245.00	51,033,500
三井金属鉱業	19,300	3,035.00	58,575,500
東邦亜鉛	4,100	3,990.00	16,359,000
三菱マテリアル	46,300	3,210.00	148,623,000
住友金属鉱山	90,100	3,731.00	336,163,100
D O W A ホールディングス	17,800	3,395.00	60,431,000
古河機械金属	11,700	1,620.00	18,954,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,000	1,733.00	13,864,000
東邦チタニウム	13,300	1,258.00	16,731,400
U A C J	10,300	2,659.00	27,387,700
C K サンエツ	1,900	3,315.00	6,298,500
古河電気工業	23,400	3,690.00	86,346,000
住友電気工業	262,600	1,766.50	463,882,900
フジクラ	86,000	610.00	52,460,000
タツタ電線	16,000	590.00	9,440,000
平河ヒューテック	4,600	1,628.00	7,488,800
リョービ	8,700	4,265.00	37,105,500
アーレスティ	10,200	831.00	8,476,200
アサヒホールディングス	12,100	2,113.00	25,567,300
稲葉製作所	5,500	1,368.00	7,524,000
宮地エンジニアリンググループ	2,800	2,935.00	8,218,000
トーカロ	19,800	1,163.00	23,027,400
アルファC o	3,700	1,422.00	5,261,400
S U M C O	77,800	1,654.00	128,681,200
川田テクノロジーズ	1,600	6,120.00	9,792,000
R S Technologies	1,500	5,620.00	8,430,000
東洋製罐グループホールディングス	44,200	2,274.00	100,510,800
ホッカンホールディングス	24,000	448.00	10,752,000
コロナ	5,200	1,265.00	6,578,000
横河ブリッジホールディングス	13,100	2,431.00	31,846,100
駒井ハルテック	3,100	2,357.00	7,306,700
三和ホールディングス	67,400	1,391.00	93,753,400
文化シャッター	21,000	832.00	17,472,000
三協立山	9,800	1,382.00	13,543,600
アルインコ	7,900	1,060.00	8,374,000
L I X I L グループ	103,300	2,230.00	230,359,000

日本ファイルコン	8,700	572.00	4,976,400
ノーリツ	15,500	1,701.00	26,365,500
長府製作所	6,700	2,542.00	17,031,400
リンナイ	12,500	8,210.00	102,625,000
日東精工	12,500	694.00	8,675,000
岡部	14,700	1,050.00	15,435,000
ジーテクト	7,700	1,807.00	13,913,900
東プレ	12,600	2,772.00	34,927,200
高周波熱錬	14,300	1,076.00	15,386,800
東京製綱	5,900	1,462.00	8,625,800
パイオラックス	10,100	2,335.00	23,583,500
エイチワン	8,000	1,337.00	10,696,000
日本発條	69,700	1,181.00	82,315,700
三益半導体工業	6,100	1,686.00	10,284,600
日本製鋼所	23,200	2,681.00	62,199,200
三浦工業	30,500	3,360.00	102,480,000
タクマ	23,800	1,368.00	32,558,400
ツガミ	19,000	1,109.00	21,071,000
オークマ	8,200	5,970.00	48,954,000
東芝機械	40,000	503.00	20,120,000
アマダホールディングス	107,200	1,143.00	122,529,600
アイダエンジニアリング	17,900	965.00	17,273,500
滝澤鉄工所	3,700	1,703.00	6,301,100
F U J I	20,600	1,807.00	37,224,200
牧野フライス製作所	35,000	958.00	33,530,000
オーエスジー	34,500	2,530.00	87,285,000
旭ダイヤモンド工業	21,600	782.00	16,891,200
D M G 森精機	44,700	1,824.00	81,532,800
ソディック	15,500	1,005.00	15,577,500
ディスコ	9,500	19,320.00	183,540,000
日東工器	4,900	2,576.00	12,622,400
日進工具	2,300	2,939.00	6,759,700
パンチ工業	7,700	780.00	6,006,000
豊和工業	4,800	924.00	4,435,200
島精機製作所	8,900	4,955.00	44,099,500
オプトラン	6,900	3,025.00	20,872,500
フリュー	7,300	931.00	6,796,300
ヤマシンフィルタ	11,000	868.00	9,548,000
日阪製作所	11,700	1,122.00	13,127,400
やまびこ	13,700	1,327.00	18,179,900
平田機工	2,600	8,540.00	22,204,000
ペガサスミシン製造	7,700	1,005.00	7,738,500

ナブテスコ	38,800	2,848.00	110,502,400
三井海洋開発	7,600	3,470.00	26,372,000
レオン自動機	6,400	1,931.00	12,358,400
S M C	22,300	34,910.00	778,493,000
新川	7,100	569.00	4,039,900
ホソカワミクロン	2,600	6,150.00	15,990,000
ユニオンツール	3,400	3,975.00	13,515,000
オイレス工業	9,100	2,295.00	20,884,500
日精エー・エス・ビー機械	2,200	4,925.00	10,835,000
サトーホールディングス	9,300	3,620.00	33,666,000
技研製作所	5,200	2,788.00	14,497,600
日精樹脂工業	7,000	1,152.00	8,064,000
小松製作所	342,700	3,163.00	1,083,960,100
住友重機械工業	40,400	3,830.00	154,732,000
日立建機	33,100	3,390.00	112,209,000
日工	3,000	2,478.00	7,434,000
巴工業	4,100	2,187.00	8,966,700
井関農機	7,500	1,946.00	14,595,000
T O W A	6,800	1,002.00	6,813,600
北川鉄工所	4,000	2,879.00	11,516,000
ローツェ	3,800	2,167.00	8,234,600
クボタ	380,600	1,802.00	685,841,200
三菱化工機	3,400	1,813.00	6,164,200
月島機械	14,300	1,451.00	20,749,300
帝国電機製作所	6,100	1,678.00	10,235,800
新東工業	17,100	1,101.00	18,827,100
澁谷工業	6,200	4,250.00	26,350,000
アイチ コーポレーション	13,500	631.00	8,518,500
小森コーポレーション	17,600	1,371.00	24,129,600
鶴見製作所	6,400	1,824.00	11,673,600
住友精密工業	21,000	387.00	8,127,000
酒井重工業	1,800	3,400.00	6,120,000
荏原製作所	31,600	3,860.00	121,976,000
西島製作所	9,300	1,092.00	10,155,600
北越工業	8,900	1,272.00	11,320,800
ダイキン工業	96,900	15,125.00	1,465,612,500
オルガノ	3,100	3,315.00	10,276,500
トーヨーカネツ	3,200	2,964.00	9,484,800
栗田工業	38,400	3,170.00	121,728,000
椿本チエイン	41,000	1,017.00	41,697,000
大同工業	4,600	1,140.00	5,244,000
アネスト岩田	12,500	1,142.00	14,275,000

ダイフク	36,100	5,270.00	190,247,000
加藤製作所	3,700	3,420.00	12,654,000
タダノ	34,700	1,206.00	41,848,200
フジテック	21,500	1,437.00	30,895,500
C K D	19,800	1,352.00	26,769,600
キトー	6,000	1,977.00	11,862,000
平和	21,800	2,673.00	58,271,400
理想科学工業	6,900	2,635.00	18,181,500
S A N K Y O	17,700	4,410.00	78,057,000
日本金銭機械	7,900	1,265.00	9,993,500
マースエンジニアリング	5,200	2,300.00	11,960,000
福島工業	4,400	5,290.00	23,276,000
ダイコク電機	4,100	1,766.00	7,240,600
竹内製作所	11,700	2,909.00	34,035,300
アマノ	22,300	2,387.00	53,230,100
J U K I	11,200	1,297.00	14,526,400
サンデンホールディングス	9,300	1,518.00	14,117,400
蛇の目マシン工業	9,300	638.00	5,933,400
マックス	10,700	1,605.00	17,173,500
グローリー	21,400	2,736.00	58,550,400
新晃工業	7,800	1,723.00	13,439,400
大和冷機工業	11,500	1,232.00	14,168,000
セガサミーホールディングス	70,500	1,754.00	123,657,000
日本ピストンリング	3,800	2,300.00	8,740,000
リケン	3,300	6,100.00	20,130,000
T P R	7,800	2,764.00	21,559,200
ツバキ・ナカシマ	11,000	2,004.00	22,044,000
ホシザキ	20,700	11,200.00	231,840,000
大豊工業	6,400	1,236.00	7,910,400
日本精工	144,400	1,243.00	179,489,200
N T N	163,600	444.00	72,638,400
ジェイテクト	74,800	1,593.00	119,156,400
不二越	6,800	5,390.00	36,652,000
日本トムソン	23,000	740.00	17,020,000
T H K	44,400	2,787.00	123,742,800
ユースン精機	7,200	1,158.00	8,337,600
イーグル工業	8,700	1,467.00	12,762,900
日本ピラー工業	8,300	1,527.00	12,674,100
キッツ	29,000	951.00	27,579,000
マキタ	92,400	5,180.00	478,632,000
日立造船	55,600	455.00	25,298,000
三菱重工業	119,100	4,110.00	489,501,000

I H I	54,500	4,395.00	239,527,500
スター精密	11,400	1,945.00	22,173,000
日清紡ホールディングス	46,300	1,303.00	60,328,900
イビデン	43,700	1,536.00	67,123,200
コニカミノルタ	165,500	1,168.00	193,304,000
ブラザー工業	86,600	2,191.00	189,740,600
ミネベアミツミ	131,600	2,081.00	273,859,600
日立製作所	1,703,000	732.60	1,247,617,800
三菱電機	709,600	1,488.00	1,055,884,800
富士電機	214,000	913.00	195,382,000
東洋電機製造	4,000	1,577.00	6,308,000
安川電機	82,400	3,315.00	273,156,000
シンフォニアテクノロジー	47,000	364.00	17,108,000
明電舎	61,000	373.00	22,753,000
オリジン電気	3,000	1,720.00	5,160,000
山洋電気	3,500	5,400.00	18,900,000
デンヨー	7,400	1,775.00	13,135,000
東芝テック	51,000	688.00	35,088,000
芝浦メカトロニクス	14,000	383.00	5,362,000
マブチモーター	19,500	4,235.00	82,582,500
日本電産	85,400	16,015.00	1,367,681,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,800	2,060.00	7,828,000
東光高岳	4,500	1,734.00	7,803,000
ダブル・スコープ	12,900	939.00	12,113,100
宮越ホールディングス	5,100	1,016.00	5,181,600
ダイヘン	39,000	580.00	22,620,000
ヤーマン	10,300	2,233.00	22,999,900
J V C ケンウッド	56,000	316.00	17,696,000
ミマキエンジニアリング	7,500	1,128.00	8,460,000
第一精工	3,900	1,579.00	6,158,100
日新電機	16,900	992.00	16,764,800
大崎電気工業	17,600	868.00	15,276,800
オムロン	75,300	4,780.00	359,934,000
日東工業	11,400	1,959.00	22,332,600
I D E C	9,000	2,275.00	20,475,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	130,000	548.00	71,240,000
サクサホールディングス	2,500	2,151.00	5,377,500
メルコホールディングス	3,500	4,155.00	14,542,500
日本電気	91,400	3,015.00	275,571,000
富士通	730,000	799.70	583,781,000
沖電気工業	29,900	1,425.00	42,607,500
電気興業	4,500	3,330.00	14,985,000

サンケン電気	43,000	564.00	24,252,000
アイホン	5,200	1,651.00	8,585,200
ルネサスエレクトロニクス	72,600	757.00	54,958,200
セイコーエプソン	105,300	1,918.00	201,965,400
ワコム	57,000	488.00	27,816,000
アルバック	16,500	4,030.00	66,495,000
E I Z O	6,500	4,830.00	31,395,000
ジャパンディスプレイ	84,700	138.00	11,688,600
日本信号	19,700	1,133.00	22,320,100
京三製作所	19,000	609.00	11,571,000
能美防災	9,500	2,433.00	23,113,500
ホーチキ	5,600	1,607.00	8,999,200
エレコム	6,300	2,898.00	18,257,400
パナソニック	811,100	1,324.00	1,073,896,400
シャープ	70,600	2,374.00	167,604,400
アンリツ	52,000	1,851.00	96,252,000
富士通ゼネラル	22,300	1,888.00	42,102,400
ソニー	475,600	6,652.00	3,163,691,200
T D K	37,100	11,800.00	437,780,000
タムラ製作所	27,800	731.00	20,321,800
アルプス電気	60,600	3,070.00	186,042,000
日本トリム	1,900	5,820.00	11,058,000
ローランド ディー . ジー .	4,200	2,655.00	11,151,000
フォスター電機	8,800	1,408.00	12,390,400
クラリオン	44,000	321.00	14,124,000
S M K	21,000	314.00	6,594,000
ヨコオ	5,500	1,393.00	7,661,500
ホシデン	18,100	1,084.00	19,620,400
ヒロセ電機	11,600	12,520.00	145,232,000
日本航空電子工業	18,000	1,958.00	35,244,000
T O A	8,300	1,250.00	10,375,000
マクセルホールディングス	14,000	1,787.00	25,018,000
古野電気	10,500	1,445.00	15,172,500
ユニデンホールディングス	26,000	285.00	7,410,000
アルパイン	17,200	2,290.00	39,388,000
スミダコーポレーション	8,000	1,319.00	10,552,000
アイコム	4,600	2,449.00	11,265,400
リオン	3,700	2,299.00	8,506,300
本多通信工業	6,800	797.00	5,419,600
船井電機	10,100	675.00	6,817,500
横河電機	71,100	2,326.00	165,378,600
新電元工業	2,700	4,920.00	13,284,000

アズビル	21,400	4,710.00	100,794,000
東亜ディーケーケー	4,600	1,302.00	5,989,200
日本光電工業	29,500	3,410.00	100,595,000
チノー	3,900	1,525.00	5,947,500
共和電業	14,300	421.00	6,020,300
堀場製作所	14,200	6,250.00	88,750,000
アドバンテスト	40,000	2,368.00	94,720,000
エスベック	6,500	2,124.00	13,806,000
キーエンス	34,800	61,970.00	2,156,556,000
日置電機	3,900	3,445.00	13,435,500
シスメックス	55,300	9,800.00	541,940,000
日本マイクロニクス	12,500	773.00	9,662,500
メガチップス	6,000	2,212.00	13,272,000
O B A R A G R O U P	4,200	5,330.00	22,386,000
コーセル	10,900	1,221.00	13,308,900
イリソ電子工業	5,900	5,970.00	35,223,000
オブテックスグループ	12,600	2,259.00	28,463,400
千代田インテグレ	3,900	2,326.00	9,071,400
レーザーテック	14,500	3,805.00	55,172,500
スタンレー電気	54,100	3,760.00	203,416,000
岩崎電気	4,200	1,550.00	6,510,000
ウシオ電機	43,500	1,508.00	65,598,000
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	1,024.00	8,192,000
日本セラミック	7,500	2,934.00	22,005,000
古河電池	6,800	859.00	5,841,200
山一電機	6,600	1,577.00	10,408,200
図研	5,500	1,814.00	9,977,000
日本電子	26,000	1,226.00	31,876,000
カシオ計算機	57,200	1,870.00	106,964,000
ファナック	67,500	21,775.00	1,469,812,500
日本シイエムケイ	13,800	804.00	11,095,200
エンプラス	3,600	3,075.00	11,070,000
ローム	31,800	7,950.00	252,810,000
浜松ホトニクス	50,800	4,200.00	213,360,000
三井ハイテック	9,700	1,524.00	14,782,800
新光電気工業	26,500	910.00	24,115,000
京セラ	116,600	6,449.00	751,953,400
太陽誘電	34,500	2,722.00	93,909,000
村田製作所	74,500	17,435.00	1,298,907,500
ユーシン	14,300	760.00	10,868,000
双葉電子工業	11,500	2,026.00	23,299,000
ニチコン	22,900	1,097.00	25,121,300

日本ケミコン	6,000	3,110.00	18,660,000	
K O A	10,100	1,966.00	19,856,600	
市光工業	13,100	898.00	11,763,800	
小糸製作所	42,300	7,050.00	298,215,000	
ミツバ	14,000	940.00	13,160,000	
S C R E E Nホールディングス	13,500	7,090.00	95,715,000	
キャノン電子	6,500	2,308.00	15,002,000	
キャノン	381,800	3,535.00	1,349,663,000	
リコー	213,100	1,197.00	255,080,700	
象印マホービン	13,600	1,632.00	22,195,200	
東京エレクトロン	47,300	16,240.00	768,152,000	
トヨタ紡織	20,600	1,996.00	41,117,600	
芦森工業	2,100	2,182.00	4,582,200	
ユニプレス	14,600	2,122.00	30,981,200	
豊田自動織機	57,400	6,410.00	367,934,000	
モリタホールディングス	11,500	2,309.00	26,553,500	
三櫻工業	11,700	695.00	8,131,500	
デンソー	157,200	5,640.00	886,608,000	
東海理化電機製作所	18,900	2,372.00	44,830,800	
三井E & Sホールディングス	26,300	1,964.00	51,653,200	
川崎重工業	55,100	3,085.00	169,983,500	
名村造船所	23,500	531.00	12,478,500	
日本車輛製造	31,000	295.00	9,145,000	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,280.00	11,776,000	
日産自動車	836,900	1,074.00	898,830,600	
いすゞ自動車	206,300	1,701.50	351,019,450	
トヨタ自動車	862,900	6,960.00	6,005,784,000	代用有価証券 400,000株
日野自動車	101,200	1,186.00	120,023,200	
三菱自動車工業	262,500	774.00	203,175,000	
エフテック	6,500	1,213.00	7,884,500	
武蔵精密工業	7,600	3,670.00	27,892,000	
日産車体	28,400	1,058.00	30,047,200	
新明和工業	30,800	1,371.00	42,226,800	
極東開発工業	13,400	1,715.00	22,981,000	
日信工業	14,400	1,819.00	26,193,600	
トピー工業	6,000	3,120.00	18,720,000	
ティラド	3,200	2,914.00	9,324,800	
タチエス	12,200	1,766.00	21,545,200	
N O K	38,200	1,965.00	75,063,000	
フタバ産業	22,400	727.00	16,284,800	
K Y B	7,500	4,420.00	33,150,000	
大同メタル工業	10,900	931.00	10,147,900	

プレス工業	38,000	570.00	21,660,000
ミクニ	11,700	718.00	8,400,600
太平洋工業	15,000	1,851.00	27,765,000
ケーヒン	16,100	2,316.00	37,287,600
河西工業	9,500	1,175.00	11,162,500
アイシン精機	58,200	5,240.00	304,968,000
マツダ	223,500	1,310.00	292,785,000
今仙電機製作所	8,800	1,145.00	10,076,000
本田技研工業	638,400	3,284.00	2,096,505,600
スズキ	140,700	7,100.00	998,970,000
S U B A R U	220,200	3,231.00	711,466,200
安永	3,700	1,959.00	7,248,300
ヤマハ発動機	99,800	2,838.00	283,232,400
ショーワ	18,400	1,637.00	30,120,800
T B K	14,300	494.00	7,064,200
エクセディ	8,200	3,615.00	29,643,000
豊田合成	26,100	2,761.00	72,062,100
愛三工業	14,100	937.00	13,211,700
ヨロズ	7,700	1,676.00	12,905,200
エフ・シー・シー	11,500	3,315.00	38,122,500
シマノ	28,600	18,460.00	527,956,000
テイ・エス テック	16,700	3,860.00	64,462,000
ジャムコ	4,000	3,060.00	12,240,000
テルモ	108,500	6,620.00	718,270,000
日機装	22,800	1,307.00	29,799,600
島津製作所	84,400	3,275.00	276,410,000
J M S	10,500	617.00	6,478,500
長野計器	6,900	1,134.00	7,824,600
ブイ・テクノロジー	1,700	17,170.00	29,189,000
東京計器	5,700	1,132.00	6,452,400
インターアクション	4,400	1,825.00	8,030,000
東京精密	12,700	2,865.00	36,385,500
マニー	8,600	5,030.00	43,258,000
ニコン	123,200	2,132.00	262,662,400
トプコン	38,300	1,859.00	71,199,700
オリンパス	105,400	4,365.00	460,071,000
理研計器	6,800	2,372.00	16,129,600
タムロン	6,300	2,313.00	14,571,900
H O Y A	142,900	6,642.00	949,141,800
シード	3,200	2,085.00	6,672,000
ノーリツ鋼機	7,300	2,758.00	20,133,400
エー・アンド・デイ	7,500	898.00	6,735,000

シチズン時計	85,000	739.00	62,815,000
リズム時計工業	3,700	2,006.00	7,422,200
大研医器	10,200	830.00	8,466,000
メニコン	9,500	2,604.00	24,738,000
松風	5,200	1,337.00	6,952,400
セイコーホールディングス	10,800	3,085.00	33,318,000
ニプロ	49,500	1,551.00	76,774,500
スノーピーク	3,000	1,684.00	5,052,000
パラマウントベッドホールディングス	7,400	5,140.00	38,036,000
トランザクション	5,300	740.00	3,922,000
ニホンフラッシュ	3,700	2,231.00	8,254,700
前田工織	8,100	2,153.00	17,439,300
永大産業	14,700	502.00	7,379,400
アートネイチャー	11,000	701.00	7,711,000
バンダイナムコホールディングス	73,300	4,465.00	327,284,500
SHO E I	3,500	4,870.00	17,045,000
フランスベッドホールディングス	10,700	960.00	10,272,000
パイロットコーポレーション	12,500	6,300.00	78,750,000
萩原工業	5,000	1,765.00	8,825,000
トッパン・フォームズ	14,500	1,086.00	15,747,000
フジシールインターナショナル	15,800	3,925.00	62,015,000
タカラトミー	30,000	1,121.00	33,630,000
アーク	44,600	109.00	4,861,400
プロネクサス	7,900	1,159.00	9,156,100
大建工業	5,600	2,217.00	12,415,200
凸版印刷	200,000	900.00	180,000,000
大日本印刷	92,400	2,617.00	241,810,800
図書印刷	5,700	805.00	4,588,500
共同印刷	3,000	2,838.00	8,514,000
N I S S H A	14,700	2,108.00	30,987,600
宝印刷	5,000	1,840.00	9,200,000
アシックス	70,300	1,633.00	114,799,900
小松ウオール工業	3,300	2,155.00	7,111,500
ヤマハ	46,300	5,900.00	273,170,000
河合楽器製作所	2,700	4,535.00	12,244,500
クリナップ	8,600	783.00	6,733,800
ピジョン	43,000	6,030.00	259,290,000
キングジム	8,400	975.00	8,190,000
リンテック	17,000	2,831.00	48,127,000
イトーキ	17,300	596.00	10,310,800
任天堂	43,700	39,050.00	1,706,485,000
三菱鉛筆	11,500	1,951.00	22,436,500

タカラスタANDARD	14,000	1,954.00	27,356,000
コクヨ	34,100	1,981.00	67,552,100
ナカバヤシ	9,900	661.00	6,543,900
グローブライド	3,500	3,155.00	11,042,500
オカムラ	24,600	1,484.00	36,506,400
美津濃	7,000	2,837.00	19,859,000
東京電力ホールディングス	564,600	533.00	300,931,800
中部電力	217,200	1,704.50	370,217,400
関西電力	289,700	1,668.50	483,364,450
中国電力	97,600	1,453.00	141,812,800
北陸電力	70,100	1,181.00	82,788,100
東北電力	164,800	1,503.00	247,694,400
四国電力	64,000	1,534.00	98,176,000
九州電力	155,800	1,304.00	203,163,200
北海道電力	72,100	724.00	52,200,400
沖縄電力	14,300	2,355.00	33,676,500
電源開発	56,300	3,010.00	169,463,000
エフオン	5,200	1,197.00	6,224,400
イーレックス	12,400	993.00	12,313,200
レノバ	8,400	1,309.00	10,995,600
東京瓦斯	150,100	2,754.00	413,375,400
大阪瓦斯	137,700	2,164.00	297,982,800
東邦瓦斯	35,100	4,035.00	141,628,500
広島ガス	22,600	369.00	8,339,400
西部瓦斯	8,800	2,626.00	23,108,800
静岡ガス	21,600	946.00	20,433,600
メタウォーター	4,400	3,045.00	13,398,000
SBSホールディングス	8,300	1,511.00	12,541,300
東武鉄道	74,500	3,365.00	250,692,500
相鉄ホールディングス	22,900	3,670.00	84,043,000
東京急行電鉄	192,400	2,018.00	388,263,200
京浜急行電鉄	97,300	2,005.00	195,086,500
小田急電鉄	105,300	2,705.00	284,836,500
京王電鉄	39,400	6,210.00	244,674,000
京成電鉄	49,200	3,895.00	191,634,000
富士急行	9,900	3,490.00	34,551,000
東日本旅客鉄道	126,200	10,455.00	1,319,421,000
西日本旅客鉄道	64,200	7,788.00	499,989,600
東海旅客鉄道	63,600	22,930.00	1,458,348,000
西武ホールディングス	90,500	2,059.00	186,339,500
鴻池運輸	9,700	1,900.00	18,430,000
西日本鉄道	19,900	3,060.00	60,894,000

ハマキョウレックス	5,100	3,960.00	20,196,000
サカイ引越センター	3,700	6,480.00	23,976,000
近鉄グループホールディングス	67,300	4,475.00	301,167,500
阪急阪神ホールディングス	89,500	4,015.00	359,342,500
南海電気鉄道	32,200	2,932.00	94,410,400
京阪ホールディングス	29,900	4,225.00	126,327,500
神戸電鉄	2,200	3,970.00	8,734,000
名古屋鉄道	53,600	2,667.00	142,951,200
山陽電気鉄道	5,800	2,556.00	14,824,800
日本通運	26,300	7,430.00	195,409,000
ヤマトホールディングス	118,100	3,307.00	390,556,700
山九	17,200	6,000.00	103,200,000
丸全昭和運輸	28,000	552.00	15,456,000
センコーグループホールディングス	40,300	920.00	37,076,000
トナミホールディングス	1,800	6,750.00	12,150,000
ニッコンホールディングス	25,800	2,930.00	75,594,000
福山通運	9,800	4,910.00	48,118,000
セイノーホールディングス	50,300	1,675.00	84,252,500
神奈川中央交通	2,400	3,770.00	9,048,000
日立物流	14,500	3,150.00	45,675,000
丸和運輸機関	3,600	3,950.00	14,220,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,322.00	11,369,200
九州旅客鉄道	56,400	3,430.00	193,452,000
S Gホールディングス	63,500	2,799.00	177,736,500
日本郵船	56,000	2,102.00	117,712,000
商船三井	42,200	3,180.00	134,196,000
川崎汽船	31,300	2,260.00	70,738,000
N S ユナイテッド海運	3,800	2,421.00	9,199,800
飯野海運	36,300	584.00	21,199,200
乾汽船	7,500	928.00	6,960,000
日本航空	123,300	4,145.00	511,078,500
A N Aホールディングス	130,800	3,980.00	520,584,000
トランコム	1,800	7,610.00	13,698,000
日新	5,700	2,357.00	13,434,900
三菱倉庫	23,300	2,779.00	64,750,700
三井倉庫ホールディングス	42,000	393.00	16,506,000
住友倉庫	47,000	766.00	36,002,000
澁澤倉庫	5,200	1,686.00	8,767,200
東陽倉庫	21,200	339.00	7,186,800
日本トランスシティ	20,000	507.00	10,140,000
川西倉庫	2,600	1,625.00	4,225,000
安田倉庫	8,700	916.00	7,969,200

東洋埠頭	3,800	1,681.00	6,387,800
上組	42,200	2,410.00	101,702,000
キューソー流通システム	2,400	2,818.00	6,763,200
近鉄エクスプレス	12,400	2,179.00	27,019,600
エーアイテイー	6,300	1,009.00	6,356,700
NEC ネットエスアイ	7,700	2,516.00	19,373,200
システナ	22,400	1,500.00	33,600,000
デジタルアーツ	3,600	5,140.00	18,504,000
新日鉄住金ソリューションズ	10,400	3,595.00	37,388,000
キューブシステム	6,900	947.00	6,534,300
コア	4,400	1,349.00	5,935,600
ソフトクリエイティブホールディングス	5,000	1,721.00	8,605,000
T I S	23,300	5,790.00	134,907,000
電算システム	4,100	2,168.00	8,888,800
グリー	37,500	550.00	20,625,000
コーエーテクモホールディングス	12,100	2,248.00	27,200,800
三菱総合研究所	3,000	4,140.00	12,420,000
ファインデックス	8,100	758.00	6,139,800
ブレインパッド	1,800	4,520.00	8,136,000
K L a b	13,100	984.00	12,890,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,600	3,050.00	17,080,000
ネクソン	177,100	1,346.00	238,376,600
アイスタイル	18,000	1,264.00	22,752,000
エムアップ	3,000	3,030.00	9,090,000
エイチーム	5,100	1,898.00	9,679,800
テクノスジャパン	7,700	987.00	7,599,900
コロプラ	21,000	716.00	15,036,000
ブロードリーフ	35,900	671.00	24,088,900
デジタルハーツホールディングス	4,800	1,569.00	7,531,200
メディアドゥホールディングス	2,800	2,465.00	6,902,000
フィックスターズ	7,200	1,555.00	11,196,000
VOYAGE GROUP	4,800	1,547.00	7,425,600
オブティム	1,700	4,520.00	7,684,000
セレス	2,900	1,716.00	4,976,400
ティーガイア	7,000	2,981.00	20,867,000
日本アジアグループ	12,300	418.00	5,141,400
豆蔵ホールディングス	7,600	923.00	7,014,800
テクマトリックス	4,500	2,048.00	9,216,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	172,700	219.00	37,821,300
GMO ペイメントゲートウェイ	5,800	13,510.00	78,358,000
インターネットイニシアティブ	11,700	2,249.00	26,313,300
さくらインターネット	10,500	686.00	7,203,000

GMOクラウド	2,200	3,670.00	8,074,000
SRAホールディングス	4,100	3,410.00	13,981,000
アドソル日進	3,200	1,834.00	5,868,800
フリービット	5,800	1,094.00	6,345,200
コムチュア	3,800	4,115.00	15,637,000
インフォテリア	4,000	1,006.00	4,024,000
メディカル・データ・ビジョン	7,400	1,776.00	13,142,400
gumi	9,500	619.00	5,880,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,200	1,517.00	6,371,400
PCIホールディングス	1,800	2,855.00	5,139,000
アイビーシー	2,500	1,820.00	4,550,000
ネオジャパン	2,600	1,121.00	2,914,600
オープンドア	3,300	3,445.00	11,368,500
アカツキ	2,200	3,415.00	7,513,000
LINE	21,400	4,775.00	102,185,000
オークネット	4,900	1,244.00	6,095,600
AOI TYO Holdings	8,300	1,461.00	12,126,300
マクロミル	9,000	2,429.00	21,861,000
ソルクシーズ	4,100	928.00	3,804,800
フェイス	4,500	1,201.00	5,404,500
野村総合研究所	44,300	5,670.00	251,181,000
サイバネットシステム	7,600	822.00	6,247,200
インテージホールディングス	9,900	965.00	9,553,500
ソースネクスト	11,200	978.00	10,953,600
フォーカスシステムズ	5,600	986.00	5,521,600
クレスコ	2,000	3,160.00	6,320,000
フジ・メディア・ホールディングス	72,600	1,919.00	139,319,400
オービック	22,000	10,670.00	234,740,000
ジャストシステム	11,500	2,357.00	27,105,500
TDCソフト	4,300	2,031.00	8,733,300
ヤフー	503,200	392.00	197,254,400
トレンドマイクロ	37,200	7,050.00	262,260,000
日本オラクル	11,300	9,350.00	105,655,000
アルファシステムズ	3,400	2,847.00	9,679,800
フューチャー	10,200	1,825.00	18,615,000
CAC Holdings	8,100	1,092.00	8,845,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,900	2,603.00	10,151,700
オービックビジネスコンサルタント	3,600	9,580.00	34,488,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,800	2,541.00	80,803,800
アイティフォー	10,100	926.00	9,352,600
大塚商会	37,800	4,070.00	153,846,000
サイボウズ	14,200	647.00	9,187,400

電通国際情報サービス	4,600	4,070.00	18,722,000
デジタルガレージ	12,800	3,535.00	45,248,000
E Mシステムズ	6,800	1,204.00	8,187,200
ウェザーニューズ	3,300	3,350.00	11,055,000
WOWOW	3,700	3,560.00	13,172,000
スカラ	7,400	1,131.00	8,369,400
イマジカ・ロボット ホールディングス	8,800	641.00	5,640,800
ネットワンシステムズ	28,500	2,653.00	75,610,500
アルゴグラフィックス	3,800	4,770.00	18,126,000
マーベラス	13,700	890.00	12,193,000
エイベックス	13,600	1,514.00	20,590,400
日本ユニシス	19,400	2,844.00	55,173,600
兼松エレクトロニクス	4,500	3,630.00	16,335,000
東京放送ホールディングス	38,800	2,292.00	88,929,600
日本テレビホールディングス	64,000	1,892.00	121,088,000
朝日放送グループホールディングス	9,700	813.00	7,886,100
テレビ朝日ホールディングス	19,600	2,121.00	41,571,600
スカパーJ S A Tホールディングス	53,900	549.00	29,591,100
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,759.00	16,002,200
ビジョン	2,500	4,930.00	12,325,000
ワイヤレスゲート	4,800	652.00	3,129,600
コネクシオ	5,400	2,065.00	11,151,000
日本電信電話	499,900	5,148.00	2,573,485,200
K D D I	613,900	3,105.00	1,906,159,500
光通信	8,400	21,430.00	180,012,000
N T T ドコモ	500,000	3,026.00	1,513,000,000
エムティーアイ	10,200	638.00	6,507,600
G M O インターネット	25,700	1,808.00	46,465,600
カドカワ	20,500	1,188.00	24,354,000
学研ホールディングス	2,700	5,780.00	15,606,000
ゼンリン	12,800	3,405.00	43,584,000
アイネット	5,600	1,950.00	10,920,000
松竹	4,800	13,990.00	67,152,000
東宝	45,900	3,520.00	161,568,000
東映	2,600	12,820.00	33,332,000
エヌ・ティ・ティ・データ	215,700	1,551.00	334,550,700
D T S	7,100	4,400.00	31,240,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,500	4,580.00	148,850,000
シーイーシー	8,400	2,500.00	21,000,000
カプコン	30,200	2,787.00	84,167,400
ジャステック	5,800	1,160.00	6,728,000
S C S K	16,200	5,410.00	87,642,000

日本システムウエア	2,800	1,898.00	5,314,400
アイネス	11,300	1,301.00	14,701,300
T K C	5,900	4,440.00	26,196,000
富士ソフト	10,400	5,600.00	58,240,000
N S D	11,600	2,331.00	27,039,600
コナミホールディングス	28,600	4,300.00	122,980,000
福井コンピュータホールディングス	2,700	2,111.00	5,699,700
J B C Cホールディングス	8,000	1,355.00	10,840,000
ミロク情報サービス	6,400	2,382.00	15,244,800
ソフトバンクグループ	315,500	10,710.00	3,379,005,000
伊藤忠食品	1,900	5,960.00	11,324,000
エレマテック	3,800	2,464.00	9,363,200
J A L U X	2,600	2,795.00	7,267,000
あらた	3,600	5,530.00	19,908,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,959.00	7,444,200
フィールズ	6,700	931.00	6,237,700
双日	412,800	400.00	165,120,000
アルフレッサ ホールディングス	77,400	2,838.00	219,661,200
横浜冷凍	20,100	912.00	18,331,200
アルコニックス	8,200	1,529.00	12,537,800
神戸物産	5,200	5,350.00	27,820,000
ペッパーフードサービス	5,600	3,930.00	22,008,000
あい ホールディングス	11,400	2,490.00	28,386,000
ダイワボウホールディングス	5,900	7,120.00	42,008,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,100	1,977.00	25,898,700
ラクト・ジャパン	1,600	7,590.00	12,144,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,300	1,278.00	16,997,400
U K Cホールディングス	5,300	2,663.00	14,113,900
ジュテックホールディングス	2,800	1,006.00	2,816,800
T O K A Iホールディングス	37,100	1,099.00	40,772,900
三洋貿易	4,400	2,103.00	9,253,200
ウイン・パートナーズ	5,800	1,272.00	7,377,600
シップヘルスケアホールディングス	14,600	4,090.00	59,714,000
コメダホールディングス	13,500	2,227.00	30,064,500
小野建	7,200	1,749.00	12,592,800
佐島電機	7,300	960.00	7,008,000
伯東	5,300	1,553.00	8,230,900
コンドーテック	8,000	1,088.00	8,704,000
ナガイレーベン	10,600	2,603.00	27,591,800
三菱食品	7,200	2,961.00	21,319,200
松田産業	6,000	1,542.00	9,252,000
第一興商	10,600	5,230.00	55,438,000

メディバルホールディングス	69,900	2,281.00	159,441,900
萩原電気ホールディングス	3,100	3,265.00	10,121,500
アズワン	5,500	8,490.00	46,695,000
尾家産業	3,900	1,367.00	5,331,300
シモジマ	6,000	1,050.00	6,300,000
ドウシシャ	7,400	2,243.00	16,598,200
高速	5,900	1,234.00	7,280,600
丸文	9,000	840.00	7,560,000
ハピネット	5,400	1,855.00	10,017,000
日本ライフライン	19,900	2,160.00	42,984,000
エクセル	3,200	1,832.00	5,862,400
マルカキカイ	3,700	2,053.00	7,596,100
I D O M	23,000	370.00	8,510,000
日本エム・ディ・エム	6,000	1,116.00	6,696,000
進和	5,100	2,090.00	10,659,000
ダイترون	3,800	2,169.00	8,242,200
シークス	9,000	1,972.00	17,748,000
オーハシテクニカ	5,300	1,579.00	8,368,700
白銅	3,800	1,924.00	7,311,200
伊藤忠商事	513,000	2,031.00	1,041,903,000
丸紅	575,500	976.70	562,090,850
長瀬産業	42,400	1,894.00	80,305,600
蝶理	5,400	2,000.00	10,800,000
豊田通商	77,400	3,970.00	307,278,000
三共生興	16,800	472.00	7,929,600
兼松	29,100	1,685.00	49,033,500
三井物産	576,000	1,942.00	1,118,592,000
日本紙パルプ商事	3,800	4,415.00	16,777,000
日立ハイテクノロジーズ	24,400	3,865.00	94,306,000
カメイ	9,200	1,408.00	12,953,600
スターゼン	3,000	4,620.00	13,860,000
山善	26,700	1,330.00	35,511,000
椿本興業	2,200	3,230.00	7,106,000
住友商事	441,300	1,856.00	819,052,800
内田洋行	3,700	2,948.00	10,907,600
三菱商事	490,600	3,364.00	1,650,378,400
第一実業	3,900	3,790.00	14,781,000
キャノンマーケティングジャパン	20,300	2,299.00	46,669,700
西華産業	5,000	1,960.00	9,800,000
佐藤商事	7,100	1,165.00	8,271,500
菱洋エレクトロ	7,300	1,748.00	12,760,400
東京産業	11,500	746.00	8,579,000

ユアサ商事	6,500	3,965.00	25,772,500
神鋼商事	2,000	3,115.00	6,230,000
阪和興業	13,300	3,655.00	48,611,500
正栄食品工業	3,800	3,415.00	12,977,000
カナデン	8,400	1,178.00	9,895,200
菱電商事	6,700	1,661.00	11,128,700
フルサト工業	5,200	1,806.00	9,391,200
岩谷産業	15,900	3,985.00	63,361,500
極東貿易	14,000	400.00	5,600,000
イワキ	14,000	502.00	7,028,000
三愛石油	18,400	1,389.00	25,557,600
稲畑産業	16,200	1,668.00	27,021,600
ワキタ	15,700	1,377.00	21,618,900
東邦ホールディングス	20,900	2,962.00	61,905,800
サンゲツ	23,200	2,195.00	50,924,000
ミツウロコグループホールディングス	11,900	831.00	9,888,900
シナネンホールディングス	3,700	2,779.00	10,282,300
伊藤忠エネクス	15,000	1,136.00	17,040,000
サンリオ	20,500	2,245.00	46,022,500
サンワテクノス	5,700	1,389.00	7,917,300
リョーサン	8,000	4,230.00	33,840,000
新光商事	8,200	1,676.00	13,743,200
トーヨー	4,100	2,073.00	8,499,300
三信電気	6,900	1,956.00	13,496,400
東陽テクニカ	11,000	909.00	9,999,000
モスフードサービス	9,200	2,901.00	26,689,200
加賀電子	6,400	2,304.00	14,745,600
ソーダニッカ	11,900	612.00	7,282,800
立花エレテック	5,500	1,865.00	10,257,500
PALTAC	9,600	5,990.00	57,504,000
太平洋興発	5,400	1,007.00	5,437,800
西本Wismettacホールディングス	2,000	5,110.00	10,220,000
ヤマタネ	4,700	1,989.00	9,348,300
日鉄住金物産	5,200	5,570.00	28,964,000
泉州電業	2,800	2,921.00	8,178,800
トラスコ中山	14,300	2,978.00	42,585,400
オートバックスセブン	28,400	1,917.00	54,442,800
モリト	7,900	870.00	6,873,000
加藤産業	10,700	3,635.00	38,894,500
イノテック	7,100	1,312.00	9,315,200
イエローハット	6,700	2,973.00	19,919,100
JKホールディングス	10,000	787.00	7,870,000

日伝	6,600	2,023.00	13,351,800
杉本商事	5,000	1,870.00	9,350,000
因幡電機産業	9,000	4,725.00	42,525,000
バイテックホールディングス	3,900	2,584.00	10,077,600
ミスミグループ本社	81,300	2,917.00	237,152,100
タキヒヨー	3,400	2,166.00	7,364,400
スズケン	31,800	5,120.00	162,816,000
ジェコス	6,500	1,169.00	7,598,500
ローソン	17,700	6,830.00	120,891,000
サンエー	5,100	5,280.00	26,928,000
カワチ薬品	5,900	2,198.00	12,968,200
エービーシー・マート	12,700	6,190.00	78,613,000
アスクル	6,100	3,350.00	20,435,000
ゲオホールディングス	12,900	1,606.00	20,717,400
アダストリア	11,200	1,478.00	16,553,600
くらコーポレーション	4,100	7,490.00	30,709,000
キャンドウ	5,200	1,706.00	8,871,200
パルグループホールディングス	4,000	2,569.00	10,276,000
エディオン	26,800	1,262.00	33,821,600
サーラコーポレーション	16,200	666.00	10,789,200
ハローズ	3,200	2,696.00	8,627,200
あみやき亭	1,900	4,350.00	8,265,000
ひらまつ	15,500	449.00	6,959,500
大黒天物産	2,000	4,365.00	8,730,000
ハニーズホールディングス	9,100	1,036.00	9,427,600
アルペン	5,900	1,976.00	11,658,400
クオール	7,800	2,349.00	18,322,200
ジーンズ	4,900	5,430.00	26,607,000
ビックカメラ	37,000	1,495.00	55,315,000
D C Mホールディングス	36,600	1,030.00	37,698,000
Monotaro	22,200	6,050.00	134,310,000
DDホールディングス	1,900	2,536.00	4,818,400
アークランドサービスホールディングス	6,300	2,019.00	12,719,700
J.フロント リテイリング	83,400	1,621.00	135,191,400
ドトール・日レスホールディングス	12,000	2,101.00	25,212,000
マツモトキヨシホールディングス	28,900	4,355.00	125,859,500
ブロンコビリー	3,900	3,485.00	13,591,500
スタートトゥデイ	68,900	3,200.00	220,480,000
物語コーポレーション	2,000	10,180.00	20,360,000
ココカラファイン	7,300	7,150.00	52,195,000
三越伊勢丹ホールディングス	130,300	1,347.00	175,514,100
ウエルシアホールディングス	18,400	5,890.00	108,376,000

クリエイトSDホールディングス	10,000	2,752.00	27,520,000
チムニー	2,700	2,970.00	8,019,000
シュッピン	4,800	1,431.00	6,868,800
ネクステージ	14,000	775.00	10,850,000
ジョイフル本田	20,400	1,734.00	35,373,600
鳥貴族	3,100	2,198.00	6,813,800
キリン堂ホールディングス	2,800	1,788.00	5,006,400
ホットランド	5,300	1,312.00	6,953,600
すかいらーくホールディングス	65,600	1,653.00	108,436,800
綿半ホールディングス	3,000	2,847.00	8,541,000
ヨシックス	1,300	2,878.00	3,741,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	21,800	1,361.00	29,669,800
あさひ	6,500	1,486.00	9,659,000
日本調剤	2,900	3,430.00	9,947,000
コスモス薬品	3,500	24,900.00	87,150,000
セブン&アイ・ホールディングス	293,100	5,000.00	1,465,500,000
薬王堂	3,300	3,795.00	12,523,500
クリエイト・レストランツ・ホールディング	18,800	1,333.00	25,060,400
ツルハホールディングス	15,200	13,580.00	206,416,000
サンマルクホールディングス	4,900	2,658.00	13,024,200
トリドールホールディングス	8,700	2,474.00	21,523,800
TOKYO BASE	6,800	601.00	4,086,800
パロックジャパンリミテッド	7,200	1,037.00	7,466,400
クスリのアオキホールディングス	5,500	8,240.00	45,320,000
スシローグローバルホールディングス	7,700	6,920.00	53,284,000
LIXILビバ	9,100	1,765.00	16,061,500
メディカルシステムネットワーク	11,000	451.00	4,961,000
総合メディカル	6,300	2,358.00	14,855,400
ノジマ	12,100	2,431.00	29,415,100
カッパ・クリエイト	10,200	1,407.00	14,351,400
ライトオン	8,300	1,011.00	8,391,300
良品計画	9,300	33,000.00	306,900,000
アドヴァン	9,200	990.00	9,108,000
アルビス	2,600	3,055.00	7,943,000
コナカ	14,700	516.00	7,585,200
G-7ホールディングス	2,600	2,692.00	6,999,200
コジマ	13,700	512.00	7,014,400
コーナン商事	9,800	2,670.00	26,166,000
エコス	4,100	1,641.00	6,728,100
ワタミ	10,000	1,324.00	13,240,000
ドンキホーテホールディングス	45,300	5,520.00	250,056,000
西松屋チェーン	15,500	1,178.00	18,259,000

ゼンショーホールディングス	36,800	2,291.00	84,308,800
幸楽苑ホールディングス	6,100	1,622.00	9,894,200
サイゼリヤ	11,300	2,201.00	24,871,300
V Tホールディングス	26,000	487.00	12,662,000
ユナイテッドアローズ	8,700	4,380.00	38,106,000
ハイデイ日高	9,100	2,265.00	20,611,500
コロワイド	23,100	3,090.00	71,379,000
ピーシーデポコーポレーション	11,900	516.00	6,140,400
巻番屋	4,900	4,490.00	22,001,000
スギホールディングス	15,400	5,420.00	83,468,000
ヴィア・ホールディングス	11,800	741.00	8,743,800
スクロール	14,000	678.00	9,492,000
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,347.00	17,133,100
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22,300	10,920.00	243,516,000
木曽路	8,800	2,693.00	23,698,400
S R Sホールディングス	11,200	1,041.00	11,659,200
千趣会	15,300	431.00	6,594,300
ケーヨー	17,000	538.00	9,146,000
上新電機	8,200	2,998.00	24,583,600
日本瓦斯	12,800	5,920.00	75,776,000
ロイヤルホールディングス	12,300	2,828.00	34,784,400
いなげや	9,000	1,705.00	15,345,000
島忠	15,900	3,690.00	58,671,000
チヨダ	8,100	2,165.00	17,536,500
ライフコーポレーション	5,000	2,726.00	13,630,000
リンガーハット	9,200	2,438.00	22,429,600
Mr Max HD	10,500	606.00	6,363,000
A O K Iホールディングス	13,500	1,539.00	20,776,500
オークワ	11,000	1,098.00	12,078,000
コメリ	11,400	2,650.00	30,210,000
青山商事	13,600	3,410.00	46,376,000
しまむら	8,100	10,160.00	82,296,000
高島屋	54,900	1,832.00	100,576,800
松屋	14,600	1,176.00	17,169,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,200	1,769.00	58,730,800
近鉄百貨店	3,000	3,690.00	11,070,000
パルコ	7,700	1,239.00	9,540,300
丸井グループ	64,000	2,677.00	171,328,000
アクシアル リテイリング	5,600	3,995.00	22,372,000
イオン	269,100	2,648.00	712,576,800
イズミ	12,700	7,340.00	93,218,000
平和堂	13,700	2,983.00	40,867,100

フジ	8,500	2,233.00	18,980,500
ヤオコー	7,700	6,740.00	51,898,000
ゼビオホールディングス	9,100	1,617.00	14,714,700
ケーズホールディングス	61,700	1,360.00	83,912,000
Olympicグループ	7,000	937.00	6,559,000
日産東京販売ホールディングス	17,100	344.00	5,882,400
Genky DrugStores	3,300	4,245.00	14,008,500
アインホールディングス	9,400	8,470.00	79,618,000
元気寿司	2,400	6,460.00	15,504,000
ヤマダ電機	240,700	556.00	133,829,200
アークランドサカモト	11,800	1,465.00	17,287,000
ニトリホールディングス	27,800	16,770.00	466,206,000
グルメ杵屋	7,000	1,222.00	8,554,000
吉野家ホールディングス	24,100	1,910.00	46,031,000
松屋フーズ	3,800	3,570.00	13,566,000
サガミチェーン	11,600	1,418.00	16,448,800
関西スーパーマーケット	6,900	1,199.00	8,273,100
王将フードサービス	5,100	7,650.00	39,015,000
プレナス	7,700	1,896.00	14,599,200
ミニストップ	5,700	2,128.00	12,129,600
アークス	12,700	2,857.00	36,283,900
パローホールディングス	16,600	2,487.00	41,284,200
ベルク	3,000	6,070.00	18,210,000
大庄	5,600	1,721.00	9,637,600
ファーストリテイリング	9,400	57,660.00	542,004,000
サンドラッグ	26,300	3,905.00	102,701,500
サックスパー ホールディングス	8,400	886.00	7,442,400
やまや	1,800	3,065.00	5,517,000
ベルーナ	17,100	1,204.00	20,588,400
じもとホールディングス	56,600	176.00	9,961,600
めぶきフィナンシャルグループ	361,800	386.00	139,654,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,900	2,352.00	23,284,800
九州フィナンシャルグループ	113,900	536.00	61,050,400
ゆうちょ銀行	198,500	1,321.00	262,218,500
富山第一銀行	23,000	463.00	10,649,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	415,900	541.00	225,001,900
西日本フィナンシャルホールディングス	45,200	1,234.00	55,776,800
関西みらいフィナンシャルグループ	31,100	968.00	30,104,800
三十三フィナンシャルグループ	5,500	2,300.00	12,650,000
新生銀行	56,300	1,725.00	97,117,500
あおぞら銀行	41,400	3,930.00	162,702,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,874,300	692.40	3,374,965,320

りそなホールディングス	765,000	619.20	473,688,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	137,500	4,480.00	616,000,000	
三井住友フィナンシャルグループ	529,700	4,463.00	2,364,051,100	
第四銀行	8,400	4,580.00	38,472,000	
北越銀行	7,500	2,296.00	17,220,000	
千葉銀行	245,800	724.00	177,959,200	
群馬銀行	140,000	556.00	77,840,000	
武蔵野銀行	11,300	3,115.00	35,199,500	
千葉興業銀行	22,600	472.00	10,667,200	
筑波銀行	35,400	270.00	9,558,000	
七十七銀行	21,700	2,555.00	55,443,500	
青森銀行	6,000	3,360.00	20,160,000	
秋田銀行	5,000	2,846.00	14,230,000	
山形銀行	8,000	2,509.00	20,072,000	
岩手銀行	5,000	4,985.00	24,925,000	
東邦銀行	63,400	421.00	26,691,400	
東北銀行	4,500	1,354.00	6,093,000	
みちのく銀行	4,300	1,834.00	7,886,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	282,000	613.00	172,866,000	
静岡銀行	173,700	950.00	165,015,000	
十六銀行	9,300	2,796.00	26,002,800	
スルガ銀行	72,200	527.00	38,049,400	
八十二銀行	122,600	493.00	60,441,800	
山梨中央銀行	44,000	394.00	17,336,000	
大垣共立銀行	11,000	2,876.00	31,636,000	
福井銀行	6,800	2,333.00	15,864,400	
北國銀行	8,100	4,255.00	34,465,500	
清水銀行	3,700	2,176.00	8,051,200	
富山銀行	1,700	4,160.00	7,072,000	
滋賀銀行	66,000	570.00	37,620,000	
南都銀行	8,400	2,825.00	23,730,000	
百五銀行	66,000	457.00	30,162,000	
京都銀行	26,600	5,580.00	148,428,000	
紀陽銀行	26,700	1,714.00	45,763,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	45,900	1,528.00	70,135,200	
広島銀行	102,100	750.00	76,575,000	
山陰合同銀行	42,000	949.00	39,858,000	
中国銀行	48,100	1,136.00	54,641,600	
伊予銀行	98,700	702.00	69,287,400	
百十四銀行	75,000	335.00	25,125,000	
四国銀行	11,600	1,336.00	15,497,600	
阿波銀行	55,000	711.00	39,105,000	

大分銀行	4,300	4,030.00	17,329,000
宮崎銀行	5,000	3,110.00	15,550,000
佐賀銀行	4,700	2,301.00	10,814,700
十八銀行	46,000	364.00	16,744,000
沖縄銀行	6,900	4,080.00	28,152,000
琉球銀行	14,100	1,332.00	18,781,200
セブン銀行	263,600	342.00	90,151,200
みずほフィナンシャルグループ	9,510,900	196.10	1,865,087,490
山口フィナンシャルグループ	87,000	1,236.00	107,532,000
名古屋銀行	6,000	3,765.00	22,590,000
北洋銀行	105,700	375.00	39,637,500
愛知銀行	2,500	4,835.00	12,087,500
中京銀行	3,800	2,345.00	8,911,000
大光銀行	3,600	2,109.00	7,592,400
愛媛銀行	10,000	1,268.00	12,680,000
京葉銀行	62,000	474.00	29,388,000
栃木銀行	38,100	381.00	14,516,100
北日本銀行	2,500	2,559.00	6,397,500
東和銀行	13,100	1,014.00	13,283,400
福島銀行	5,000	688.00	3,440,000
大東銀行	4,200	1,221.00	5,128,200
トモニホールディングス	59,800	468.00	27,986,400
フィデアホールディングス	79,500	165.00	13,117,500
池田泉州ホールディングス	77,600	388.00	30,108,800
F P G	23,000	1,162.00	26,726,000
S B I ホールディングス	79,100	3,200.00	253,120,000
ジャフコ	10,200	4,055.00	41,361,000
大和証券グループ本社	600,200	690.60	414,498,120
野村ホールディングス	1,204,300	534.40	643,577,920
岡三証券グループ	61,000	535.00	32,635,000
丸三証券	23,000	967.00	22,241,000
東洋証券	28,000	246.00	6,888,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	78,200	655.00	51,221,000
水戸証券	22,000	377.00	8,294,000
いちよし証券	15,000	1,123.00	16,845,000
松井証券	34,800	1,194.00	41,551,200
マネックスグループ	72,000	533.00	38,376,000
カブドットコム証券	46,900	379.00	17,775,100
極東証券	10,000	1,435.00	14,350,000
岩井コスモホールディングス	7,000	1,514.00	10,598,000
藍澤証券	15,100	766.00	11,566,600
マネーパートナーズグループ	9,300	375.00	3,487,500

かんぽ生命保険	26,700	2,615.00	69,820,500
S O M P Oホールディングス	137,200	4,641.00	636,745,200
アニコム ホールディングス	5,300	3,615.00	19,159,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	183,000	3,561.00	651,663,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	57,500	2,300.00	132,250,000
第一生命ホールディングス	395,800	2,208.50	874,124,300
東京海上ホールディングス	263,800	5,328.00	1,405,526,400
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	1,081.00	4,972,600
T & Dホールディングス	216,900	1,727.00	374,586,300
全国保証	20,100	4,440.00	89,244,000
アルヒ	8,600	2,439.00	20,975,400
クレディセゾン	53,100	1,765.00	93,721,500
芙蓉総合リース	8,000	6,700.00	53,600,000
興銀リース	13,700	2,905.00	39,798,500
東京センチュリー	13,900	6,420.00	89,238,000
日本証券金融	32,400	633.00	20,509,200
アイフル	121,100	321.00	38,873,100
リコーリース	5,700	3,725.00	21,232,500
イオンフィナンシャルサービス	49,300	2,282.00	112,502,600
アコム	140,800	452.00	63,641,600
ジャックス	9,200	2,267.00	20,856,400
オリエントコーポレーション	154,400	161.00	24,858,400
日立キャピタル	19,300	3,095.00	59,733,500
オリックス	467,000	1,816.50	848,305,500
三菱U F Jリース	175,900	643.00	113,103,700
日本取引所グループ	200,800	1,948.00	391,158,400
イー・ギャランティ	9,400	1,143.00	10,744,200
N E Cキャピタルソリューション	3,300	1,866.00	6,157,800
いちご	100,700	429.00	43,200,300
日本駐車場開発	92,300	177.00	16,337,100
ヒューリック	146,500	1,064.00	155,876,000
三栄建築設計	3,300	1,638.00	5,405,400
スター・マイカ	3,800	2,127.00	8,082,600
野村不動産ホールディングス	46,600	2,337.00	108,904,200
三重交通グループホールディングス	17,500	543.00	9,502,500
サムティ	6,900	2,086.00	14,393,400
日本商業開発	4,700	1,831.00	8,605,700
プレサンスコーポレーション	9,900	1,446.00	14,315,400
ユニゾホールディングス	10,200	2,179.00	22,225,800
日本管理センター	5,800	1,287.00	7,464,600
フージャースホールディングス	18,300	691.00	12,645,300
オープンハウス	11,400	5,580.00	63,612,000

東急不動産ホールディングス	169,200	774.00	130,960,800
飯田グループホールディングス	58,500	1,997.00	116,824,500
ムゲンエステート	6,500	664.00	4,316,000
ハウスドゥ	3,200	2,275.00	7,280,000
ケイアイスター不動産	3,100	2,372.00	7,353,200
パーク24	41,100	3,300.00	135,630,000
パラカ	2,900	2,340.00	6,786,000
三井不動産	349,600	2,551.50	892,004,400
三菱地所	521,500	1,883.00	981,984,500
平和不動産	12,700	1,986.00	25,222,200
東京建物	77,300	1,352.00	104,509,600
ダイビル	18,000	1,197.00	21,546,000
京阪神ビルディング	15,700	835.00	13,109,500
住友不動産	168,000	3,948.00	663,264,000
大京	11,700	2,229.00	26,079,300
テオーシー	24,400	825.00	20,130,000
東京楽天地	1,600	4,940.00	7,904,000
レオパレス21	85,100	599.00	50,974,900
スターツコーポレーション	9,400	2,370.00	22,278,000
フジ住宅	12,100	897.00	10,853,700
ゴールドクレスト	6,100	1,846.00	11,260,600
日本エスリード	4,200	1,516.00	6,367,200
日神不動産	11,700	545.00	6,376,500
日本エスコン	14,100	817.00	11,519,700
タカラレーベン	35,800	341.00	12,207,800
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,111.00	7,110,400
イオンモール	45,400	1,903.00	86,396,200
カチタス	9,600	3,370.00	32,352,000
トーセイ	10,800	1,060.00	11,448,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,500	1,231.00	54,779,500
サンフロンティア不動産	9,300	1,301.00	12,099,300
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	886.00	6,379,200
日本空港ビルデング	20,600	4,940.00	101,764,000
日本工営	4,900	2,919.00	14,303,100
LIFULL	24,300	612.00	14,871,600
ジェイエシーリクルートメント	6,100	2,494.00	15,213,400
日本M&Aセンター	47,300	3,135.00	148,285,500
タケエイ	9,300	823.00	7,653,900
トラスト・テック	3,400	4,495.00	15,283,000
コシダカホールディングス	18,600	1,180.00	21,948,000
パソナグループ	6,700	1,689.00	11,316,300
リンクアンドモチベーション	12,700	1,209.00	15,354,300

G C A	9,800	880.00	8,624,000
エス・エム・エス	27,000	2,089.00	56,403,000
パーソルホールディングス	62,600	2,510.00	157,126,000
リニカル	4,800	1,698.00	8,150,400
クックパッド	23,900	449.00	10,731,100
学情	4,000	1,582.00	6,328,000
スタジオアリス	4,300	2,295.00	9,868,500
シミックホールディングス	4,700	2,280.00	10,716,000
総合警備保障	27,000	5,030.00	135,810,000
カカクコム	51,700	2,141.00	110,689,700
アイロムグループ	2,900	1,809.00	5,246,100
ルネサンス	4,000	2,238.00	8,952,000
ディップ	9,400	2,600.00	24,440,000
オプトホールディング	5,300	2,928.00	15,518,400
ツクイ	16,500	1,024.00	16,896,000
エムスリー	71,500	5,110.00	365,365,000
アウトソーシング	29,200	1,545.00	45,114,000
ウェルネット	8,900	1,023.00	9,104,700
ワールドホールディングス	2,400	3,150.00	7,560,000
ディー・エヌ・エー	36,800	1,897.00	69,809,600
博報堂D Yホールディングス	93,800	1,910.00	179,158,000
ぐるなび	11,800	935.00	11,033,000
エスアールジータカミヤ	10,700	662.00	7,083,400
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	1,253.00	8,520,400
ファンコミュニケーションズ	20,200	690.00	13,938,000
ライク	3,400	1,752.00	5,956,800
W D Bホールディングス	3,400	3,840.00	13,056,000
バリューコマース	6,000	2,351.00	14,106,000
インフォマート	37,500	1,394.00	52,275,000
J Pホールディングス	27,400	302.00	8,274,800
E P Sホールディングス	10,300	2,323.00	23,926,900
プレステージ・インターナショナル	14,700	1,302.00	19,139,400
アミューズ	4,800	3,185.00	15,288,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,063.00	6,395,300
クイック	5,100	1,983.00	10,113,300
ケネディクス	64,400	668.00	43,019,200
電通	82,500	5,190.00	428,175,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,700	1,986.00	7,348,200
ぴあ	2,500	5,510.00	13,775,000
イオンファンタジー	2,300	3,550.00	8,165,000
シーティーエス	7,600	816.00	6,201,600
ネクシィーズグループ	3,000	1,975.00	5,925,000

みらかホールディングス	20,600	3,255.00	67,053,000
アルプス技研	6,200	2,435.00	15,097,000
日本空調サービス	10,100	829.00	8,372,900
オリエンタルランド	80,200	11,600.00	930,320,000
ダスキン	18,500	2,790.00	51,615,000
明光ネットワークジャパン	10,600	1,028.00	10,896,800
ファルコホールディングス	5,000	1,827.00	9,135,000
ラウンドワン	21,200	1,427.00	30,252,400
リゾートトラスト	29,200	1,831.00	53,465,200
ビー・エム・エル	8,800	3,330.00	29,304,000
りらいあコミュニケーションズ	10,400	1,426.00	14,830,400
リソー教育	13,600	884.00	12,022,400
ユー・エス・エス	83,100	2,111.00	175,424,100
サイバーエージェント	41,900	6,110.00	256,009,000
楽天	317,800	845.90	268,827,020
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,222.00	5,499,000
テー・オー・ダブリュー	9,300	761.00	7,077,300
セントラルスポーツ	3,100	4,360.00	13,516,000
フルキャストホールディングス	6,600	2,502.00	16,513,200
エン・ジャパン	5,800	5,130.00	29,754,000
テクノプロ・ホールディングス	12,900	6,460.00	83,334,000
Gunosy	4,700	1,973.00	9,273,100
イー・ガーディアン	3,600	2,614.00	9,410,400
ジャパンマテリアル	18,600	1,395.00	25,947,000
ベクトル	8,300	2,551.00	21,173,300
I B J	7,000	652.00	4,564,000
アサンテ	3,600	2,372.00	8,539,200
N・フィールド	4,900	1,822.00	8,927,800
バリューHR	2,600	2,205.00	5,733,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	6,190.00	11,142,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,200	1,578.00	5,049,600
アビスト	1,400	4,005.00	5,607,000
シグマクシス	4,400	1,268.00	5,579,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	439.00	5,048,500
リクルートホールディングス	523,400	3,468.00	1,815,151,200
エラン	2,600	2,828.00	7,352,800
日本郵政	384,900	1,340.00	515,766,000
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,710.00	19,323,000
鎌倉新書	5,600	1,370.00	7,672,000
エボラブルアジア	2,400	2,853.00	6,847,200
ストライク	1,800	3,855.00	6,939,000
ソラスト	12,700	1,324.00	16,814,800

インソース	2,600	2,428.00	6,312,800
キャリアインデックス	3,000	1,654.00	4,962,000
MS - J a p a n	800	8,750.00	7,000,000
日総工産	2,600	2,606.00	6,775,600
キュービーネットホールディングス	3,900	2,104.00	8,205,600
リログループ	37,300	3,150.00	117,495,000
東祥	4,300	4,470.00	19,221,000
エイチ・アイ・エス	12,000	3,830.00	45,960,000
共立メンテナンス	12,100	4,660.00	56,386,000
イチネンホールディングス	9,400	1,474.00	13,855,600
建設技術研究所	6,100	1,747.00	10,656,700
スペース	5,700	1,378.00	7,854,600
東京テアトル	5,300	1,381.00	7,319,300
ナガワ	1,500	4,850.00	7,275,000
よみうりランド	2,200	4,485.00	9,867,000
東京都競馬	4,500	4,140.00	18,630,000
常磐興産	4,400	1,836.00	8,078,400
カナモト	9,700	4,020.00	38,994,000
東京ドーム	28,000	1,009.00	28,252,000
西尾レントオール	7,000	3,555.00	24,885,000
トランス・コスモス	7,400	2,825.00	20,905,000
乃村工藝社	15,900	2,162.00	34,375,800
藤田観光	3,400	3,395.00	11,543,000
K N T - C Tホールディングス	4,900	1,233.00	6,041,700
日本管財	7,200	2,137.00	15,386,400
トーカイ	6,600	2,469.00	16,295,400
セコム	71,900	9,214.00	662,486,600
セントラル警備保障	3,400	4,355.00	14,807,000
丹青社	14,100	1,168.00	16,468,800
メイテック	8,200	5,230.00	42,886,000
応用地質	8,800	1,488.00	13,094,400
船井総研ホールディングス	14,000	2,408.00	33,712,000
オオバ	9,300	623.00	5,793,900
ベネッセホールディングス	25,000	3,345.00	83,625,000
イオンディライト	8,200	4,080.00	33,456,000
ナック	7,400	1,130.00	8,362,000
ニチイ学館	13,500	939.00	12,676,500
ダイセキ	11,400	2,838.00	32,353,200
合 計	85,178,800		178,319,347,240

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(平成30年 9月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,140,754,221
コール・ローン	269,918,099
株式	180,812,175,751
投資証券	4,109,804,689
派生商品評価勘定	53,528,142
未収入金	5,973,894
未収配当金	379,639,369
差入委託証拠金	1,938,073,552
流動資産合計	190,709,867,717
資産合計	190,709,867,717
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,685,518
前受金	8,841,265
未払解約金	163,224,139
未払利息	759
その他未払費用	1,869
流動負債合計	216,753,550
負債合計	216,753,550
純資産の部	
元本等	
元本	52,677,733,208
剰余金	
剰余金又は欠損金()	137,815,380,959
元本等合計	190,493,114,167
純資産合計	190,493,114,167
負債純資産合計	190,709,867,717

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	52,677,733,208口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.6162円
	(10,000口当たりの純資産額)	36,162円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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、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委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,547,498,854	-	5,556,340,119	8,841,265
	SPMINI 1809	3,912,274,699	-	3,960,431,492	48,156,793
	DJ EUR 1809	1,008,797,927	-	983,425,477	25,372,450
	FTSE 1809	376,239,885	-	364,854,000	11,385,885
	SPI200 1809	250,186,343	-	247,629,150	2,557,193
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	313,959	-	312,600	1,359
	イスラエルシェケル	313,959	-	312,600	1,359
合計		5,547,812,813	-	5,556,652,719	8,842,624

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日

至 平成30年 9月18日

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

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	61,193,909,515円
同期中における追加設定元本額	9,729,660,960円
同期中における一部解約元本額	18,245,837,267円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	13,307,564,097円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	264,175,978円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,098,206,792円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	754,151,214円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	88,047,999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)	2,617,655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)	7,827,465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)	21,829,082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)	38,929,988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)	25,664,105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)	65,520,302円

(平成30年 9月18日現在)	
外国株式指数ファンド	495,608,000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	2,292,791,312円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	321,659,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	374,547,333円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	328,208,003円
イオン・バランス戦略ファンド	66,750,946円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,657,218円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,100,399円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,653,198円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	16,822,085円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	14,016,857円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	40,131,729円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,739,446円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,229,376,295円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	9,361,545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>	277,470,008円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,801,742,634円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,639,347,501円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,907,514,410円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	21,665,789円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	112,494,500円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	448,417円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	866,405,229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>	63,322,997円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	188,955,118円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	839,861,789円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	714,395,294円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,784,766,652円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	2,126,892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)	718,873,301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)	987,929,595円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	150,067,778円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	78,822,498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)	1,267,904,169円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	26,825,416円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	14,190,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	6,986,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	51,561,872円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	123,124,057円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	123,108,430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>	1,304,117,644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>	183,651,181円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	6,759,467,341円

(平成30年 9月18日現在)	
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 >	369,452,547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 >	3,103,743,780円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	9,073,361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 >	111,024,727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 >	53,183,061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 >	132,134,455円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	14,580円
合計	52,677,733,208円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	23,597	63.97	1,509,500.09	
	ANDEAVOR	6,379	155.59	992,508.61	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	18.80	173,580.40	
	APACHE CORPORATION	16,399	45.78	750,746.22	
	BAKER HUGHES A GE CO	19,384	31.61	612,728.24	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	21.57	423,462.24	
	CHENIERE ENERGY INC	8,184	64.77	530,077.68	
	CHEVRON CORPORATION	83,703	117.51	9,835,939.53	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	91.18	372,014.40	
	CONCHO RESOURCES INC	8,741	141.63	1,237,987.83	
	CONOCOPHILLIPS	51,342	74.24	3,811,630.08	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	60.02	272,190.70	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	38.81	855,993.36	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	4,554	122.69	558,730.26	
	EOG RESOURCES INC	25,021	117.54	2,940,968.34	
	EQT CORPORATION	11,310	47.04	532,022.40	
	EXXON MOBIL CORPORATION	185,591	83.41	15,480,145.31	
	HALLIBURTON CO	38,995	38.71	1,509,496.45	
	HELMERICH & PAYNE INC	5,249	65.10	341,709.90	
	HESS CORPORATION	12,398	66.77	827,814.46	
HOLLYFRONTIER CORP	7,365	68.92	507,595.80		
KINDER MORGAN INC	85,839	18.17	1,559,694.63		
MARATHON OIL CORP	36,817	20.87	768,370.79		

MARATHON PETROLEUM CORPORATION	20,809	83.82	1,744,210.38
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	44.11	743,165.28
NEWFIELD EXPLORATION CO	8,254	27.02	223,023.08
NOBLE ENERGY INC	20,924	29.73	622,070.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,445	77.60	2,595,332.00
ONEOK INC	18,429	67.97	1,252,619.13
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	27.75	255,522.00
PHILLIPS 66	19,267	112.81	2,173,510.27
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,478	171.11	1,279,560.58
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	24.50	191,247.00
SCHLUMBERGER LTD	60,206	60.97	3,670,759.82
TARGA RESOURCES CORP	8,672	54.65	473,924.80
TECHNIPFMC PLC	18,187	29.90	543,791.30
VALERO ENERGY CORP	18,934	115.46	2,186,119.64
WILLIAMS COS INC	52,994	28.24	1,496,550.56
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,800	168.75	1,653,750.00
ALBEMARLE CORPORATION	5,093	102.45	521,777.85
AVERY DENNISON CORP	3,941	109.35	430,948.35
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	29.33	316,089.41
BALL CORPORATION	13,670	44.14	603,393.80
CELANESE CORPORATION	5,647	113.39	640,313.33
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	51.95	526,721.05
CHEMOURS CO	8,067	40.32	325,261.44
CROWN HOLDINGS INC	5,272	46.17	243,408.24
DOWDUPONT INC	101,306	68.82	6,971,878.92
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	97.62	581,424.72
ECOLAB INC	11,670	156.24	1,823,320.80
FMC CORPORATION	5,698	86.23	491,338.54
FREEMONT-MCMORAN INC	60,238	13.72	826,465.36
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	53.62	918,564.22
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,501	136.49	477,851.49
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,870	103.46	1,538,450.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	193.09	497,592.93
MOSAIC CO/THE	15,550	31.99	497,444.50
NEWMONT MINING CORP	23,519	30.64	720,622.16
NUCOR CORP	14,127	63.05	890,707.35
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	115.36	466,746.56
PPG INDUSTRIES INC	11,270	112.99	1,273,397.30
PRAXAIR INC	12,573	158.02	1,986,785.46
SEALED AIR CORP	7,922	41.99	332,644.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,778	469.47	1,773,657.66
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	47.21	481,117.11

VULCAN MATERIALS CO	5,483	110.96	608,393.68
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,475	85.79	126,540.25
WESTROCK CO	11,330	55.95	633,913.50
3M COMPANY	26,156	209.53	5,480,466.68
ACUITY BRANDS INC	1,884	158.22	298,086.48
AERCAP HOLDINGS NV	6,145	57.07	350,695.15
AGCO CORP	2,297	59.10	135,752.70
ALLEGION PLC	4,545	88.89	404,005.05
AMETEK INC	10,396	80.79	839,892.84
ARCONIC INC	19,024	22.72	432,225.28
BOEING CO	24,437	355.96	8,698,594.52
CATERPILLAR INC	26,127	146.22	3,820,289.94
CUMMINS INC	6,990	144.49	1,009,985.10
DEERE & CO	13,218	149.04	1,970,010.72
DOVER CORP	6,689	88.53	592,177.17
EATON CORP PLC	18,883	87.13	1,645,275.79
EMERSON ELECTRIC CO	28,186	77.77	2,192,025.22
FASTENAL COMPANY	12,895	57.71	744,170.45
FLOWSERVE CORPORATION	6,566	55.16	362,180.56
FLUOR CORP	5,677	57.63	327,165.51
FORTIVE CORP	13,617	87.12	1,186,313.04
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	55.25	356,362.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,029	202.43	2,232,600.47
GENERAL ELECTRIC CO	377,278	12.70	4,791,430.60
HARRIS CORP	4,981	166.45	829,087.45
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	41.81	325,574.47
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,871	165.75	5,448,368.25
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	257.49	471,721.68
IDEX CORP	3,078	153.90	473,704.20
ILLINOIS TOOL WORKS	13,541	146.20	1,979,694.20
INGERSOLL-RAND PLC	11,061	103.02	1,139,504.22
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	75.97	373,924.34
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	60.50	568,700.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	35.17	320,047.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	37.25	1,473,349.25
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	216.79	728,631.19
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,823	223.96	408,279.08
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,333	339.34	3,845,740.22
MASCO CORP	14,295	38.32	547,784.40
MIDDLEBY CORP	2,764	125.67	347,351.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,169	311.02	2,229,702.38
OWENS CORNING	4,859	58.58	284,640.22

PACCAR INC	15,381	70.63	1,086,360.03
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,939	187.45	1,113,265.55
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	44.36	310,786.16
RAYTHEON COMPANY	12,577	205.01	2,578,410.77
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,618	191.45	1,075,566.10
ROCKWELL COLLINS INC	7,154	139.60	998,698.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,481	311.40	1,395,383.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,127	49.80	404,724.60
SMITH(A.O.) CORP	6,960	59.43	413,632.80
SNAP-ON INC	2,448	186.72	457,090.56
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,166	88.22	455,744.52
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,734	149.19	1,004,645.46
TEXTRON INC	12,033	70.91	853,260.03
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	367.99	743,339.80
UNITED RENTALS INC	3,677	164.94	606,484.38
UNITED TECHNOLOGIES CORP	32,957	137.76	4,540,156.32
WABCO HOLDINGS INC	2,109	115.39	243,357.51
WABTEC CORP	3,452	105.10	362,805.20
WW GRAINGER INC	1,980	351.63	696,227.40
XYLEM INC	7,965	81.54	649,466.10
CINTAS CORP	4,082	212.47	867,302.54
COPART INC	8,553	63.73	545,082.69
COSTAR GROUP INC	1,621	423.50	686,493.50
EQUIFAX INC	5,368	135.94	729,725.92
IHS MARKIT LTD	18,255	54.44	993,802.20
MANPOWERGROUP	3,240	88.19	285,735.60
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	27.22	412,001.92
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	75.12	730,241.52
ROBERT HALF INTL INC	5,854	71.26	417,156.04
ROLLINS INC	4,301	63.26	272,081.26
STERICYCLE, INC.	4,280	61.69	264,033.20
TRANSUNION	7,559	74.84	565,715.56
VERISK ANALYTICS INC	7,039	120.55	848,551.45
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	79.44	870,106.32
WASTE MANAGEMENT INC	18,677	92.11	1,720,338.47
AMERCO	390	355.15	138,508.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	40.32	228,856.32
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	96.71	586,352.73
CSX CORPORATION	37,286	73.34	2,734,555.24
DELTA AIR LINES INC	7,251	57.96	420,267.96
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,961	73.78	587,362.58
FEDEX CORP	11,187	255.73	2,860,851.51

J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	122.45	431,391.35
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	116.64	542,259.36
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,115	35.63	182,247.45
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,264	179.29	2,198,812.56
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	162.13	427,861.07
SOUTHWEST AIRLINES	6,837	63.10	431,414.70
UNION PACIFIC CORP	34,434	156.71	5,396,152.14
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,729	90.16	336,206.64
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,172	119.09	3,593,183.48
XPO LOGISTICS INC	4,945	111.97	553,691.65
APTIV PLC	11,653	85.45	995,748.85
AUTOLIV INC	4,001	87.51	350,127.51
BORGWARNER INC	8,566	44.15	378,188.90
FORD MOTOR COMPANY	160,576	9.55	1,533,500.80
GENERAL MOTORS CO	56,075	35.02	1,963,746.50
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	23.97	247,682.01
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	44.37	325,986.39
LEAR CORP	3,136	157.10	492,665.60
TESLA INC	5,426	294.84	1,599,801.84
D.R.HORTON INC	15,658	42.54	666,091.32
GARMIN LTD	4,936	68.34	337,326.24
HANESBRANDS INC	17,562	17.90	314,359.80
HASBRO INC	5,156	105.81	545,556.36
LEGGETT & PLATT INC	5,036	46.01	231,706.36
LENNAR CORP-CL A	13,092	51.16	669,786.72
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	155.38	664,871.02
MATTEL INC	14,058	16.50	231,957.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,155	73.36	524,890.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	186.91	535,123.33
NEWELL BRANDS INC	22,542	21.56	486,005.52
NIKE INC -CL B	56,282	83.26	4,686,039.32
NVR INC	143	2,620.98	374,800.14
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	108.92	268,705.64
PULTE GROUP INC	12,930	26.65	344,584.50
PVH CORP	3,303	138.61	457,828.83
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	131.55	348,081.30
TAPESTRY INC	11,987	50.51	605,463.37
TOLL BROTHERS INC	7,061	36.17	255,396.37
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	19.11	164,995.74
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	17.67	146,501.97
VF CORP	14,902	91.15	1,358,317.30
WHIRLPOOL CORP	2,604	123.07	320,474.28

ARAMARK	10,783	41.99	452,778.17
CARNIVAL CORP	18,679	64.82	1,210,772.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,101	488.32	537,640.32
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	117.98	633,788.56
DOMINO'S PIZZA INC	1,940	274.60	532,724.00
H&R BLOCK INC	7,820	24.87	194,483.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	12,524	79.10	990,648.40
LAS VEGAS SANDS CORP	17,144	61.23	1,049,727.12
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	13,044	129.77	1,692,719.88
MCDONALD'S CORPORATION	34,530	158.14	5,460,574.20
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	20.86	232,589.00
MGM MIRAGE	22,498	27.42	616,895.16
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	9,135	55.83	510,007.05
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,457	128.74	960,014.18
STARBUCKS CORP	61,440	54.57	3,352,780.80
VAIL RESORTS INC	1,924	289.87	557,709.88
WYNN RESORTS LTD	4,252	132.45	563,177.40
YUM! BRANDS INC	14,192	87.69	1,244,496.48
CBS CORP-CL B	15,692	56.28	883,145.76
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	7,298	319.47	2,331,492.06
COMCAST CORP-CLASS A	201,592	36.96	7,450,840.32
DISCOVERY INC-A	7,075	32.02	226,541.50
DISCOVERY INC-C	11,249	29.30	329,595.70
DISH NETWORK CORP.	9,780	36.56	357,556.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	22.54	350,361.76
LIBERTY BROADBAND-C	4,953	82.06	406,443.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	27.92	235,421.44
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	26.96	635,986.40
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	36.08	309,133.44
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	46.61	356,473.28
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	46.55	192,763.55
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	53.47	324,295.55
NEWS CORP-CLASS A	16,662	12.27	204,442.74
OMNICOM GROUP	10,146	69.76	707,784.96
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	7.06	481,859.12
THE WALT DISNEY CO.	65,408	109.36	7,153,018.88
TWENTY-FIRST CE CL-A	47,150	44.71	2,108,076.50
TWENTY-FIRST CE CL-B	19,170	44.34	849,997.80
VIACOM INC-CLASS B	16,489	30.06	495,659.34
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	163.50	540,204.00
AMAZON.COM INC	18,009	1,908.03	34,361,712.27
AUTOZONE INC	1,219	747.52	911,226.88

BEST BUY COMPANY INC	11,445	77.04	881,722.80
BOOKING HOLDINGS INC	2,126	1,890.76	4,019,755.76
CARMAX INC	7,453	79.85	595,122.05
DOLLAR GENERAL CORP	11,840	107.25	1,269,840.00
DOLLAR TREE INC	10,263	85.50	877,486.50
EXPEDIA GROUP INC	5,168	128.98	666,568.64
GAP INC/THE	9,218	27.05	249,346.90
GENUINE PARTS CO	6,648	100.68	669,320.64
HOME DEPOT INC	51,078	208.40	10,644,655.20
KOHL'S CORP	7,962	79.26	631,068.12
L BRANDS INC	10,675	28.44	303,597.00
LKQ CORPORATION	13,945	32.04	446,797.80
LOWE'S COMPANIES INC	36,267	113.74	4,125,008.58
MACY'S INC	13,521	35.16	475,398.36
NETFLIX INC	18,968	350.35	6,645,438.80
NORDSTROM INC	4,756	64.10	304,859.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,687	336.66	1,241,265.42
QURATE RETAIL INC	18,982	21.92	416,085.44
ROSS STORES INC	17,122	96.22	1,647,478.84
TARGET CORP	22,678	87.28	1,979,335.84
TIFFANY & CO	4,643	125.88	584,460.84
TJX COMPANIES INC	27,638	107.96	2,983,798.48
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	87.69	462,827.82
TRIPADVISOR INC-W/I	4,051	49.27	199,592.77
ULTA BEAUTY INC	2,623	281.45	738,243.35
COSTCO WHOLESALE CORP	19,190	232.00	4,452,080.00
DAIRY FARM INTL HLDGS-900	13,500	9.20	124,200.00
KROGER CO	38,882	28.84	1,121,356.88
SYSCO CORP	22,052	73.49	1,620,601.48
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,968	70.45	2,604,395.60
WALMART INC	64,358	94.82	6,102,425.56
ALTRIA GROUP INC	82,974	62.44	5,180,896.56
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,078	49.78	1,248,382.84
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	49.10	556,106.60
BUNGE LIMITED	5,968	64.61	385,592.48
CAMPBELL SOUP CO	7,879	40.96	322,723.84
COCA-COLA CO/THE	176,397	46.32	8,170,709.04
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	45.78	428,134.56
CONAGRA BRANDS INC	17,122	38.19	653,889.18
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,451	212.33	1,582,070.83
GENERAL MILLS INC	25,006	47.77	1,194,536.62
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	41.05	510,785.15

INGREDION INC	3,320	103.90	344,948.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	111.65	548,648.10
KELLOGG CO	11,216	74.70	837,835.20
KRAFT HEINZ COMPANY	26,755	58.35	1,561,154.25
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,606	132.67	743,748.02
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,674	64.04	555,482.96
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	65,326	43.71	2,855,399.46
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	18,165	59.72	1,084,813.80
PEPSICO INC	61,989	115.40	7,153,530.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,209	80.30	5,477,182.70
THE HERSHEY COMPANY	6,522	103.77	676,787.94
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	63.06	795,817.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,995	59.80	597,701.00
CLOROX COMPANY	5,583	151.93	848,225.19
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,634	68.81	2,520,785.54
COTY INC-CL A	22,574	12.31	277,885.94
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,831	139.89	1,375,258.59
KIMBERLY-CLARK CORP	15,309	117.09	1,792,530.81
PROCTER & GAMBLE CO	109,765	84.25	9,247,701.25
ABBOTT LABORATORIES	76,439	67.67	5,172,627.13
ABIOMED INC	1,839	368.90	678,407.10
AETNA INC	14,197	204.77	2,907,119.69
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,299	378.37	1,248,242.63
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	86.76	612,352.08
ANTHEM INC	11,178	269.63	3,013,924.14
BAXTER INTERNATIONAL INC	22,429	77.04	1,727,930.16
BECTON DICKINSON & CO	11,459	257.23	2,947,598.57
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,455	37.27	2,215,887.85
CARDINAL HEALTH INC	13,707	52.60	720,988.20
CENTENE CORP	8,863	141.75	1,256,330.25
CERNER CORP	13,575	64.20	871,515.00
CIGNA CORP	10,616	197.84	2,100,269.44
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	259.66	533,601.30
CVS HEALTH CORPORATION	44,048	78.10	3,440,148.80
DANAHER CORP	27,493	105.97	2,913,433.21
DAVITA INC	6,953	70.36	489,213.08
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	38.10	378,866.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,150	146.29	1,338,553.50
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	25,001	95.23	2,380,845.23
HCA HEALTHCARE INC	12,236	132.70	1,623,717.20
HENRY SCHEIN INC	7,253	84.39	612,080.67
HOLOGIC INC	12,110	39.53	478,708.30

HUMANA INC.	6,018	334.04	2,010,252.72
IDEXX LABORATORIES INC	3,797	242.94	922,443.18
INTUITIVE SURGICAL INC	4,847	558.65	2,707,776.55
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	171.31	754,620.55
MCKESSON CORP	9,111	131.78	1,200,647.58
MEDTRONIC PLC	59,239	96.03	5,688,721.17
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	107.63	636,093.30
RESMED INC	6,572	112.76	741,058.72
STRYKER CORP	14,587	169.88	2,478,039.56
TELEFLEX INC	1,951	267.14	521,190.14
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,297	263.87	11,160,909.39
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	126.03	473,872.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	110.05	453,406.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	104.48	526,056.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,837	129.55	1,144,833.35
ABBVIE INC	66,290	95.37	6,322,077.30
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,256	69.08	984,804.48
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,671	117.81	1,139,340.51
ALKERMES PLC	6,413	38.60	247,541.80
ALLERGAN PLC	14,504	184.29	2,672,942.16
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	93.35	364,811.80
AMGEN INC	29,596	200.81	5,943,172.76
BIOGEN INC	9,161	334.40	3,063,438.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	98.15	737,695.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	71,876	61.30	4,405,998.80
CELGENE CORP	33,287	87.20	2,902,626.40
ELI LILLY & CO	43,100	105.71	4,556,101.00
GILEAD SCIENCES INC	57,365	72.78	4,175,024.70
ILLUMINA INC	6,326	347.22	2,196,513.72
INCYTE CORP	7,576	67.02	507,743.52
IQVIA HOLDINGS INC	6,827	125.07	853,852.89
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	161.01	419,270.04
JOHNSON & JOHNSON	117,351	139.96	16,424,445.96
MERCK & CO. INC.	118,397	70.42	8,337,516.74
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	610.31	678,664.72
MYLAN NV	22,501	37.21	837,262.21
NEKTAR THERAPEUTICS	7,034	58.31	410,152.54
PERRIGO CO PLC	5,561	72.57	403,561.77
PFIZER INC	260,204	43.01	11,191,374.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	386.49	1,310,974.08
SEATTLE GENETICS INC	4,290	76.16	326,726.40
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	43,235	23.43	1,012,996.05

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,610	238.46	4,199,280.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	125.94	273,163.86
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,149	175.80	1,959,994.20
WATERS CORP	3,459	195.09	674,816.31
ZOETIS INC	21,193	88.30	1,871,341.90
BANK OF AMERICA CORP	425,371	30.28	12,880,233.88
BB & T CORPORATION	33,413	50.24	1,678,669.12
CIT GROUP INC	5,683	53.26	302,676.58
CITIGROUP INC	111,855	70.88	7,928,282.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,812	39.89	870,080.68
COMERICA INC	7,688	92.74	712,985.12
EAST WEST BANCORP INC	6,233	62.13	387,256.29
FIFTH THIRD BANCORP	30,937	28.72	888,510.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,244	98.55	713,896.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,927	15.65	765,707.55
JPMORGAN CHASE & CO	149,713	113.84	17,043,327.92
KEYCORP	45,615	19.86	905,913.90
M & T BANK CORP	6,200	169.72	1,052,264.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,911	10.79	236,419.69
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	17.77	249,401.95
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,764	139.66	2,899,900.24
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	47,311	18.98	897,962.78
SIGNATURE BANK	2,508	119.26	299,104.08
SUNTRUST BANKS INC	20,334	68.32	1,389,218.88
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	318.57	743,223.81
US BANCORP	67,944	54.13	3,677,808.72
WELLS FARGO & COMPANY	203,880	54.31	11,072,722.80
ZIONS BANCORPORATION	8,874	51.71	458,874.54
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,602	142.05	369,614.10
ALLY FINANCIAL INC	17,783	26.95	479,251.85
AMERICAN EXPRESS COMPANY	31,637	109.20	3,454,760.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,298	144.08	907,415.84
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	44,767	51.22	2,292,965.74
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,936	216.29	12,098,397.44
BLACKROCK INC	5,231	470.90	2,463,277.90
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,619	97.10	2,099,204.90
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,923	104.78	515,831.94
CME GROUP INC.	14,728	171.84	2,530,859.52
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,070	77.56	1,168,829.20
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	11,942	53.31	636,628.02
EATON VANCE CORP	5,530	52.35	289,495.50
FRANKLIN RESOURCES INC	15,511	31.82	493,560.02

GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,767	227.89	3,593,141.63
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,499	77.52	1,976,682.48
INVESCO LIMITED	18,328	23.71	434,556.88
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	15,290	23.15	353,963.50
MOODY'S CORP	7,529	176.91	1,331,955.39
MORGAN STANLEY	58,105	47.68	2,770,446.40
MSCI INC-A	3,805	177.94	677,061.70
NASDAQ INC	5,343	89.12	476,168.16
NORTHERN TRUST CORP	9,731	103.01	1,002,390.31
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	91.31	501,291.90
S&P GLOBAL INC	10,937	211.35	2,311,534.95
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,607	50.32	2,697,504.24
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	62.47	366,199.14
STATE STREET CORP	16,204	85.88	1,391,599.52
SYNCHRONY FINANCIAL	30,645	32.50	995,962.50
T ROWE PRICE GROUP INC	10,711	108.96	1,167,070.56
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	13,040	55.18	719,547.20
VOYA FINANCIAL INC	7,528	48.59	365,785.52
AFLAC INC	34,250	47.05	1,611,462.50
ALLEGHANY CORPORATION	735	628.94	462,270.90
ALLSTATE CORP	15,658	100.33	1,570,967.14
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	112.03	396,474.17
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,024	53.30	2,133,279.20
AON PLC	11,059	152.15	1,682,626.85
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,823	30.18	537,898.14
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	75.12	569,935.44
ASSURANT INC	2,198	103.95	228,482.10
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,083	51.14	311,084.62
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,961	57.52	227,836.72
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	41.59	177,090.22
CHUBB LTD	20,167	138.34	2,789,902.78
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	77.84	491,248.24
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	223.26	368,379.00
FNF GROUP	10,851	40.19	436,101.69
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	49.71	756,337.65
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	66.47	611,058.71
LOEWS CORPORATION	12,803	50.76	649,880.28
MARKEL CORP	629	1,203.05	756,718.45
MARSH & MCLENNAN COS	22,208	86.63	1,923,879.04
METLIFE INC	39,146	46.19	1,808,153.74
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,796	56.95	728,732.20
PROGRESSIVE CORP	25,621	68.53	1,755,807.13

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,252	98.99	1,806,765.48
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,972	143.37	426,095.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	131.92	198,407.68
TORCHMARK CORPORATION	4,615	85.77	395,828.55
TRAVELERS COS INC(THE)	12,182	129.89	1,582,319.98
UNUM GROUP	9,769	36.43	355,884.67
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	79.60	308,290.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,779	146.36	845,814.44
CBRE GROUP INC-A	13,193	45.73	603,315.89
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,990	112.70	2,027,473.00
EQUINIX INC	3,436	447.30	1,536,922.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	6.82	356,686.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	143.27	287,542.89
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,325	159.58	849,763.50
ACCENTURE PLC-CL A	26,777	171.04	4,579,938.08
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,544	78.88	2,488,190.72
ADOBE SYSTEMS INC	21,580	268.25	5,788,835.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	7,394	74.28	549,226.32
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	246.12	546,878.64
ALPHABET INC-CL A	13,018	1,159.83	15,098,666.94
ALPHABET INC-CL C	13,763	1,156.05	15,910,716.15
ANSYS INC	3,662	183.85	673,258.70
AUTODESK INC	9,628	146.72	1,412,620.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,255	147.04	2,831,255.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,375	134.79	724,496.25
CA INC	12,753	44.03	561,514.59
CADENCE DESIGN SYS INC	13,205	45.37	599,110.85
CDK GLOBAL INC	5,003	63.12	315,789.36
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,747	119.66	687,686.02
CITRIX SYSTEMS INC	5,651	110.74	625,791.74
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,894	75.96	1,966,908.24
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8,755	97.32	852,036.60
DXC TECHNOLOGY CO	12,719	92.74	1,179,560.06
EBAY INC	41,179	34.20	1,408,321.80
ELECTRONIC ARTS INC	13,523	112.69	1,523,906.87
FACEBOOK INC-A	104,729	160.58	16,817,382.82
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,635	109.43	1,601,508.05
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	25.77	540,757.68
FISERV INC	18,478	80.08	1,479,718.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	218.75	836,500.00
FORTINET INC	6,882	88.17	606,785.94
GARTNER INC	4,011	153.44	615,447.84

GLOBAL PAYMENTS INC	7,016	126.97	890,821.52
GODADDY INC - CLASS A	6,070	81.40	494,098.00
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	214.87	694,244.97
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,040	147.94	5,923,517.60
INTUIT INC	10,765	225.47	2,427,184.55
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,649	159.94	583,621.06
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	70.58	428,702.92
MASTERCARD INC-CL A	40,637	216.47	8,796,691.39
MERCADOLIBRE INC	1,842	322.26	593,602.92
MICROSOFT CORP	319,735	112.14	35,855,082.90
ORACLE CORPORATION	135,021	49.18	6,640,332.78
PAYCHEX INC	14,156	74.23	1,050,799.88
PAYPAL HOLDINGS INC	50,143	88.68	4,446,681.24
RED HAT INC	7,729	144.37	1,115,835.73
SABRE CORP	9,850	25.87	254,819.50
SALESFORCE.COM, INC.	30,134	154.92	4,668,359.28
SERVICENOW INC	7,584	192.82	1,462,346.88
SPLUNK INC	6,247	119.49	746,454.03
SQUARE INC-A	12,389	86.86	1,076,108.54
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,042	55.59	502,644.78
SYMANTEC CORPORATION	27,227	19.80	539,094.60
SYNOPSIS INC	6,139	100.07	614,329.73
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	131.48	632,155.84
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	97.19	697,727.01
TWITTER INC	29,540	28.86	852,524.40
VERISIGN INC	3,837	161.41	619,330.17
VISA INC	78,794	146.18	11,518,106.92
VMWARE INC	3,055	157.01	479,665.55
WESTERN UNION COMPANY	21,476	18.52	397,735.52
WORKDAY INC-CLASS A	6,016	144.73	870,695.68
WORLDPAY INC-CL A	13,361	97.83	1,307,106.63
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	44.25	235,410.00
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,389	96.19	1,287,887.91
APPLE INC	215,311	217.88	46,911,960.68
ARISTA NETWORKS INC	2,260	265.08	599,080.80
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	76.58	316,275.40
AVNET INC	4,559	47.43	216,233.37
CDW CORP/DE	6,951	88.89	617,874.39
CISCO SYSTEMS INC	209,837	47.11	9,885,421.07
COGNEX CORP	8,160	55.37	451,819.20
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	30.25	266,290.75
CORNING INC	38,165	35.18	1,342,644.70

F5 NETWORKS INC	2,620	193.65	507,363.00
FLEX LTD	23,204	12.98	301,187.92
FLIR SYSTEMS INC	5,286	62.23	328,947.78
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	70,980	16.28	1,155,554.40
HP INC	71,437	25.01	1,786,639.37
IPG PHOTONICS CORP	1,776	157.56	279,826.56
JUNIPER NETWORKS INC	15,026	28.00	420,728.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	7,598	64.14	487,335.72
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,367	126.49	931,851.83
NETAPP INC	11,136	83.44	929,187.84
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	232.00	908,744.00
SEAGATE TECHNOLOGY	12,422	47.94	595,510.68
TE CONNECTIVITY LTD	15,442	91.88	1,418,810.96
TRIMBLE INC	11,778	43.56	513,049.68
WESTERN DIGITAL CORP	12,990	57.18	742,768.20
XEROX CORP	9,697	28.08	272,291.76
AT&T INC	317,508	33.62	10,674,618.96
CENTURYLINK INC	42,717	22.78	973,093.26
SPRINT CORP	36,740	6.33	232,564.20
T-MOBILE US INC	14,939	67.42	1,007,187.38
VERIZON COMMUNICATIONS INC	180,171	54.70	9,855,353.70
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	9,241	35.17	325,005.97
AES CORPORATION	27,194	13.64	370,926.16
ALLIANT ENERGY CORP	9,162	43.99	403,036.38
AMEREN CORPORATION	10,336	65.24	674,320.64
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,673	72.80	1,577,794.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,207	89.49	734,444.43
ATMOS ENERGY CORP	4,697	94.77	445,134.69
CENTERPOINT ENERGY INC	17,622	28.78	507,161.16
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	50.30	576,639.20
CONSOLIDATED EDISON INC	13,546	80.35	1,088,421.10
DOMINION ENERGY INC	28,261	71.99	2,034,509.39
DTE ENERGY COMPANY	7,944	112.34	892,428.96
DUKE ENERGY CORP	30,740	82.08	2,523,139.20
EDISON INTERNATIONAL	14,473	68.43	990,387.39
ENERGY CORP	8,107	84.42	684,392.94
EVERGY INC	11,852	57.70	683,860.40
EVERSOURCE ENERGY	13,730	63.77	875,562.10
EXELON CORP	42,162	44.47	1,874,944.14
FIRSTENERGY CORP	20,229	37.93	767,285.97
NEXTERA ENERGY INC	20,658	173.86	3,591,599.88
NISOURCE INC	15,794	25.73	406,379.62

	OGE ENERGY CORP	9,056	37.31	337,879.36
	P G & E CORPORATION	22,921	46.82	1,073,161.22
	PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	80.86	414,003.20
	PPL CORPORATION	30,510	30.43	928,419.30
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,788	53.54	1,220,069.52
	SCANA CORP	6,498	35.89	233,213.22
	SEMPRA ENERGY	10,435	118.87	1,240,408.45
	SOUTHERN CO	44,075	44.39	1,956,489.25
	UGI CORPORATION	7,497	55.13	413,309.61
	VISTRA ENERGY CORP	13,852	23.03	319,011.56
	WEC ENERGY GROUP INC	13,142	68.62	901,804.04
	XCEL ENERGY INC	22,653	48.39	1,096,178.67
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,452	32.43	1,279,428.36
	ANALOG DEVICES INC	16,189	91.31	1,478,217.59
	APPLIED MATERIALS INC	45,315	38.70	1,753,690.50
	BROADCOM INC	17,916	234.83	4,207,214.28
	INTEL CORP	204,835	45.42	9,303,605.70
	KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	103.27	669,705.95
	LAM RESEARCH CORP	7,275	152.10	1,106,527.50
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,877	18.44	495,611.88
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,942	57.26	741,058.92
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	80.88	818,262.96
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,579	43.58	2,204,232.82
	NVIDIA CORP	25,071	273.93	6,867,699.03
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,992	90.15	1,351,528.80
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,435	19.06	332,311.10
	QORVO INC	5,998	73.97	443,672.06
	QUALCOMM INC	64,738	73.24	4,741,411.12
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	86.22	684,414.36
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,899	103.70	4,448,626.30
	XILINX INC	11,021	76.72	845,531.12
	米ドル 小計	13,418,000		1,101,019,804.59 (123,127,044,747)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	22.38	155,496.24
	ARC RESOURCES LTD	17,074	13.02	222,303.48
	CAMECO CORP	16,384	12.58	206,110.72
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	54,002	41.17	2,223,262.34
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	11.40	472,336.20
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,509	7.59	170,843.31
	ENBRIDGE INC	73,593	44.70	3,289,607.10
	ENCANA CORP	41,829	15.52	649,186.08
	HUSKY ENERGY INC	14,553	21.54	313,471.62

IMPERIAL OIL LTD	12,999	39.00	506,961.00
INTER PIPELINE LTD	18,081	22.99	415,682.19
KEYERA CORP	8,467	35.08	297,022.36
PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	43.07	934,662.07
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	23.05	208,325.90
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	13.92	201,018.72
SUNCOR ENERGY INC	70,959	49.77	3,531,629.43
TOURMALINE OIL CORP	12,887	21.14	272,431.18
TRANSCANADA CORP	38,551	55.25	2,129,942.75
VERMILION ENERGY INC	5,586	40.86	228,243.96
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	44.41	430,643.77
BARRICK GOLD CORP	50,240	13.50	678,240.00
CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	62.65	335,678.70
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	15.28	483,948.16
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	82.67	667,312.24
GOLDCORP INC	40,330	13.78	555,747.40
KINROSS GOLD CORP	57,099	3.96	226,112.04
LUNDIN MINING CORP	28,209	6.52	183,922.68
METHANEX CORPORATION	2,452	99.60	244,219.20
NUTRIEN LTD	28,662	75.38	2,160,541.56
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	23,969	30.74	736,807.06
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	2.80	126,299.60
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	86.11	247,394.03
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	21.24	415,836.72
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	4.57	346,643.64
CAE INC	13,932	26.25	365,715.00
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	30.24	184,917.60
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	52.51	433,207.50
WSP GLOBAL INC	4,524	70.15	317,358.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,541	114.27	3,718,460.07
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,397	267.90	1,713,756.30
LINAMAR CORP	2,200	59.76	131,472.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	69.75	1,021,209.75
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	39.73	360,192.18
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,162	75.55	692,189.10
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	25.56	495,327.24
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,029	157.24	476,279.96
DOLLARAMA INC	14,424	42.58	614,173.92
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,360	66.00	1,211,760.00
EMPIRE CO LTD A	7,235	22.99	166,332.65
LOBLAW COMPANIES LTD	8,539	66.75	569,978.25
METRO INC	11,273	40.41	455,541.93

	WESTON (GEORGE) LTD	1,960	98.15	192,374.00
	SAPUTO INC	9,854	38.80	382,335.20
	AURORA CANNABIS INC	28,563	9.98	285,058.74
	BAUSCH HEALTH COS INC	14,555	29.40	427,917.00
	BANK OF MONTREAL	27,699	106.83	2,959,084.17
	BANK OF NOVA SCOTIA	53,195	76.10	4,048,139.50
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,150	122.86	2,352,769.00
	NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	64.90	955,003.50
	ROYAL BANK OF CANADA	62,722	103.52	6,492,981.44
	TORONTO-DOMINION BANK	80,536	79.17	6,376,035.12
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	37,852	55.51	2,101,164.52
	CI FINANCIAL CORP	11,041	20.28	223,911.48
	IGM FINANCIAL INC	3,023	35.95	108,676.85
	ONEX CORPORATION	4,217	91.81	387,162.77
	THOMSON REUTERS CORP	12,371	59.30	733,600.30
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	692.50	798,452.50
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	30.76	436,792.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	51.76	251,087.76
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	106.07	664,422.48
	MANULIFE FINANCIAL CORP	87,588	23.04	2,018,027.52
	POWER CORP OF CANADA	14,595	28.25	412,308.75
	POWER FINANCIAL CORP	11,076	29.72	329,178.72
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	50.86	1,313,408.64
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.43	133,734.78
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	13.20	312,853.20
	CGI GROUP INC - CL A	11,705	84.94	994,222.70
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	930.00	788,640.00
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	49.71	581,060.19
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,824	200.19	765,526.56
	BCE INC	6,928	52.60	364,412.80
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,965	68.27	1,089,930.55
	TELUS CORPORATION	7,611	48.37	368,144.07
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	38.68	117,200.40
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	31.50	202,135.50
	EMERA INC	2,409	41.50	99,973.50
	FORTIS INC	17,933	42.80	767,532.40
	HYDRO ONE LTD	15,052	19.87	299,083.24
	カナダドル 小計	1,799,934		78,330,097.35 (6,708,972,838)
ユーロ	ENAGAS	10,471	23.88	250,047.48
	ENI SPA	108,967	16.13	1,757,855.64
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,924	16.45	344,199.80

NESTE OYJ	5,632	71.60	403,251.20
OMV AG	6,314	45.17	285,203.38
REPSOL SA	58,987	16.93	998,649.91
SNAM SPA	99,978	3.71	371,318.29
TENARIS S.A.	23,321	13.90	324,161.90
TOTAL SA	104,973	53.71	5,638,099.83
VOPAK	3,130	43.39	135,810.70
AIR LIQUIDE SA	18,345	106.90	1,961,080.50
AKZO NOBEL	10,857	80.64	875,508.48
ARCELORMITTAL	29,490	25.63	755,828.70
ARKEMA	3,250	106.70	346,775.00
BASF SE	40,335	77.87	3,140,886.45
COVESTRO AG	8,053	69.20	557,267.60
CRH PLC	37,164	27.47	1,020,895.08
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	31.62	203,917.38
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	48.84	164,590.80
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	65.54	430,859.96
IMERYS SA	1,384	60.80	84,147.20
K+S AG	9,644	18.48	178,221.12
KONINKLIJKE DSM NV	7,986	89.46	714,427.56
LANXESS	4,159	64.56	268,505.04
LINDE AG - TENDER	7,910	192.20	1,520,302.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	10,196	35.16	358,491.36
SOLVAY SA	3,317	113.50	376,479.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	15.58	385,089.76
SYMRISE AG	4,995	79.34	396,303.30
THYSSENKRUPP AG	19,367	19.24	372,717.91
UMICORE	8,730	47.76	416,944.80
UPM-KYMMENE OYJ	23,383	32.95	770,469.85
VOESTALPINE AG	5,079	36.87	187,262.73
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,553	37.05	428,038.65
AIRBUS SE	25,110	106.30	2,669,193.00
ALSTOM RGPT	6,452	39.96	257,821.92
ANDRITZ AG	3,606	51.00	183,906.00
BOUYGUES SA	10,290	36.34	373,938.60
BRENTAG AG	6,629	53.46	354,386.34
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	10.17	439,153.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	36.45	775,145.70
DASSAULT AVIATION SA	89	1,592.00	141,688.00
EIFFAGE SA	3,580	97.46	348,906.80
FERROVIAL SA	22,426	18.24	409,050.24
GEA GROUP AG	8,178	31.23	255,398.94

HOCHTIEF AG	825	142.00	117,150.00
KION GROUP AG	3,179	53.54	170,203.66
KONE OYJ-B	14,652	45.87	672,087.24
LEGRAND SA	11,992	63.80	765,089.60
LEONARDO SPA	18,310	10.17	186,304.25
MAN SE	1,403	93.50	131,180.50
METSO OYJ	5,502	28.79	158,402.58
MTU AERO ENGINES AG	2,451	189.10	463,484.10
OSRAM LICHT AG	4,588	36.13	165,764.44
PRYSMIAN SPA	9,379	21.11	197,990.69
REXEL SA	12,854	12.75	163,952.77
SAFRAN SA	14,456	117.80	1,702,916.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,361	69.12	1,614,712.32
SIEMENS AG-REG	33,836	109.00	3,688,124.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	11,482	11.50	132,043.00
THALES SA	4,530	122.55	555,151.50
VINCI S.A.	22,403	80.58	1,805,233.74
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	16.70	315,680.10
BIC	1,337	77.40	103,483.80
BUREAU VERITAS SA	12,626	22.73	286,988.98
EDENRED	9,497	33.24	315,680.28
RANDSTAD NV	4,694	50.76	238,267.44
RELX PLC	43,033	17.62	758,241.46
TELEPERFORMANCE	2,489	168.80	420,143.20
WOLTERS KLUWER-CVA	12,856	53.18	683,682.08
AENA SME SA	2,881	148.50	427,828.50
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	183.30	246,721.80
ATLANTIA SPA	22,088	18.28	403,879.08
BOLLORE	39,433	3.62	142,747.46
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	22.86	211,683.60
DEUTSCHE POST AG-REG	41,384	31.37	1,298,216.08
FRAPORT AG	1,856	75.74	140,573.44
GETLINK	23,484	10.96	257,502.06
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	7.71	179,582.18
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	13.52	21,821.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,056	82.54	1,160,182.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	71.35	178,945.80
CONTINENTAL AG	4,655	151.10	703,370.50
DAIMLER AG	39,749	55.41	2,202,492.09
FAURECIA	3,127	51.38	160,665.26
FERRARI NV	5,395	112.95	609,365.25
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47,196	15.03	709,733.44

MICHELIN (CGDE)-B	7,634	103.90	793,172.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	34.67	190,927.69
PIRELLI & C SPA	17,484	7.22	126,269.44
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	6,624	55.56	368,029.44
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	23.57	615,671.97
RENAULT SA	8,755	73.84	646,469.20
SCHAEFFLER AG	9,576	11.07	106,006.32
VALEO SA	9,959	37.67	375,155.53
VOLKSWAGEN AG	1,256	142.20	178,603.20
VOLKSWAGEN AG PFD	8,314	144.48	1,201,206.72
ADIDAS AG	8,339	208.20	1,736,179.80
HERMES INTERNATIONAL	1,312	543.60	713,203.20
HUGO BOSS AG	3,149	69.22	217,973.78
KERING	3,379	441.00	1,490,139.00
LUXOTTICA GROUP SPA	7,229	55.66	402,366.14
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,208	288.15	3,517,735.20
MONCLER SPA	7,711	37.74	291,013.14
PUMA SE	281	423.00	118,863.00
SEB SA	1,032	152.60	157,483.20
ACCOR SA	7,551	42.62	321,823.62
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,960	77.05	305,118.00
SODEXO	3,900	91.20	355,680.00
AXEL SPRINGER SE	1,698	59.80	101,540.40
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	20.48	178,708.48
JC DECAUX SA	2,828	29.80	84,274.40
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	22.63	245,558.13
PUBLICIS GROUPE	9,116	51.42	468,744.72
RTL GROUP	1,615	63.50	102,552.50
SES	17,656	16.89	298,209.84
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	48.88	106,607.28
VIVENDI SA	45,432	21.55	979,059.60
INDITEX	48,190	26.22	1,263,541.80
ZALANDO SE	5,372	41.90	225,086.80
CARREFOUR SA	26,320	16.32	429,674.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	35.40	64,888.20
COLRUYT NV	3,100	52.00	161,200.00
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	13.01	159,632.70
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	54,058	19.76	1,068,402.31
METRO AG	8,344	13.71	114,396.24
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,966	76.66	2,527,173.56
DANONE	26,156	64.79	1,694,647.24
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	7.35	168,741.30

HEINEKEN HOLDING NV	5,292	79.85	422,566.20
HEINEKEN NV	11,685	82.10	959,338.50
KERRY GROUP PLC-A	6,855	96.05	658,422.75
PERNOD-RICARD SA	9,357	134.40	1,257,580.80
REMY COINTREAU	1,273	114.30	145,503.90
BEIERSDORF AG	4,089	98.04	400,885.56
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	92.10	431,120.10
HENKEL AG & CO KGAA	7,824	103.55	810,175.20
L'OREAL	11,013	201.50	2,219,119.50
UNILEVER NV-CVA	66,990	48.19	3,228,583.05
BIOMERIEUX	1,779	75.60	134,492.40
ESSILOR INTERNATIONAL	8,802	121.35	1,068,122.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	88.74	814,721.94
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,310	62.80	1,149,868.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,770	38.99	1,589,826.15
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	146.90	192,145.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	38.00	250,192.00
BAYER AG	39,678	72.90	2,892,526.20
EUROFINS SCIENTIFIC	484	485.20	234,836.80
GRIFOLS S.A.	11,922	23.68	282,312.96
IPSEN	1,807	145.45	262,828.15
MERCK KGAA	5,705	86.86	495,536.30
ORION OYJ	4,259	30.75	130,964.25
QIAGEN N.V.	10,011	32.16	321,953.76
RECORDATI SPA	4,578	29.75	136,195.50
SANOFI	50,032	75.10	3,757,403.20
UCB SA	5,753	78.14	449,539.42
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	23.62	446,795.92
AIB GROUP PLC	36,918	4.76	175,729.68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,821	5.50	1,611,393.96
BANCO DE SABADELL SA	235,029	1.39	328,805.57
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	708,624	4.33	3,069,050.54
BANK OF IRELAND GROUP PLC	43,692	7.46	326,160.78
BANKIA SA	48,396	3.42	165,562.71
BANKINTER,S.A.	26,969	7.82	211,005.45
BNP PARIBAS	49,754	51.83	2,578,749.82
CAIXABANK	166,584	4.15	692,323.10
COMMERZBANK AG	46,644	8.89	414,851.73
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	12.48	619,130.06
ERSTE GROUP BANK AG	13,095	37.00	484,515.00
ING GROEP NV-CVA	171,125	11.06	1,893,669.25

INTESA SANPAOLO	617,935	2.39	1,482,117.09
KBC GROUPE SA	10,878	65.50	712,509.00
MEDIOBANCA SPA	26,782	9.18	245,912.32
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	25.12	167,726.24
SOCIETE GENERALE	32,955	36.30	1,196,431.27
UNICREDIT SPA	89,256	13.73	1,226,020.41
AMUNDI SA	2,379	64.04	152,351.16
DEUTSCHE BANK AG -REG	87,576	9.85	863,411.78
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	117.60	967,495.20
EURAZEO	2,123	65.70	139,481.10
EXOR NV	4,683	55.40	259,438.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	88.68	299,295.00
NATIXIS	45,362	5.88	266,819.28
WENDEL	1,082	128.50	139,037.00
AEGON NV	74,580	5.23	390,053.40
AGEAS	8,915	43.98	392,081.70
ALLIANZ SE-REG	19,098	186.30	3,557,957.40
ASSICURAZIONI GENERALI	51,201	15.12	774,415.12
AXA SA	83,032	22.23	1,845,801.36
CNP ASSURANCES	8,978	19.33	173,544.74
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,386	118.30	282,263.80
MAPFRE SA	46,367	2.53	117,725.81
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,847	184.25	1,261,559.75
NN GROUP NV	12,995	37.64	489,131.80
POSTE ITALIANE SPA	26,562	6.97	185,349.63
SAMPO OYJ-A SHS	19,358	43.93	850,396.94
SCOR SE	7,100	38.70	274,770.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,822	42.77	676,706.94
VONOVIA SE	21,002	42.65	895,735.30
AMADEUS IT GROUP SA	19,271	78.94	1,521,252.74
ATOS SE	4,258	101.00	430,058.00
CAPGEMINI SA	6,963	107.50	748,522.50
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	130.55	721,810.95
DELIVERY HERO SE	3,417	43.40	148,297.80
SAP SE	43,413	102.90	4,467,197.70
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	3,523	94.04	331,302.92
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	41.87	250,424.47
WIRECARD AG	5,168	188.25	972,876.00
INGENICO S.A.	2,691	61.64	165,873.24
NOKIA OYJ	243,048	4.73	1,149,617.04
1&1 DRILLISCH AG	2,188	42.28	92,508.64
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,054	13.76	1,996,668.31

	ELISA OYJ	5,909	36.94	218,278.46
	ILIAD SA	1,016	114.75	116,586.00
	KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.26	320,754.56
	ORANGE S.A.	87,968	13.57	1,193,725.76
	PROXIMUS SA	6,313	20.65	130,363.45
	TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.54	271,636.93
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.49	124,055.04
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	3.58	144,610.52
	TELEFONICA S.A.	204,731	6.63	1,357,980.72
	E.ON SE	97,365	8.85	862,361.80
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	112,857	3.26	368,365.24
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	14.81	353,618.37
	ENDESA S.A.	12,944	19.02	246,194.88
	ENEL SPA	354,797	4.55	1,617,519.52
	ENGIE	80,639	12.44	1,003,552.35
	FORTUM OYJ	19,563	21.82	426,864.66
	IBERDROLA SA	260,570	6.32	1,648,365.82
	INNOGY SE	5,851	37.93	221,928.43
	NATURGY ENERGY GROUP SA	16,170	23.69	383,067.30
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	18,384	18.03	331,463.52
	RWE AG	22,852	21.59	493,374.68
	SUEZ	17,725	12.40	219,878.62
	TERNA SPA	66,384	4.74	314,660.16
	UNIPER SE	8,953	26.23	234,837.19
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	17.65	381,010.55
	ASML HOLDING NV	17,978	157.58	2,832,973.24
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	19.56	947,435.12
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	15.58	436,894.36
	ユーロ 小計	8,735,075		170,371,885.10 (22,235,234,724)
英債券	BP PLC	873,772	5.48	4,794,386.96
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	199,974	24.73	4,945,357.02
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	163,611	25.14	4,113,998.59
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	7.27	237,438.20
	ANGLO AMERICAN PLC	44,719	15.46	691,534.61
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.77	151,041.03
	BHP BILLITON PLC	89,998	15.33	1,379,669.34
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	51.28	319,115.44
	FRESNILLO PLC	8,512	7.88	67,091.58
	GLENCORE PLC	497,949	3.00	1,495,589.82
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,426	35.10	330,852.60
	MONDI PLC	17,158	21.28	365,122.24

RANDGOLD RESOURCES LTD	3,897	47.20	183,938.40
RIO TINTO PLC	52,904	36.05	1,907,189.20
ASHTED GROUP PLC	23,067	23.40	539,767.80
BAE SYSTEMS PLC	141,730	6.27	889,497.48
BUNZL PLC	13,431	24.12	323,955.72
DCC PLC	3,732	71.35	266,278.20
FERGUSON PLC	9,945	63.70	633,496.50
MEGGITT PLC	36,960	5.44	201,210.24
MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	2.18	465,337.62
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	9.82	704,461.21
SMITHS GROUP PLC	18,742	15.67	293,687.14
TRAVIS PERKINS PLC	9,272	11.15	103,382.80
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	16.37	151,010.25
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	6.96	79,704.97
EXPERIAN PLC	41,178	19.20	790,823.49
G4S PLC	74,291	2.34	174,212.39
INTERTEK GROUP PLC	6,794	48.52	329,644.88
RELX PLC	45,547	15.71	715,543.37
EASYJET PLC	7,630	14.38	109,757.55
ROYAL MAIL PLC	36,064	4.89	176,352.96
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.59	222,203.71
BURBERRY GROUP PLC	17,470	21.09	368,442.30
PERSIMMON PLC	13,916	23.83	331,618.28
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.70	220,986.64
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	36.27	193,536.72
CARNIVAL PLC	8,091	48.15	389,581.65
COMPASS GROUP PLC	70,275	16.41	1,153,564.12
GVC HOLDINGS PLC	23,842	9.95	237,227.90
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,601	46.33	352,154.33
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.90	127,265.31
TUI AG-DI	17,636	13.76	242,671.36
WHITBREAD PLC	7,771	46.90	364,459.90
INFORMA PLC	54,642	7.33	400,525.86
ITV PLC	151,064	1.58	238,681.12
PEARSON PLC	38,689	8.38	324,523.33
SKY PLC	46,118	15.73	725,436.14
WPP PLC	54,571	11.48	626,475.08
KINGFISHER PLC	100,357	2.66	266,949.62
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.84	203,204.80
NEXT PLC	6,971	53.72	374,482.12
SAINSBURY (J) PLC	64,136	3.21	206,325.51
TESCO PLC	426,993	2.35	1,003,860.54

WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.58	260,893.69
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	22.63	379,527.73
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	99,624	36.69	3,655,204.56
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	25.67	223,431.68
DIAGEO PLC	108,215	26.45	2,862,286.75
IMPERIAL BRANDS PLC	42,416	26.25	1,113,632.08
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,609	67.50	1,931,107.50
UNILEVER PLC	54,125	42.53	2,302,206.87
CONVATEC GROUP PLC	61,239	2.31	141,584.56
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	19,832	4.62	91,663.50
NMC HEALTH PLC	3,733	35.46	132,372.18
SMITH & NEPHEW PLC	39,633	14.02	555,654.66
ASTRAZENECA PLC	55,594	56.22	3,125,494.68
GLAXOSMITHKLINE PLC	217,148	14.87	3,230,293.64
SHIRE PLC	38,624	44.68	1,725,913.44
BARCLAYS PLC	759,705	1.71	1,300,159.13
HSBC HOLDINGS PLC	878,070	6.55	5,754,870.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,194,667	0.59	1,894,118.06
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	209,155	2.50	522,887.50
STANDARD CHARTERED PLC	122,489	6.08	744,733.12
3I GROUP PLC	44,300	9.33	413,673.40
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	22.24	245,485.12
INVESTEC PLC	33,008	5.06	167,020.48
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	47.51	616,537.27
SCHRODERS PLC	6,213	30.09	186,949.17
ST JAMES' S PLACE PLC	21,830	10.97	239,584.25
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	117,114	3.18	373,359.43
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	20.35	159,584.70
AVIVA PLC	180,213	4.78	861,418.14
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.21	203,600.71
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.52	629,575.18
PRUDENTIAL PLC	111,192	16.81	1,869,137.52
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	6.12	247,908.96
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	4.38	184,444.45
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	13.04	237,614.67
SAGE GROUP PLC/THE	49,630	5.81	288,449.56
BT GROUP PLC	365,274	2.28	835,746.91
VODAFONE GROUP PLC	1,179,668	1.68	1,982,785.97
CENTRICA PLC	254,915	1.45	370,773.86
NATIONAL GRID PLC	145,154	7.97	1,156,877.38
SEVERN TRENT PLC	9,868	19.00	187,492.00
SSE PLC	44,560	11.22	500,186.00

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,192	7.06	234,534.67
	英bond 小計	13,282,810		80,645,401.85 (11,854,874,071)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	24.04	242,828.04
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	611.50	196,291.50
	GIVAUDAN-REG	409	2,384.00	975,056.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,605	44.85	924,134.25
	SIKA AG	5,940	141.30	839,322.00
	ABB LTD	81,802	23.21	1,898,624.42
	GEBERIT AG-REG	1,593	449.50	716,053.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	229.40	235,135.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,701	234.60	399,054.60
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	57.80	405,698.20
	SGS SA	219	2,542.00	556,698.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	153.95	363,629.90
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,163	80.52	1,865,084.76
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	383.40	509,922.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	74.00	186,184.00
	DUFREY AG-REG	1,180	118.00	139,240.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,853.00	201,977.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,885.00	309,825.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	81,200.00	324,800.00
	NESTLE SA-REGISTERED	136,671	80.80	11,043,016.80
	SONOVA HOLDING AG	2,643	200.00	528,600.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	763.50	332,122.50
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	316.30	999,508.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	97,442	81.84	7,974,653.28
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,853	237.05	7,313,703.65
	VIFOR PHARMA AG	1,781	170.85	304,283.85
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	112,233	14.55	1,632,990.15
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	48.49	463,467.42
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	76.90	143,572.30
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	818	771.00	630,678.00
	UBS GROUP AG	170,531	15.13	2,580,134.03
	BALOISE HOLDING AG	1,987	147.80	293,678.60
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	356.90	525,356.80
	SWISS RE AG	13,294	87.90	1,168,542.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,458	299.20	1,932,233.60
	SWISS PRIME SITE-REG	3,061	85.05	260,338.05
	TEMENOS GROUP AG-REG	2,416	156.00	376,896.00
	SWISSCOM AG-REG	1,163	443.70	516,023.10
		759,287		50,309,356.90

スイスフラン 小計				(5,840,916,336)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	8,864	314.50	2,787,728.00
	BOLIDEN AB	12,103	230.25	2,786,715.75
	ALFA LAVAL AB	12,041	236.70	2,850,104.70
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	186.45	8,097,523.50
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,249	251.70	7,613,673.30
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,107	232.10	3,738,434.70
	EPIROC AB-A	30,249	93.66	2,833,121.34
	EPIROC AB-B	16,107	87.11	1,403,080.77
	SANDVIK AB	50,953	155.70	7,933,382.10
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	179.35	2,817,767.85
	SKF AB-B SHARES	16,642	172.50	2,870,745.00
	VOLVO AB-B SHS	69,797	154.40	10,776,656.80
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	156.45	1,914,009.30
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	193.55	2,137,953.30
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	74.44	1,384,062.92
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	536	337.20	180,739.20
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,248	143.64	5,206,662.72
	ICA GRUPPEN AB	3,550	275.70	978,735.00
	SWEDISH MATCH AB	7,555	467.20	3,529,696.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,240	235.80	6,187,392.00
	NORDEA BANK AB	131,614	96.60	12,713,912.40
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	71,784	96.82	6,950,126.88
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,942	107.20	7,497,782.40
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	212.60	8,297,778.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	190.75	1,195,239.50
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	408.50	8,127,107.50
KINNEVIK AB-B SHS	11,257	289.10	3,254,398.70	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,134	296.00	927,664.00	
ERICSSON LM-B SHS	136,331	77.00	10,497,487.00	
HEXAGON AB-B SHS	11,065	514.60	5,694,049.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	505.00	1,360,470.00	
TELE2 AB-B SHS	13,187	113.25	1,493,427.75	
TELIA CO AB	126,963	40.99	5,204,213.37	
スウェーデンクローナ 小計		1,081,417		151,241,840.75 (1,895,060,264)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	5,565	306.20	1,704,003.00
	EQUINOR ASA	49,847	217.00	10,816,799.00
	NORSK HYDRO ASA	60,434	45.27	2,735,847.18
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	377.40	2,827,480.80
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	268.00	998,032.00
	MARINE HARVEST ASA	18,939	185.10	3,505,608.90

	ORKLA ASA	33,915	68.64	2,327,925.60	
	DNB ASA	43,520	171.45	7,461,504.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6,997	139.00	972,583.00	
	TELENOR ASA	33,605	164.00	5,511,220.00	
	ノルウェークローネ 小計	264,038		38,861,003.48 (531,229,917)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	627.40	2,569,830.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,279	348.80	3,585,315.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,608	415.80	3,995,006.40	
	ISS A/S	6,409	216.60	1,388,189.40	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,280.00	1,391,040.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	8,834.00	2,606,030.00	
	DSV A/S	8,324	592.40	4,931,137.60	
	PANDORA A/S	4,763	377.50	1,798,032.50	
	CARLSBERG AS-B	4,678	757.20	3,542,181.60	
	COLOPLAST-B	4,991	663.60	3,312,027.60	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	256.00	1,140,480.00	
	GENMAB A/S	2,773	1,062.50	2,946,312.50	
	H LUNDBECK A/S	3,618	389.80	1,410,296.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	76,713	303.20	23,259,381.60	
	DANSKE BANK A/S	32,840	168.85	5,545,034.00	
TRYG A/S	5,005	156.80	784,784.00		
ORSTED A/S	7,743	406.00	3,143,658.00		
	デンマーククローネ 小計	186,758		67,348,737.20 (1,177,929,413)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,579	29.69	373,470.51	
	OIL SEARCH LTD	60,868	8.85	538,681.80	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	8.35	622,801.45	
	SANTOS LTD	80,415	7.08	569,338.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,184	37.07	1,415,480.88	
	ALUMINA LTD	106,977	2.75	294,186.75	
	AMCOR LIMITED	50,321	13.76	692,416.96	
	BHP BILLITON LTD	141,042	31.61	4,458,337.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	16.40	378,659.60	
	BORAL LIMITED	55,663	6.91	384,631.33	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	3.61	263,024.60	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	4.00	341,624.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	21.23	396,809.93	
	NEWCREST MINING LIMITED	31,386	19.56	613,910.16	
	ORICA LIMITED	17,981	16.52	297,046.12	
RIO TINTO LIMITED	17,862	73.01	1,304,104.62		
SOUTH32 LTD	223,474	3.81	851,435.94		

CIMIC GROUP LTD	4,062	50.59	205,496.58
BRAMBLES LIMITED	72,482	11.04	800,201.28
SEEK LIMITED	12,504	20.97	262,208.88
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.21	365,781.64
ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,068	29.13	759,360.84
CROWN RESORTS LTD	16,521	13.68	226,007.28
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	2,137	53.00	113,261.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	55.55	147,207.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	74,374	4.91	365,176.34
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.51	72,105.93
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD RTS	1,208	0.93	1,123.44
WESFARMERS LIMITED	49,585	50.94	2,525,859.90
WOOLWORTHS GROUP LTD	55,613	27.45	1,526,576.85
COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,828	9.55	256,207.40
TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	17.84	570,594.56
COCHLEAR LIMITED	2,657	203.80	541,496.60
HEALTHSCOPE LTD	76,014	2.06	156,588.84
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	55.33	341,662.75
SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	25.02	446,281.74
CSL LIMITED	19,686	208.23	4,099,215.78
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	127,749	28.40	3,628,071.60
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	11.44	204,215.44
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.66	211,505.06
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	77,456	71.75	5,557,468.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	117,468	27.56	3,237,418.08
WESTPAC BANKING CORPORATION	146,383	27.90	4,084,085.70
AMP LIMITED	129,763	3.20	415,241.60
ASX LTD	9,287	63.97	594,089.39
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	10.67	245,644.74
MACQUARIE GROUP LTD	14,151	125.10	1,770,290.10
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	103,486	7.36	761,656.96
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.88	370,725.12
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	11.03	642,243.81
SUNCORP GROUP LTD	59,211	14.45	855,598.95
COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	19.50	379,431.00
REA GROUP LTD	2,727	83.96	228,958.92
TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.24	549,928.44
TPG TELECOM LTD	17,758	8.72	154,849.76
AGL ENERGY LIMITED	29,039	19.36	562,195.04
AUSNET SERVICES	85,220	1.61	137,204.20
オーストラリアドル 小計	3,073,749		52,169,197.51 (4,178,752,720)

ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	31,032	6.37	197,673.84
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	46,513	6.97	324,195.61
	A2 MILK CO LTD	31,976	12.29	392,985.04
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	15.09	331,663.11
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	13.55	268,561.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.98	318,034.88
	MERIDIAN ENERGY LTD	63,346	3.30	209,041.80
ニュージーランドドル 小計		294,474		2,042,155.28 (150,037,148)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,924	91.05	10,919,080.20
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	14.22	988,290.00
	MTR CORPORATION	67,000	41.80	2,800,600.00
	MINTH GROUP LTD	32,000	30.25	968,000.00
	LI & FUNG LTD	237,200	1.95	462,540.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	49.95	2,797,200.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	21.50	580,500.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	106,000	49.15	5,209,900.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	12.72	559,680.00
	SANDS CHINA LTD	107,200	35.65	3,821,680.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	11.48	734,720.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.22	577,600.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	19.44	1,376,352.00
	WH GROUP LIMITED	397,500	5.35	2,126,625.00
	BANK OF EAST ASIA	52,820	29.00	1,531,780.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	157,000	35.60	5,589,200.00
	HANG SENG BANK LTD	33,100	207.00	6,851,700.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,700	217.80	11,260,260.00
	AIA GROUP LTD	529,000	64.35	34,041,150.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,924	60.20	6,858,224.80
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	21.15	888,300.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	15.04	1,473,920.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	61,622	39.85	2,455,636.70
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	40.55	1,175,950.00
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	27.55	757,625.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	10.04	2,623,783.32
	SINO LAND CO	124,200	13.44	1,669,248.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	69,000	116.20	8,017,800.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,500	86.45	2,118,025.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	30.40	1,611,200.00
WHARF HOLDINGS LTD	59,000	21.55	1,271,450.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	52.30	2,510,400.00	
WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	48.10	1,587,300.00	

	PCCW LIMITED	194,000	4.28	830,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	62.00	1,860,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	74,600	94.35	7,038,510.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.90	876,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	387,286	15.78	6,111,373.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	56.30	3,378,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	76.60	942,180.00	
	香港ドル 小計	4,215,009		149,253,003.10 (2,128,347,824)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	6.46	378,556.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	43,720	2.86	125,039.20	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.50	239,050.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.09	98,100.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.33	249,310.00	
	SATS LTD	26,800	4.93	132,124.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	9.57	239,881.62	
	GENTING SINGAPORE LTD	280,700	1.02	286,314.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,350	2.76	155,526.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	30.78	144,666.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.24	86,632.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.14	219,486.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	24.79	1,906,351.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	139,100	11.05	1,537,055.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,500	25.97	1,545,215.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.27	258,812.00	
	CAPITALAND LTD	104,500	3.28	342,760.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.80	141,680.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	6.88	149,296.00	
	VENTURE CORP LTD	11,900	16.51	196,469.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,515	3.11	1,105,651.65	
	シンガポールドル 小計	2,005,551		9,537,974.47 (776,104,982)	
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	375.10	690,934.20	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	21,574	21.60	465,998.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	805	468.50	377,142.50	
	BANK HAPUALIM BM	44,062	26.47	1,166,321.14	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	23.73	1,556,071.02	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	65.31	355,417.02	
	AZRIELI GROUP	2,140	189.00	404,460.00	
	NICE LTD	2,768	429.50	1,188,856.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	4.35	436,013.89	
		244,325		6,641,214.17	

イスラエルシェケル 小計			(207,670,767)
合 計	49,360,427		180,812,175,751 (180,812,175,751)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 600銘柄	64.6%	68.1%
カナダドル	株式 88銘柄	3.5%	3.7%
ユーロ	株式 241銘柄	11.7%	12.3%
英ポンド	株式 97銘柄	6.2%	6.6%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.1%	3.2%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 40銘柄	1.1%	1.2%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.4%	0.4%
イスラエルシェケル	株式 9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	17,476	329,946.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	551,911.08	
		AMERICAN TOWER CORP	19,224	2,840,346.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	46,842	480,130.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,026	1,113,182.98	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,005	889,705.05	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	11,010	221,961.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	403,159.68	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,934	1,093,432.26	
		DUKE REALTY CORP	16,657	483,219.57	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,005	1,094,742.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	668,076.25	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	482,774.60	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	420,957.68	
		HCP, INC.	20,162	539,131.88	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	686,255.20	
INVITATION HOMES INC	14,734	349,343.14			

	IRON MOUNTAIN INC	12,165	435,263.70
	KIMCO REALTY CORPORATION	20,926	355,114.22
	LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	299,793.60
	MACERICH COMPANY/THE	5,229	297,791.55
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	490,748.08
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	290,580.64
	PROLOGIS INC	27,546	1,859,905.92
	PUBLIC STORAGE	6,879	1,432,345.38
	REALTY INCOME CORPORATION	11,714	681,403.38
	REGENCY CENTERS CORP	6,080	398,179.20
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,939	2,557,248.94
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	400,693.65
	UDR INC	10,651	431,685.03
	VENTAS INC	14,830	865,775.40
	VEREIT INC	44,740	340,471.40
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	572,125.75
	WELLTOWER INC	16,264	1,086,597.84
	WEYERHAEUSER CO	33,634	1,142,546.98
	米ドル 小計	490,249	26,586,547.01 (2,973,173,552)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,257	149,131.35
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	190,936.06
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	113,787.90
	カナダドル 小計	18,283	453,855.31 (38,872,707)
ユーロ	COVIVIO	1,550	139,035.00
	GECINA SA	2,152	315,052.80
	ICADE	1,265	103,856.50
	KLEPIERRE	9,305	282,872.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,937	1,038,025.08
	ユーロ 小計	20,209	1,878,841.38 (245,207,588)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,136	259,473.48
	HAMMERSON PLC	34,414	157,960.26
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	290,402.64
	SEGRO PLC	40,873	264,039.58
	英ポンド 小計	150,126	971,875.96 (142,865,766)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	475,160.34
	DEXUS	47,512	515,030.08

	GOODMAN GROUP		73,716	794,658.48	
	GPT GROUP		69,713	372,964.55	
	LENLEASE GROUP		25,262	494,629.96	
	MIRVAC GROUP		140,993	345,432.85	
	SCENTRE GROUP		234,290	974,646.40	
	STOCKLAND		103,417	433,317.23	
	SYDNEY AIRPORT		49,760	360,760.00	
	TRANSURBAN GROUP		98,626	1,118,418.84	
	TRANSURBAN GROUP-RIGHT		17,302	8,997.04	
	VICINITY CENTRES		146,656	400,370.88	
	オーストラリアドル 小計		1,055,634	6,294,386.65	(504,180,370)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD		182,000	1,885,520.00	
	LINK REIT		92,500	7,011,500.00	
	香港ドル 小計		274,500	8,897,020.00	(126,871,505)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		118,300	307,580.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		130,000	228,800.00	
	CAPITALAND MALL TRUST		102,800	219,992.00	
	SUNTEC REIT		112,900	209,994.00	
	シンガポールドル 小計		464,000	966,366.00	(78,633,201)
合計				4,109,804,689	(4,109,804,689)

（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 35銘柄	1.6%	72.3%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	6.0%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	3.5%
オーストラリアドル	投資証券 12銘柄	0.3%	12.3%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	3.1%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.9%

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。

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）	
（平成30年 9月18日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	16,839,875
コール・ローン	1,602,494,959
株式	1,925,299,382
投資信託受益証券	120,711,654
投資証券	10,288,784
派生商品評価勘定	12,146,017
未収入金	47,497
未収配当金	4,051,632
前払金	9,329,418
差入委託証拠金	386,304,953
流動資産合計	4,087,514,171
資産合計	4,087,514,171
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,329,516
未払金	28,716
未払解約金	2,000,000
未払利息	4,511
その他未払費用	5,880
流動負債合計	11,368,623
負債合計	11,368,623
純資産の部	
元本等	
元本	3,133,325,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	942,819,745
元本等合計	4,076,145,548
純資産合計	4,076,145,548
負債純資産合計	4,087,514,171

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
-----	--------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、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>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,133,325,803口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3009円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,009円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<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、国債証券、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>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,031,629,589	-	2,022,300,171	9,329,418
	MSCIE 1812	2,031,629,589	-	2,022,300,171	9,329,418
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,606,714,806	-	1,618,860,563	12,145,757
	米ドル	1,606,714,806	-	1,618,860,563	12,145,757
	売建	14,806	-	14,644	162
	ポーランドズロチ	5,477	-	5,463	14
	南アフリカランド	9,329	-	9,181	148
合計		3,638,359,201	-	3,641,175,378	2,816,501

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	2,841,907,685円
同期中における追加設定元本額	3,769,857,080円
同期中における一部解約元本額	3,478,438,962円
平成30年 9月18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	787,579,596円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,177,336,085円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	90,133,963円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,834,614円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	449,200,392円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,442,121円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,894,371円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,156,052円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	13,440,044円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	15,067,718円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	60,808,108円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,302,914円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	20,129,825円
合計	3,133,325,803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	3,900	1.08	4,227.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	700	12.32	8,624.00	
	SOUTHERN COPPER CORPORATION	300	41.10	12,330.00	
	51JOB INC-ADR	92	67.56	6,215.52	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	487	27.57	13,426.59	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	500	68.76	34,380.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,200	24.99	29,988.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,400	33.31	46,634.00	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	1,400	37.14	51,996.00	
	JD.COM INC-ADR	2,683	25.73	69,033.59	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	1,500	5.99	8,985.00	
	CREDICORP LTD	252	215.11	54,207.72	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	106	39.02	4,136.12	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	3,400	1.32	4,518.60	
	58.COM INC-ADR	300	71.30	21,390.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	4,249	158.89	675,123.61	
	AUTOHOME INC-ADR	200	76.00	15,200.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,026	217.66	223,319.16	
	BAOZUN INC-SPN-ADR	134	44.59	5,975.06	
	FANG HOLDINGS LTD-ADR	777	2.50	1,942.50	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	218	33.50	7,303.00	
MOMO INC-SPON ADR	400	46.01	18,404.00		
NETEASE.COM INC -ADR	300	198.37	59,511.00		
SINA CORP	200	64.81	12,962.00		
WEIBO CORP-SPON ADR	200	72.41	14,482.00		
YY INC-ADR	200	70.15	14,030.00		
	米ドル 小計	26,124		1,418,345.07 (158,613,529)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	53,400	13.38	714,492.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	14,000	52.81	739,340.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	510	331.02	168,820.20	
	MEXICHEM SAB DE CV	3,800	63.36	240,768.00	
	ALFA S.A.B. -A	11,100	24.55	272,505.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	1,700	63.06	107,202.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	760	377.93	287,226.80	

	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,300	199.59	259,467.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	835	201.49	168,244.15
	ALSEA SAB DE CV	1,900	65.69	124,811.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	9,000	70.30	632,700.00
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	700	138.79	97,153.00
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	19,200	54.73	1,050,816.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,600	117.04	187,264.00
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	1,800	112.18	201,924.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	7,100	185.18	1,314,778.00
	GRUMA S.A.B. -B	795	238.14	189,321.30
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	6,000	40.00	240,000.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	5,600	32.20	180,320.00
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	6,695	28.78	192,682.10
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	9,100	133.02	1,210,482.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	8,500	30.29	257,465.00
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	123,300	15.55	1,917,315.00
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	2,000	91.95	183,900.00
	メキシコペソ 小計	290,695		10,938,996.55 (64,758,859)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	600	33.32	19,992.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	10,900	22.47	244,923.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	14,400	19.40	279,360.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,300	39.31	51,103.00
	BRASKEM SA-PREF A	600	61.50	36,900.00
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. -CSN	2,300	8.64	19,872.00
	FIBRIA CELULOSE SA	900	76.60	68,940.00
	GERDAU S.A. -PREF	3,800	15.63	59,394.00
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,600	51.40	82,240.00
	VALE SA	11,600	55.04	638,464.00
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	2,400	19.23	46,152.00
	WEG SA	2,730	19.30	52,689.00
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	4,400	8.80	38,720.00
	LOCALIZA RENT A CAR SA	1,800	22.32	40,176.00
	RUMO SA	4,000	14.20	56,800.00
	KROTON EDUCACIONAL SA	5,100	9.88	50,388.00
	LOJAS AMERICANAS SA	2,700	14.87	40,149.00
	LOJAS RENNER S.A.	2,600	30.12	78,312.00
	MAGAZINE LUIZA SA	300	118.89	35,667.00
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	1,300	19.72	25,636.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	1,500	14.35	21,525.00
	COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	600	78.46	47,076.00
	RAIA DROGASIL SA	800	77.47	61,976.00

	AMBEV SA	17,300	18.36	317,628.00
	BRF-BRASIL FOODS SA	1,600	21.85	34,960.00
	JBS SA	3,000	9.31	27,930.00
	M DIAS BRANCO SA	400	40.58	16,232.00
	NATURA COSMETICOS SA	600	27.95	16,770.00
	ODONTOPREV S.A.	1,000	12.98	12,980.00
	HYPERMARCAS SA	1,300	28.08	36,504.00
	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	12,320	28.50	351,120.00
	BANCO BRADESCO SA	3,740	24.97	93,387.80
	BANCO DO BRASIL S.A.	3,100	28.45	88,195.00
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	11,800	43.13	508,934.00
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	16,280	9.78	159,218.40
	BM&F BOVESPA SA	7,500	22.12	165,900.00
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2,600	23.26	60,476.00
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	400	63.00	25,200.00
	PORTO SEGURO SA	400	57.34	22,936.00
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	3,000	9.61	28,830.00
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	900	18.45	16,605.00
	CIELO SA	4,500	14.19	63,855.00
	TELEFONICA BRASIL SA	1,600	40.35	64,560.00
	TIM PARTICIPACOES SA	3,100	11.95	37,045.00
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	800	15.31	12,248.00
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	800	18.20	14,560.00
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,200	6.96	22,272.00
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	1,300	24.16	31,408.00
	EDP-ENERGIAS DO BRASIL SA	1,100	12.92	14,212.00
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	600	36.38	21,828.00
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	700	58.34	40,838.00
	ブラジルリアル 小計	183,170		4,403,086.20 (119,059,450)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	1,428	10,422.00	14,882,616.00
	EMPRESAS CMPC SA	4,579	2,669.50	12,223,640.50
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	353	31,380.00	11,077,140.00
	LATAM AIRLINES GROUP	1,111	6,241.00	6,933,751.00
	S.A.C.I. FALABELLA	2,668	5,479.80	14,620,106.40
	CENCOSUD SA	5,244	1,587.00	8,322,228.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	541	9,097.30	4,921,639.30
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	954	2,564.30	2,446,342.20
	BANCO DE CHILE	93,105	99.02	9,219,257.10
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	162	44,374.00	7,188,588.00
	BANCO SANTANDER CHILE	241,600	53.40	12,901,440.00
	ITAU CORPBANCA	563,090	6.75	3,805,362.22

	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	553	5,620.80	3,108,302.40
	AGUAS ANDINAS SA-A	9,579	367.08	3,516,259.32
	COLBUN SA	28,906	144.85	4,187,034.10
	ENEL AMERICAS SA	105,226	104.31	10,976,124.06
	ENEL CHILE SA	71,932	66.05	4,751,108.60
	チリペソ 小計	1,131,031		135,080,939.20 (22,004,684)
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	18,073	3,870.00	69,942,510.00
	CEMENTOS ARGOS SA	1,687	7,630.00	12,871,810.00
	GRUPO ARGOS SA	1,064	17,180.00	18,279,520.00
	BANCOLOMBIA SA	840	30,820.00	25,888,800.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,656	30,580.00	50,640,480.00
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	12,922	1,150.00	14,860,300.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	859	34,700.00	29,807,300.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	414	33,700.00	13,951,800.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,420	13,120.00	18,630,400.00
	コロンビアペソ 小計	38,935		254,872,920.00 (9,430,298)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	169	19.88	3,359.72
	OPAP SA	818	9.01	7,370.18
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	4.80	590.40
	JUMBO S.A.	374	12.58	4,704.92
	ALPHA BANK AE	5,089	1.31	6,712.39
	EUROBANK ERGASIAS SA	6,806	0.62	4,229.92
	NATIONAL BANK OF GREECE	2,010	1.77	3,575.79
	PIRAEUS BANK S.A.	1,040	2.06	2,150.72
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	898	10.48	9,411.04
	ユーロ 小計	17,327		42,105.08 (5,495,133)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	459	131.50	60,358.50
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	5,128	11.09	56,869.52
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	2,720	5.63	15,313.60
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	733	26.40	19,351.20
	KOC HOLDING AS	2,787	16.21	45,177.27
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	2,885	5.85	16,877.25
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	599	30.50	18,269.50
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	2,022	17.66	35,708.52
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	59.50	15,291.50
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	458	22.30	10,213.40
	ARCELIK AS	866	13.39	11,595.74
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	778	77.50	60,295.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	21.62	16,409.58

	COCA-COLA ICECEK AS	280	31.16	8,724.80
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	564	15.82	8,922.48
	AKBANK T.A.S.	8,059	5.84	47,064.56
	TURKIYE GARANTI BANKASI	8,462	6.13	51,872.06
	TURKIYE HALK BANKASI A.S.	2,289	5.98	13,688.22
	TURKIYE IS BANKASI-C	5,769	3.90	22,499.10
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	2,747	3.11	8,543.17
	YAPI VE KREDI BANKASI	6,188	1.69	10,457.72
	HACI OMER SABANCI HOLDING	3,363	6.97	23,440.11
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	4,029	11.17	45,003.93
	トルコリラ 小計	62,201		621,946.73 (10,996,018)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	278	904.50	251,451.00
	MONETA MONEY BANK AS	1,778	80.05	142,328.90
	O2 CZECH REPUBLIC AS	227	261.50	59,360.50
	CEZ AS	591	567.00	335,097.00
	チェココルナ 小計	2,874		788,237.40 (4,043,657)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	1,351	2,846.00	3,844,946.00
	RICHTER GEDEON NYRT	512	5,050.00	2,585,600.00
	OTP BANK PLC	872	9,895.00	8,628,440.00
	ハンガリーフォリント 小計	2,735		15,058,986.00 (6,046,182)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	339	74.98	25,418.22
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,097	100.45	110,193.65
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	6,350	5.93	37,655.50
	GRUPA AZOTY SA	164	31.60	5,182.40
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	194	66.12	12,827.28
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	513	82.90	42,527.70
	CCC SA	106	217.80	23,086.80
	LPP SA	5	8,750.00	43,750.00
	CYFROWY POLSAT SA	820	21.86	17,925.20
	DINO POLSKA SA	180	95.00	17,100.00
	ALIOR BANK SA	331	61.20	20,257.20
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	120	66.50	7,980.00
	BANK MILLENNIUM SA	2,222	8.20	18,220.40
	BANK PEKAO SA	577	107.10	61,796.70
	MBANK SA	54	401.60	21,686.40
	PKO BANK POLSKI SA	3,434	39.86	136,879.24
	SANTANDER BANK POLSKA SA	127	362.40	46,024.80
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,214	39.00	86,346.00
	CD PROJEKT SA	246	181.20	44,575.20

	ORANGE POLSKA SA	2,404	4.26	10,241.04
	PLAY COMMUNICATIONS SA	418	20.20	8,443.60
	PGE SA	3,082	8.84	27,244.88
	ポーランドズロチ 小計	24,997		825,362.21 (25,057,996)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY COMPANY - H	4,000	3.13	12,520.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	6,000	7.80	46,800.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	94,000	7.56	710,640.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	12,500	16.44	205,500.00
	CNOOC LTD	65,000	14.50	942,500.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	12,000	8.88	106,560.00
	PETROCHINA CO LTD	78,000	6.00	468,000.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	6,000	8.22	49,320.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	14,000	3.23	45,220.00
	ANGANG STEEL CO LTD-H	4,000	6.84	27,360.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,500	43.10	193,950.00
	BBMG CORPORATION - H	9,000	2.49	22,410.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD	15,000	2.95	44,250.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	14,000	6.43	90,020.00
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LIMITED	8,000	8.61	68,880.00
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	2,800	3.52	9,856.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	5,000	8.59	42,950.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	7.52	45,120.00
	MMG LIMITED	8,000	3.78	30,240.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	6,000	8.80	52,800.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	12,000	4.41	52,920.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD-H	2,000	6.01	12,020.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	22,000	2.66	58,520.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	8,000	4.76	38,080.00
	BOC AVIATION LTD	800	58.90	47,120.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	16,000	7.31	116,960.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	6,000	24.60	147,600.00
	CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS-H	1,600	8.03	12,848.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	15,000	6.93	103,950.00
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	7,000	9.42	65,940.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	8,000	7.50	60,000.00
	CITIC LIMITED	21,000	11.08	232,680.00
	CRRC CORP LTD-H	15,000	6.52	97,800.00
	FOSUN INTERNATIONAL	9,500	13.40	127,300.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	2,000	15.56	31,120.00
	METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA LTD-H	11,000	1.96	21,560.00
	SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	10,000	2.50	25,000.00

SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	17.30	34,600.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	5,000	8.14	40,700.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	1,000	15.30	15,300.00
WEICHAJ POWER CO	7,000	9.02	63,140.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,200	7.84	17,248.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	2,000	42.45	84,900.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	9,000	6.18	55,620.00
GREENTOWN SERVICE GROUP	4,000	5.98	23,920.00
AIR CHINA/HONG KONG	6,000	6.79	40,740.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	6,000	8.84	53,040.00
CAR INC	3,000	6.27	18,810.00
CHINA COSCO HOLDINGS COMPANY LIMITED -H	9,500	3.03	28,785.00
CHINA EASTERN AIRLINES-H SHR	6,000	4.73	28,380.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	4,140	14.92	61,768.80
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES CO LTD-H	7,000	1.03	7,210.00
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	2,000	3.62	7,240.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	6,000	4.70	28,200.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	6,000	7.42	44,520.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	4,000	9.44	37,760.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS LTD	3,500	14.44	50,540.00
SINOTRANS LIMITED	8,000	2.88	23,040.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	6,000	5.66	33,960.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	6,500	5.54	36,010.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	12,000	11.96	143,520.00
BYD CO LTD-H	2,500	48.50	121,250.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	12,000	4.14	49,680.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	1,300	6.30	8,190.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	10,000	7.93	79,300.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,000	26.80	53,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	18,000	14.72	264,960.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	11,500	4.53	52,095.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	11,200	7.87	88,144.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	3,000	11.64	34,920.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	4,000	34.35	137,400.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	19.24	96,200.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	40,000	0.29	11,800.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,000	92.55	277,650.00
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	2,000	2.20	4,400.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	4,000	2.43	9,720.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	50,000	1.03	51,500.00
CHINA LITERATURE LTD	600	45.50	27,300.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.75	29,250.00

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	2,000	16.82	33,640.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	8,500	8.76	74,460.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	4,000	2.89	11,560.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	10,000	22.40	224,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	6,000	29.95	179,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	7,500	5.57	41,775.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	8,000	13.30	106,400.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	33.20	66,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	5,000	7.50	37,500.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	18,000	6.44	115,920.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	2,500	67.65	169,125.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	12,000	7.39	88,680.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	7.33	58,640.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	3,200	19.14	61,248.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	4,400	37.40	164,560.00
3SBIO INC	3,500	12.80	44,800.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	5,000	10.14	50,700.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	18,000	16.14	290,520.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	7,000	12.10	84,700.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HLDGS	8,000	5.06	40,480.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	2,000	14.76	29,520.00
LUYE PHARMA GROUP	4,500	6.42	28,890.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	2,000	28.20	56,400.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	14,000	1.53	21,420.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	17,000	7.13	121,210.00
SSY GROUP LIMITED	2,000	6.64	13,280.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	1,000	11.46	11,460.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,500	71.15	106,725.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	108,000	3.64	393,120.00
BANK OF CHINA LTD	291,000	3.39	986,490.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	32,000	5.63	180,160.00
CHINA CITIC BANK	33,000	4.68	154,440.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	357,000	6.51	2,324,070.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	9,000	3.25	29,250.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	14,500	28.70	416,150.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	24,600	5.47	134,562.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	9,000	4.14	37,260.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	258,000	5.42	1,398,360.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD-H	10,000	4.61	46,100.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	32,000	1.87	59,840.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	4,000	13.42	53,680.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	12,000	3.52	42,240.00

CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	37,000	1.41	52,170.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD-H	4,000	14.48	57,920.00
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	64,000	0.47	30,400.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	8,500	13.12	111,520.00
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	7.18	50,260.00
GF SECURITIES CO LTD-H	5,000	9.61	48,050.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD-H	2,200	15.40	33,880.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	12,000	7.10	85,200.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6,000	10.30	61,800.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	27,000	16.90	456,300.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	9,600	27.45	263,520.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	21,000	1.44	30,240.00
CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	6,000	25.10	150,600.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	3,000	34.40	103,200.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	26,000	3.22	83,720.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	24,000	8.40	201,600.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	19,500	74.55	1,453,725.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	600	31.95	19,170.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	6,000	11.22	67,320.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	10,000	26.40	264,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	20,000	3.52	70,400.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	14,000	23.75	332,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	26.65	266,500.00
CHINA VANKE CO LTD -H	4,300	25.30	108,790.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	12,000	3.75	45,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	28,000	10.72	300,160.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS	4,000	12.80	51,200.00
FULLSHARE HOLDING LTD	25,000	3.41	85,250.00
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	6,000	5.35	32,100.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	3,000	7.43	22,290.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	3,600	14.44	51,984.00
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	4,000	14.18	56,720.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	8,000	2.56	20,480.00
KWG GROUP HOLDINGS LIMITED	4,500	7.51	33,795.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	6,000	8.91	53,460.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	5,500	21.00	115,500.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	12,000	2.30	27,600.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	4,500	20.65	92,925.00
SHUI ON LAND LIMITED	13,500	1.77	23,895.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	11,000	3.58	39,380.00
SOHO CHINA LTD	7,500	2.99	22,425.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	9,000	24.20	217,800.00

YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	26,000	1.36	35,360.00	
YUZHOU PROPERTIES COMPANY	6,000	3.30	19,800.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP	4,000	8.21	32,840.00	
KINGSOFT CORPORATION LTD.	3,000	13.94	41,820.00	
TENCENT HOLDINGS LIMITED	20,900	319.20	6,671,280.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	18.96	56,880.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	2,500	77.55	193,875.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	2,500	9.52	23,800.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	3,000	5.53	16,590.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	2,500	23.90	59,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING LTD	2,000	6.55	13,100.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	600	24.40	14,640.00	
LENOVO GROUP LTD	26,000	5.37	139,620.00	
MEITU INC	4,500	5.16	23,220.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,600	90.95	236,470.00	
ZTE CORPORATION	2,600	13.88	36,088.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	7.10	56,800.00	
CHINA MOBILE LTD	23,000	76.05	1,749,150.00	
CHINA TELECOM CORP LTD	50,000	3.77	188,500.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	126,000	1.17	147,420.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	22,000	9.32	205,040.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	2,000	38.40	76,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	20,000	3.85	77,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	39,000	1.84	71,760.00	
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	6,400	23.55	150,720.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	12,000	6.30	75,600.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	16,000	1.66	26,560.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	4,000	35.25	141,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	8,000	13.42	107,360.00	
DATANG INTL POWER GENERATION COMPANY LTD	12,000	1.94	23,280.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,000	70.50	211,500.00	
GUANGDONG INVESTMENT	10,000	13.42	134,200.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	2,000	2.84	5,680.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	16,000	5.00	80,000.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	18,000	2.26	40,680.00	
TOWNGAS CHINA CO LTD	4,000	7.12	28,480.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	48,000	0.53	25,440.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LIMITED	2,000	15.94	31,880.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONA	11,000	8.40	92,400.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	12,000	2.23	26,760.00	
香港ドル 小計	3,368,240		32,515,951.80 (463,677,472)	

マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	11,400	3.50	39,900.00
	PETRONAS DAGANGAN BHD	900	26.38	23,742.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	8,800	9.46	83,248.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	4,800	4.77	22,896.00
	GAMUDA BHD	6,300	3.42	21,546.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,300	9.86	22,678.00
	IJM CORP BHD	10,600	1.85	19,610.00
	SIME DARBY BERHAD	8,700	2.59	22,533.00
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	3.13	17,215.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	3,000	9.00	27,000.00
	MISC BHD	4,900	5.89	28,861.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	3.75	13,875.00
	UMW HOLDINGS BHD	1,700	5.32	9,044.00
	GENTING BHD	8,500	8.01	68,085.00
	GENTING MALAYSIA BHD	10,900	4.96	54,064.00
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	5,700	1.78	10,146.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	33.74	16,870.00
	FGV HOLDINGS BHD	5,300	1.55	8,215.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	500	37.80	18,900.00
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	9.45	8,505.00
	IOI CORPORATION BERHAD	8,100	4.54	36,774.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	1,800	24.88	44,784.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	146.60	29,320.00
	PPB GROUP BERHAD	2,040	16.60	33,864.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	8,700	5.31	46,197.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,800	6.68	32,064.00
	IHH HEALTHCARE BHD	7,500	5.29	39,675.00
	TOP GLOVE CORPORATION BHD	2,600	10.50	27,300.00
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	3,700	4.19	15,503.00
	AMMB HOLDINGS BERHAD	6,100	4.07	24,827.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	16,900	6.23	105,287.00
	HONG LEONG BANK BERHAD	2,400	20.26	48,624.00
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	800	19.42	15,536.00
	MALAYAN BANKING BERHAD	14,100	9.90	139,590.00
PUBLIC BANK BERHAD	10,700	24.94	266,858.00	
RHB BANK BHD	2,900	5.52	16,008.00	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	6,100	1.65	10,065.00	
SIME DARBY PROPERTY BHD	8,700	1.19	10,353.00	
SP SETIA BHD	5,500	2.73	15,015.00	
MY EG SERVICES BHD	4,000	1.64	6,560.00	
AXIATA GROUP BERHAD	9,900	4.61	45,639.00	
DIGI.COM BHD	11,400	4.78	54,492.00	

	MAXIS BERHAD	7,200	5.84	42,048.00
	TELEKOM MALAYSIA BHD	4,100	3.13	12,833.00
	PETRONAS GAS BHD	2,500	18.74	46,850.00
	TENAGA NASIONAL BHD	12,500	15.80	197,500.00
	YTL CORP BHD	16,000	1.23	19,680.00
	マレーシアリングット 小計	286,140		1,920,179.00 (51,787,227)
タイパーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	7,600	19.10	145,160.00
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	4,100	46.75	191,675.00
	IRPC PCL-NVDR	36,700	6.85	251,395.00
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	5,100	152.00	775,200.00
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	39,000	51.00	1,989,000.00
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	4,100	84.75	347,475.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	5,800	57.25	332,050.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	8,300	80.25	666,075.00
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	1,400	442.00	618,800.00
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	15,700	64.50	1,012,650.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	27,400	8.55	234,270.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	21,400	9.30	199,020.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	8,300	39.50	327,850.00
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	14,500	14.60	211,700.00
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	1,800	67.50	121,500.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	4,400	58.50	257,400.00
	CP ALL PCL-NVDR	18,100	68.00	1,230,800.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	11,000	25.25	277,750.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	7,000	17.30	121,100.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	14,200	25.75	365,650.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	1,300	179.00	232,700.00
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	900	209.00	188,100.00
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	4,300	212.00	911,600.00
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	2,500	212.00	530,000.00
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	12,800	19.80	253,440.00
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	6,700	147.00	984,900.00
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	40,100	2.24	89,824.00
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	4,900	82.00	401,800.00
	LAND AND HOUSES PUBLIC CO LTD-NVDR	11,100	11.50	127,650.00
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,800	69.25	124,650.00
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	3,800	201.00	763,800.00
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	36,700	5.80	212,860.00
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	500	241.00	120,500.00
	GLOW ENERGY PLC- NVDR	1,900	88.00	167,200.00
	タイパーツ 小計	385,200		14,785,544.00 (50,714,415)

フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	7,220	47.00	339,340.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	15,000	12.44	186,600.00	
	DMCI HOLDINGS INC	14,600	12.20	178,120.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	10,500	52.30	549,150.00	
	SM INVESTMENTS CORP	880	922.00	811,360.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,860	93.90	174,654.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	1,590	275.00	437,250.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	3,230	145.30	469,319.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	3,287	85.65	281,531.55	
	BDO UNIBANK INC	7,200	115.00	828,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	2,330	68.90	160,537.00	
	SECURITY BANK CORP	830	176.00	146,080.00	
	AYALA CORPORATION	910	905.50	824,005.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	326	822.00	267,972.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	51,900	5.29	274,551.00	
	AYALA LAND INC	27,000	41.60	1,123,200.00	
	MEGAWORLD CORP	41,000	4.26	174,660.00	
	ROBINSONS LAND CO	7,600	20.50	155,800.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	37,600	37.00	1,391,200.00	
	GLOBE TELECOM INC	120	2,220.00	266,400.00	
PLDT INC	315	1,410.00	444,150.00		
ABOITIZ POWER CORP	5,400	37.00	199,800.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	830	369.00	306,270.00		
	フィリピンペソ 小計	241,528		9,989,949.55	(20,579,296)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	52,700	1,715.00	90,380,500.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	6,100	32,150.00	196,115,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	10,200	17,100.00	174,420,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	6,700	16,000.00	107,200,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	10,900	8,800.00	95,920,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	17,400	1,720.00	29,928,000.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	4,390.00	35,120,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	74,100	6,950.00	514,995,000.00	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	21,400	1,830.00	39,162,000.00	
	PT MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	9,100	6,425.00	58,467,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	27,000	4,860.00	131,220,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	8,500	8,825.00	75,012,500.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	1,800	72,975.00	131,355,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	34,100	3,810.00	129,921,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	16,100	6,100.00	98,210,000.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	5,600	46,050.00	257,880,000.00	
	KALBE FARMA PT	77,300	1,220.00	94,306,000.00	

	BANK NEGARA INDONESIA PT	27,300	7,225.00	197,242,500.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	2,590.00	40,145,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	36,100	23,925.00	863,692,500.00	
	PT BANK DANAMON INDONESIA TBK	12,300	7,325.00	90,097,500.00	
	PT BANK MANDIRI	68,400	6,450.00	441,180,000.00	
	PT BANK RAKYAT	203,300	2,970.00	603,801,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,150.00	32,430,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	515.00	40,891,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	184,600	3,470.00	640,562,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	7,500	5,225.00	39,187,500.00	
	PT PERUSAHAAN GAS NEGARA	40,000	1,995.00	79,800,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,089,600		5,328,641,500.00 (39,964,811)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	187	52,900.00	9,892,300.00	
	S-OIL CORPORATION	165	126,500.00	20,872,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	237	201,000.00	47,637,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	392	18,850.00	7,389,200.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	293	53,700.00	15,734,100.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	31	407,000.00	12,617,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	67	97,800.00	6,552,600.00	
	LG CHEM LTD	168	354,000.00	59,472,000.00	
	LG CHEM LTD	28	194,000.00	5,432,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	56	286,500.00	16,044,000.00	
	OCI COMPANY LTD	61	118,000.00	7,198,000.00	
	POSCO	292	293,000.00	85,556,000.00	
	CJ CORP	53	136,000.00	7,208,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	102	83,600.00	8,527,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	5,650.00	3,440,850.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	129	36,650.00	4,727,850.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION	195	14,800.00	2,886,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	184	52,800.00	9,715,200.00	
	HANWHA CORPORATION	165	31,950.00	5,271,750.00	
	HDC HOLDINGS CO LTD	92	27,100.00	2,493,200.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	128	62,100.00	7,948,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	286	68,700.00	19,648,200.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	134	130,500.00	17,487,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	36	388,500.00	13,986,000.00	
	KCC CORP	21	340,000.00	7,140,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	250	45,150.00	11,287,500.00	
	LG CORP	348	71,700.00	24,951,600.00	
	LOTTE CORPORATION	108	54,500.00	5,886,000.00	
	POSCO DAEWOO CORP	136	19,250.00	2,618,000.00	

SAMSUNG C&T CORPORATION	278	125,500.00	34,889,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	583	17,350.00	10,115,050.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	1,438	7,960.00	11,446,480.00
SK HOLDINGS CO LTD	116	281,500.00	32,654,000.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	82	36,000.00	2,952,000.00
S1 CORPORATION	63	85,800.00	5,405,400.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	29	164,500.00	4,770,500.00
GLOVIS CO LTD	69	126,500.00	8,728,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	174	28,850.00	5,019,900.00
PAN OCEAN CO LTD	783	5,060.00	3,961,980.00
HANKOOK TIRE CO LTD	272	46,300.00	12,593,600.00
HANON SYSTEMS	684	11,750.00	8,037,000.00
HYUNDAI MOBIS	250	222,500.00	55,625,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	565	128,500.00	72,602,500.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	138	87,400.00	12,061,200.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	87	79,300.00	6,899,100.00
KIA MOTORS CORPORATION	965	34,050.00	32,858,250.00
COWAY CO LTD	192	93,400.00	17,932,800.00
HANSSEM CO LTD	39	87,300.00	3,404,700.00
HLB INC	115	109,900.00	12,638,500.00
LG ELECTRONICS INC	390	71,900.00	28,041,000.00
KANGWON LAND INC	431	27,450.00	11,830,950.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	253	19,800.00	5,009,400.00
CJ ENM CO LTD	28	242,200.00	6,781,600.00
HOTEL SHILLA CO LTD	115	106,000.00	12,190,000.00
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	51	96,700.00	4,931,700.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	41	196,000.00	8,036,000.00
SHINSEGAE CO LTD	27	341,500.00	9,220,500.00
BGF RETAIL CO LTD	32	195,000.00	6,240,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	128	21,000.00	2,688,000.00
E-MART INC	77	201,000.00	15,477,000.00
GS RETAIL CO LTD	99	38,850.00	3,846,150.00
CJ CHEILJEDANG CORP	30	327,500.00	9,825,000.00
KT&G CORPORATION	427	101,000.00	43,127,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	80	104,000.00	8,320,000.00
OTTOGI CORPORATION	4	714,000.00	2,856,000.00
AMOREPACIFIC CORP	118	263,500.00	31,093,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	136,500.00	4,504,500.00
AMOREPACIFIC GROUP	106	93,000.00	9,858,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	34	1,224,000.00	41,616,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	8	753,000.00	6,024,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	128	99,000.00	12,672,000.00

CELLTRION INC	298	302,500.00	90,145,000.00
CELLTRION PHARM INC	57	82,500.00	4,702,500.00
HANMI PHARM CO LTD	23	496,000.00	11,408,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	47	89,500.00	4,206,500.00
MEDY-TOC INC	16	681,900.00	10,910,400.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	61	486,000.00	29,646,000.00
SILLAJEN INC	199	93,900.00	18,686,100.00
VIROMED CO LTD	50	241,300.00	12,065,000.00
YUHAN CORPORATION	31	239,500.00	7,424,500.00
BS FINANCIAL GROUP INC	955	8,370.00	7,993,350.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	620	10,050.00	6,231,000.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	1,084	42,650.00	46,232,600.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	923	14,550.00	13,429,650.00
KB FINANCIAL GROUP INC	1,455	50,400.00	73,332,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	1,563	42,650.00	66,661,950.00
WOORI BANK	1,733	16,300.00	28,247,900.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	143	69,800.00	9,981,400.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	1,342	8,180.00	10,977,560.00
SAMSUNG CARD CO LTD	106	35,750.00	3,789,500.00
SAMSUNG SECURITIES CO.,LTD.	245	31,600.00	7,742,000.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	515	13,500.00	6,952,500.00
DB INSURANCE CO LTD	182	62,900.00	11,447,800.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	4,900.00	4,674,600.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	229	36,750.00	8,415,750.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	120	33,950.00	4,074,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	113	258,000.00	29,154,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	256	91,000.00	23,296,000.00
KAKAO CORP	167	121,500.00	20,290,500.00
NCSOFT CORP	64	430,000.00	27,520,000.00
NETMARBLE CORPORATION	93	113,500.00	10,555,500.00
NHN CORP	103	728,000.00	74,984,000.00
PEARLABYSS CORP	21	222,000.00	4,662,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	128	240,000.00	30,720,000.00
LG DISPLAY CO LTD	852	19,700.00	16,784,400.00
LG INNOTEK CO LTD	52	132,000.00	6,864,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	205	152,000.00	31,160,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	17,888	45,150.00	807,643,200.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3,200	36,000.00	115,200,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	202	246,500.00	49,793,000.00
LG UPLUS CORP	782	17,350.00	13,567,700.00
SK TELECOM CO LTD	74	278,500.00	20,609,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	941	29,800.00	28,041,800.00

	KOREA GAS CORPORATION	101	58,200.00	5,878,200.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	2,133	77,200.00	164,667,600.00	
	韓国ウォン 小計	54,841		3,069,171,570.00	(304,154,902)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	5,000	129.50	647,500.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	9,000	36.40	327,600.00	
	CHINA STEEL CORP	46,000	24.50	1,127,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	13,000	121.00	1,573,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	17,000	112.50	1,912,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	19,000	83.90	1,594,100.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	14,300	39.30	561,990.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	12,000	35.75	429,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,000	261.50	261,500.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP-NEW	30	261.50	7,845.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	7,000	21.15	148,050.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	9.21	92,100.00	
	EVA AIRWAYS CORP	7,000	14.55	101,850.00	
	EVA AIRWAYS CORP-NEW	350	14.55	5,092.50	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	7,000	12.25	85,750.00	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION-NEW	350	12.25	4,287.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	25.80	154,800.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	7,000	47.30	331,100.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	1,000	396.00	396,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,000	192.00	192,000.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,000	35.55	106,650.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	1,000	129.50	129,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	233.50	233,500.00	
	POU CHEN	8,000	31.80	254,400.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	2,000	58.20	116,400.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	257.00	257,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	357.00	714,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	51.90	103,800.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	18,000	75.60	1,360,800.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	197.00	197,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	17,000	18.20	309,400.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK(NEW)	680	18.20	12,376.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	49,000	10.90	534,100.00		
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	64,000	21.45	1,372,800.00		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	36,082	22.30	804,628.60		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	34,000	20.40	693,600.00		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO-NEW	340	20.40	6,936.00		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	27,170	17.95	487,701.50		

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	40,000	26.40	1,056,000.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	38,000	11.20	425,600.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS NEW	760	11.20	8,512.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	36,551	14.40	526,334.40
TAIWAN BUSINESS BANK	14,000	10.90	152,600.00
TAIWAN BUSINESS BANK NEW	560	10.90	6,104.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	29,000	18.10	524,900.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING-NEW	870	18.10	15,747.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	4,080	104.00	424,320.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	24,000	50.00	1,200,000.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	37,000	15.25	564,250.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	30,000	51.20	1,536,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	9,540	29.50	281,430.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	30,000	12.15	364,500.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	3,000	47.50	142,500.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	3,000	35.20	105,600.00
ACER INC	11,000	24.25	266,750.00
ADVANTECH CO LTD	1,000	215.00	215,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	3,000	250.50	751,500.00
AU OPTRONICS CORP	32,000	12.95	414,400.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	360.50	721,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	2,010	63.00	126,630.00
COMPAL ELECTRONICS	15,000	18.90	283,500.00
DELTA ELECTRONICS INC	7,000	120.00	840,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	3,000	73.70	221,100.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDINGS	1,000	140.50	140,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	61,000	77.80	4,745,800.00
HTC CORPORATION	2,000	39.30	78,600.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	33,000	10.65	351,450.00
INVENTEC CORPORATION	9,000	26.80	241,200.00
LARGAN PRECISION CO LTD	380	4,285.00	1,628,300.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	8,000	37.65	301,200.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	2,000	89.40	178,800.00
PEGATRON CORP	7,000	65.80	460,600.00
QUANTA COMPUTER INC	10,000	52.30	523,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	5,000	39.05	195,250.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	1,000	253.00	253,000.00
WISTRON CORPORATION	10,293	20.10	206,889.30
WPG HOLDINGS CO LTD	6,000	37.80	226,800.00
YAGEO CORPORATION	1,198	533.00	638,534.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	2,000	77.30	154,600.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	14,000	108.50	1,519,000.00

	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	6,000	73.90	443,400.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	6,000	109.00	654,000.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	13,000	72.50	942,500.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	306.00	306,000.00
	MACRONIX INTERNATIONAL CO LTD	7,000	28.15	197,050.00
	MACRONIX INTERNATIONAL CO LTD-NEW	140	28.15	3,941.00
	MEDIATEK INCORPORATION	6,000	243.50	1,461,000.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	4,000	61.20	244,800.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	2,000	147.50	295,000.00
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	241.50	241,500.00
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	3,000	85.70	257,100.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	136.00	272,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	90,000	258.00	23,220,000.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	44,000	15.60	686,400.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	3,000	66.10	198,300.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	143.00	143,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	11,000	14.75	162,250.00
	新台湾ドル 小計	1,199,684		70,393,698.80 (255,529,126)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	2,821	364.00	1,026,844.00
	COAL INDIA LTD	2,537	274.95	697,548.15
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	2,265	258.35	585,162.75
	INDIAN OIL CORP LTD	5,413	156.55	847,405.15
	OIL AND NATURAL GAS CORPORATION LIMITED	5,245	171.70	900,566.50
	PETRONET LNG LTD	2,229	237.40	529,164.60
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	10,590	1,225.90	12,982,281.00
	AMBUJA CEMENTS LTD	2,213	225.90	499,916.70
	ASIAN PAINTS LTD	1,069	1,308.65	1,398,946.85
	GRASIM INDUSTRIES LTD	1,221	1,065.20	1,300,609.20
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	4,337	241.35	1,046,734.95
	JSW STEEL LTD	3,143	411.85	1,294,444.55
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	453	1,109.50	502,603.50
	SHREE CEMENT LTD	31	17,534.45	543,567.95
	TATA STEEL LTD	1,298	616.40	800,087.20
	ULTRATECH CEMENT LTD	357	4,103.50	1,464,949.50
	UPL LTD	1,322	723.50	956,467.00
	VEDANTA LTD	4,834	234.90	1,135,506.60
	ASHOK LEYLAND LIMITED	4,350	127.45	554,407.50
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LIMITED	3,274	76.15	249,315.10
	HAVELLS INDIA LTD	929	666.90	619,550.10
	LARSEN & TOUBRO LTD	1,770	1,344.75	2,380,207.50
	SIEMENS LTD	265	982.20	260,283.00

ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	1,924	380.80	732,659.20
CONTAINER CORP OF INDIA LIMITED	616	633.95	390,513.20
INTERGLOBE AVIATION LTD	343	888.90	304,892.70
BAJAJ AUTO LTD	312	2,860.65	892,522.80
BHARAT FORGE LTD	778	652.55	507,683.90
BOSCH LIMITED	27	20,986.10	566,624.70
EICHER MOTORS LTD	50	29,663.70	1,483,185.00
HERO MOTOCORP LTD	186	3,127.90	581,789.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	2,771	950.85	2,634,805.35
MARUTI SUZUKI INDIA LIMITED	393	8,537.80	3,355,355.40
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	2,346	287.75	675,061.50
TATA MOTORS LTD	5,900	260.25	1,535,475.00
TITAN CO LTD	1,154	823.45	950,261.30
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	1,784	475.25	847,846.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	464	1,524.80	707,507.20
BRITANNIA INDUSTRIES LIMITED	107	6,021.75	644,327.25
ITC LIMITED	12,689	302.00	3,832,078.00
NESTLE INDIA LTD	86	10,175.05	875,054.30
UNITED SPIRITS LTD	1,080	570.40	616,032.00
DABUR INDIA LIMITED	1,963	461.85	906,611.55
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	886	853.75	756,422.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD-NEW	443	853.75	378,211.25
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	2,413	1,605.45	3,873,950.85
MARICO LTD	1,679	342.85	575,645.15
AUROBINDO PHARMA LIMITED	980	789.45	773,661.00
CADILA HEALTHCARE LTD	761	413.15	314,407.15
CIPLA LTD	1,286	664.90	855,061.40
DR.REDDY'S LABORATORIES	425	2,568.50	1,091,612.50
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	514	680.50	349,777.00
LUPIN LTD	823	950.20	782,014.60
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	301	2,960.55	891,125.55
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	3,120	646.20	2,016,144.00
AXIS BANK LIMITED	6,671	625.95	4,175,712.45
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	5,873	1,878.85	11,034,486.05
ICICI BANK LIMITED	8,833	325.70	2,876,908.10
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,030	1,200.85	1,236,875.50
LIC HOUSING FINANCE LTD	1,106	476.45	526,953.70
STATE BANK OF INDIA	6,414	285.30	1,829,914.20
YES BANK LTD	6,326	318.60	2,015,463.60
BAJAJ FINANCE LIMITED	643	2,604.60	1,674,757.80
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	1,125	440.55	495,618.75
RURAL ELECTRIFICATION CORP	2,568	114.10	293,008.80

	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	548	1,197.20	656,065.60
	BAJAJ FINSERV LTD	142	6,549.95	930,092.90
	HCL TECHNOLOGIES LTD	2,069	1,078.40	2,231,209.60
	INFOSYS LIMITED	12,984	725.95	9,425,734.80
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	3,414	2,074.15	7,081,148.10
	TECH MAHINDRA LTD	1,747	767.55	1,340,909.85
	WIPRO LTD	4,202	329.90	1,386,239.80
	BHARTI AIRTEL LIMITED	5,198	382.05	1,985,895.90
	BHARTI INFRATEL LTD	1,237	266.85	330,093.45
	IDEA CELLULAR LTD	7,287	47.70	347,589.90
	GAIL INDIA LIMITED	2,932	372.55	1,092,316.60
	NTPC LTD	7,353	172.25	1,266,554.25
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	5,831	201.90	1,177,278.90
	TATA POWER CO LTD	4,120	77.90	320,948.00
	インドルピー 小計	210,223		124,006,664.65 (192,210,330)
エジプトボンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	142	179.91	25,547.22
	EASTERN TOBACCO	662	86.17	57,044.54
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	3,830	82.37	315,477.10
	エジプトボンド 小計	4,634		398,068.86 (2,483,949)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	920	152.00	139,840.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	198	438.04	86,731.92
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	1,502	123.25	185,121.50
	GOLD FIELDS LIMITED	3,009	34.54	103,930.86
	KUMBA IRON ORE LTD	236	293.40	69,242.40
	MONDI LTD	433	418.00	180,994.00
	SAPPI LIMITED	2,041	96.14	196,221.74
	SASOL LTD.	2,033	566.00	1,150,678.00
	BIDVEST GROUP LTD	1,232	187.70	231,246.40
	NASPERS LIMITED-N SHS	1,630	3,206.42	5,226,464.60
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	553	178.89	98,926.17
	MR PRICE GROUP LTD	892	210.50	187,766.00
	THE FOSCHINI GROUP	824	166.00	136,784.00
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	1,619	80.12	129,714.28
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	3,647	50.14	182,860.58
	BID CORP LTD	1,229	314.00	385,906.00
	CLICKS GROUP LTD	944	181.55	171,383.20
	PICK N PAY STORES LTD	1,342	67.28	90,289.76
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	1,625	190.20	309,075.00
	SPAR GROUP LIMITED	706	187.54	132,403.24
	PIONEER FOODS GROUP LTD	470	98.95	46,506.50

TIGER BRANDS LTD	598	284.06	169,867.88
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	4,865	24.85	120,895.25
NETCARE LTD	3,751	27.28	102,327.28
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	1,421	192.55	273,613.55
ABSA GROUP LTD	2,640	145.90	385,176.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	148	941.00	139,268.00
NEDBANK GROUP LTD	821	259.00	212,639.00
STANDARD BANK GROUP LIMITED	4,743	172.00	815,796.00
CORONATION FUND MANAGERS LTD	833	55.05	45,856.65
FIRSTRAND LIMITED	12,329	66.00	813,714.00
INVESTEC LTD	1,024	100.56	102,973.44
PSG GROUP LTD	551	214.55	118,217.05
REINET INVESTMENTS SCA	546	274.50	149,877.00
REMGRO LTD	1,939	205.91	399,259.49
RMB HOLDINGS LTD	2,586	76.48	197,777.28
DISCOVERY LTD	1,303	174.86	227,842.58
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	107.23	50,612.56
MMI HOLDINGS LTD	3,464	16.48	57,086.72
OLD MUTUAL LTD	18,024	29.80	537,115.20
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	2,502	38.50	96,327.00
SANLAM LTD	6,440	76.04	489,697.60
NEPI ROCKCASTLE PLC	1,376	136.02	187,163.52
MTN GROUP LIMITED	6,212	69.90	434,218.80
TELKOM SA SOC LTD	965	50.00	48,250.00
VODACOM GROUP LIMITED	2,207	123.02	271,505.14
南アフリカランド 小計	108,845		15,889,163.14 (118,692,048)
合 計	8,729,024		1,925,299,382 (1,925,299,382)

(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 26銘柄	3.9%	8.2%
メキシコペソ	株式 24銘柄	1.6%	3.4%
ブラジルレアル	株式 51銘柄	2.9%	6.2%
チリペソ	株式 17銘柄	0.5%	1.1%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	0.2%	0.5%
ユーロ	株式 9銘柄	0.1%	0.3%
トルコリラ	株式 23銘柄	0.3%	0.6%
チェココルナ	株式 4銘柄	0.1%	0.2%
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 22銘柄	0.6%	1.3%

香港ドル	株式	203銘柄	11.4%	24.1%
マレーシアリングット	株式	47銘柄	1.3%	2.7%
タイバーツ	株式	34銘柄	1.2%	2.6%
フィリピンペソ	株式	23銘柄	0.5%	1.1%
インドネシアルピア	株式	28銘柄	1.0%	2.1%
韓国ウォン	株式	115銘柄	7.5%	15.8%
新台湾ドル	株式	97銘柄	6.3%	13.3%
インドルピー	株式	79銘柄	4.7%	10.0%
エジプトポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
南アフリカランド	株式	46銘柄	2.9%	6.2%

(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	1,178	12,333.66		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	9,231	160,804.02		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	20,110	654,178.30		
		ISHARES MSCI UAE ETF	7,671	116,829.33		
	米ドル 小計			38,190	944,145.31 (105,583,770)	
	中国元(オフショア)	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF	28,400	931,520.00		
中国元(オフショア) 小計			28,400	931,520.00 (15,127,884)		
投資信託受益証券合計				120,711,654 (120,711,654)		
投資証券	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	11,700	288,405.00		
		メキシコペソ 小計		11,700	288,405.00 (1,707,357)	
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,500	52,200.00		
		KLABIN SA-UNIT	2,200	45,298.00		
		SUL AMERICA SA-UNITS	700	17,787.00		
	ブラジルリアル 小計			4,400	115,285.00 (3,117,306)	
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	6,960	12,806.40		
		トルコリラ 小計		6,960	12,806.40 (226,417)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A		3,905	65,838.30	
		FORTRESS REIT LTD-B		2,984	45,356.80	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		11,038	264,691.24			
HYPROP INVESTMENTS LTD		910	86,422.70			
REDEFINE PROPERTIES LTD		18,627	180,868.17			

	RESILIENT REIT LTD	1,090	57,988.00	
	南アフリカランド 小計	38,554	701,165.21 (5,237,704)	
投資証券合計			10,288,784 (10,288,784)	
	合計		131,000,438 (131,000,438)	

（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	2.6%	-	80.6%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	1.3%
ブラジルレアル	投資証券 3銘柄	-	0.1%	2.4%
トルコリラ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.2%
南アフリカランド	投資証券 6銘柄	-	0.1%	4.0%
中国元（オフショア）	投資信託受益証券 1銘柄	0.4%	-	11.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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）

（平成30年 9月18日現在）

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,059,292	
投資証券	10,100,613,900	
未収配当金	115,555,396	
流動資産合計	10,280,228,588	
資産合計	10,280,228,588	
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,120,000	
未払利息	180	
その他未払費用	516	
流動負債合計	17,120,696	
負債合計	17,120,696	
純資産の部		
元本等		
元本	5,029,327,804	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,233,780,088	
元本等合計	10,263,107,892	

(平成30年 9月18日現在)

純資産合計	10,263,107,892
負債純資産合計	10,280,228,588

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年 9月14日 至平成30年 9月18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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,029,327,804口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0407円
	(10,000口当たりの純資産額 20,407円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18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)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	5,505,317,391円
同期中における追加設定元本額	2,438,945,799円
同期中における一部解約元本額	2,914,935,386円
平成30年 9月18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）	246,270,150円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	362,434,015円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	315,117,221円
イオン・バランス戦略ファンド	83,519,245円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	342,372,018円

(平成30年 9月18日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,955,922円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,753,162円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,259,560円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	5,488,414円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	4,478,450円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	9,108,096円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,883,947円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,403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)	1,758,790,990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)	1,133,156,418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>	110,531,606円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	24,749,778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>	234,845,295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>	112,515,207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>	276,580,907円
合計	5,029,327,804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	日本アコモデーションファンド投資法人	394	197,394,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,337	116,586,400	
	森ヒルズリート投資法人	1,359	196,103,700	
	産業ファンド投資法人	1,382	161,003,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,156	329,922,400	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	704	122,848,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	569	281,370,500	
G L P 投資法人	2,938	322,886,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	454	118,584,800	
日本プロロジスリート投資法人	1,590	345,030,000	
星野リゾート・リート投資法人	180	98,460,000	
O n e リート投資法人	154	37,098,600	
イオンリート投資法人	1,217	147,378,700	
ヒューリックリート投資法人	856	136,874,400	
日本リート投資法人	383	140,752,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	7,031	114,605,300	
日本ヘルスケア投資法人	54	9,666,000	
積水ハウス・リート投資法人	3,058	218,952,800	
トーセイ・リート投資法人	191	21,506,600	
ケネディクス商業リート投資法人	434	105,809,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人	157	18,055,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	238	21,586,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,515	537,795,000	
いちごホテルリート投資法人	207	28,897,200	
ラサールロジポート投資法人	893	91,264,600	
スターアジア不動産投資法人	366	37,551,600	
マリモ地方創生リート投資法人	102	11,403,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	203	63,945,000	
大江戸温泉リート投資法人	192	16,396,800	
さくら総合リート投資法人	257	23,001,500	
投資法人みらい	276	52,384,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	277	38,752,300	
三菱地所物流リート投資法人	126	31,248,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	118	12,767,600	
ザイマックス・リート投資法人	110	12,353,000	
タカラレーベン不動産投資法人	173	15,518,100	
日本ビルファンド投資法人	1,148	740,460,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,185	694,410,000	
日本リテールファンド投資法人	2,241	462,318,300	
オリックス不動産投資法人	2,363	412,579,800	

日本プライムリアルティ投資法人	751	304,155,000	
プレミア投資法人	1,127	130,506,600	
東急リアル・エステート投資法人	794	124,419,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	757	87,812,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,614	460,325,400	
森トラスト総合リート投資法人	847	136,959,900	
インヴィンシブル投資法人	4,149	192,928,500	
フロンティア不動産投資法人	403	176,514,000	
平和不動産リート投資法人	738	82,877,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	781	173,303,900	
福岡リート投資法人	613	106,600,700	
ケネディクス・オフィス投資法人	367	259,836,000	
いちごオフィスリート投資法人	984	90,429,600	
大和証券オフィス投資法人	274	187,142,000	
阪急阪神リート投資法人	492	68,880,000	
スタートアップリート投資法人	187	31,902,200	
大和ハウスリート投資法人	1,485	377,190,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,434	287,769,200	
日本賃貸住宅投資法人	1,333	120,103,300	
ジャパンエクセレント投資法人	1,061	155,436,500	
合計	62,779	10,100,613,900	

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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年 9月18日現在)

資産の部

流動資産

預金

82,372,047

コール・ローン

12,465,039

投資証券

5,940,761,304

派生商品評価勘定

1,610

（平成30年 9月18日現在）

未収入金	290,563
未収配当金	12,144,608
流動資産合計	6,048,035,171
資産合計	6,048,035,171
負債の部	
流動負債	
未払金	11,243,619
未払解約金	9,000,000
未払利息	35
その他未払費用	279
流動負債合計	20,243,933
負債合計	20,243,933
純資産の部	
元本等	
元本	2,888,731,950
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,139,059,288
元本等合計	6,027,791,238
純資産合計	6,027,791,238
負債純資産合計	6,048,035,171

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>
	外貨建資産等の会計処理

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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	「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		2,888,731,950口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0867円
	(10,000口当たりの純資産額)	20,867円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、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>

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18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）

（平成30年 9月18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	6,000,000	-	6,001,610	1,610
	米ドル	6,000,000	-	6,001,610	1,610
	合計	6,000,000	-	6,001,610	1,610

（注）1．時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 9月14日

至 平成30年 9月18日

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

（その他の注記）

（平成30年 9月18日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,898,629,446円
同期中における追加設定元本額	2,122,842,478円
同期中における一部解約元本額	1,132,739,974円
平成30年 9月18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）	240,255,482円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	158,910,182円

(平成30年 9月18日現在)	
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	116,161,687円
イオン・バランス戦略ファンド	136,939,660円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	969,320,479円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,141,583円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,581,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,649,949円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,739,312円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	5,275,024円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,069,429円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,660,003円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,156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)	1,103,625,312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>	108,163,847円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,720,964円
合計	2,888,731,950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	3,108	89,013.12	
		AGREE REALTY CORP	1,153	63,933.85	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,414	56,487.60	
		ALEXANDER'S INC	136	46,988.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,795	611,746.10	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,200	84,678.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	6,209	263,447.87	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	11,935	272,953.45	
		AMERICOLD REALTY TRUST	2,500	64,225.00	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	7,713	342,997.11	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,700	187,678.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	600	9,162.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	37,394.64	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,586	1,216,631.78
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	5,982.00
BOSTON PROPERTIES INC	7,032	893,134.32
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	602	6,736.38
BRANDYWINE REALTY TRUST	9,025	149,363.75
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	13,502	240,875.68
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,018	381,870.72
CARETRUST REIT INC	5,549	101,491.21
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	31,180.33
CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	9,861.90
CHATHAM LODGING TRUST	3,100	65,038.00
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	77,234.00
CITY OFFICE REIT INC	600	7,482.00
CLIPPER REALTY INC	800	9,832.00
COLONY CAPITAL INC-CLASS A	22,060	137,875.00
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	107,415.00
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	9,201.00
CORECIVIC INC	5,301	135,281.52
CORESITE REALTY CORPORATION	1,700	197,608.00
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	133,058.36
COUSINS PROPERTIES INC	17,983	164,904.11
CUBESMART	9,062	271,406.90
CYRUSONE INC	4,895	333,936.90
DDR CORPORATION	5,797	79,013.11
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,056	119,968.08
DIGITAL REALTY TRUST INC	9,820	1,201,869.80
DOUGLAS EMMETT INC	8,037	312,960.78
DUKE REALTY CORP	17,415	505,209.15
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	4,200	83,748.00
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,802	177,659.18
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,556	147,574.00
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	84,700.00
EPR PROPERTIES	3,467	240,748.48
EQUITY COMMONWEALTH REIT	5,608	182,203.92
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,923	380,648.69
EQUITY RESIDENTIAL	17,567	1,201,582.80
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,072	756,480.00
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,114	546,102.48
FARMLAND PARTNERS INC	300	2,064.00
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,252	424,613.64
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	5,894	189,020.58
FOREST CITY REALTY TRUST-A	11,600	291,392.00

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,339	87,348.24
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	30,525.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	8,480	297,054.40
GEO GROUP INC	5,536	141,057.28
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	41,454.84
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	28,108.80
GLADSTONE LAND CORP	600	7,608.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	9,870.00
GLOBAL NET LEASE INC	3,433	72,882.59
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	5,700	72,361.50
GRAMERCY PROPERTY TRUST	8,229	225,556.89
HCP, INC.	22,218	594,109.32
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,372	161,750.92
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	8,915	245,073.35
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	23,587.06
HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,557	221,424.63
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,234	206,747.72
HOST HOTELS AND RESORTS INC	33,837	724,111.80
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	8,305	269,497.25
INDEPENDENCE REALTY TRUST	4,641	48,312.81
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	1,300	28,340.00
INFREIT INC	2,200	47,190.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,233	18,007.81
INVITATION HOMES INC	13,964	331,086.44
IRON MOUNTAIN INC	12,300	440,094.00
ISTAR INC	3,000	33,690.00
JBG SMITH PROPERTIES	4,364	160,377.00
KILROY REALTY CORP	4,754	341,907.68
KIMCO REALTY CORPORATION	21,355	362,394.35
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	54,328.26
LASALLE HOTEL PROPERTIES	6,051	207,972.87
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	58,583.94
LIBERTY PROPERTY TRUST	6,695	291,902.00
LIFE STORAGE INC	2,058	200,449.20
LTC PROPERTIES INC	1,576	71,865.60
MACERICH COMPANY/THE	4,637	264,077.15
MACK-CALI REALTY CORPORATION	4,599	96,670.98
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	51,354.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,500	14,460.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	15,978	235,036.38

MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	5,408	557,672.96
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	60,607.04
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	132,179.28
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7,651	346,513.79
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,800	102,600.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	16,464.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	16,780.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	28,431.28
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	10,146	335,731.14
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	28,600.00
PARAMOUNT GROUP INC	11,700	182,871.00
PARK HOTELS AND RESORTS INC	9,900	330,066.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2,784	101,894.40
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	22,797.18
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,144	140,239.68
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	105,570.00
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	53,534.00
PROLOGIS INC	29,612	1,999,402.24
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,004	130,821.20
PUBLIC STORAGE	7,055	1,468,992.10
QTS REALTY TRUST INC-CL A	2,700	123,687.00
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2,740	37,921.60
REALTY INCOME CORPORATION	13,027	757,780.59
REGENCY CENTERS CORP	6,948	455,024.52
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	78,228.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,074	128,141.28
RETAIL VALUE INC	579	18,487.47
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,140	163,452.00
RLJ LODGING TRUST	7,377	165,687.42
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,074	182,802.36
SABRA HEALTH CARE REIT	8,481	198,200.97
SAUL CENTERS INC	703	39,375.03
SELECT INCOME REIT	1,900	41,325.00
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	10,696	199,587.36
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	1,500	75,000.00
SIMON PROPERTY GROUP INC	14,234	2,611,369.64
SL GREEN REALTY CORP	3,906	396,732.42
SPIRIT MTA REIT	1,580	17,143.00
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	24,000	197,280.00

	STAG INDUSTRIAL INC	5,900	167,914.00	
	STORE CAPITAL CORP	7,400	211,418.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	57,706.00	
	SUN COMMUNITIES INC	3,888	400,891.68	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	161,112.12	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	86,264.24	
	TAUBMAN CENTERS INC	2,920	179,813.60	
	TERRENO REALTY CORP	2,200	82,808.00	
	TIER REIT INC	1,800	42,660.00	
	UDR INC	11,812	478,740.36	
	UMH PROPERTIES INC	800	12,648.00	
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	215	16,103.50	
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	85,306.50	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	9,277.58	
	VENTAS INC	16,109	940,443.42	
	VEREIT INC	46,810	356,224.10	
	VORNADO REALTY TRUST	8,297	624,349.25	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	45,668.50	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,270	100,716.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,781	171,926.94	
	WELLTOWER INC	16,783	1,121,272.23	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT	125	531.25	
	WHITESTONE REIT	200	2,730.00	
	WP CAREY INC	5,300	347,468.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	95,720.00	
	米ドル 小計	1,054,560	38,412,600.57 (4,295,681,121)	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	500	6,975.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,300	103,891.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,400	78,272.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	37,257.15	
	CAN APARTMENT PROP	3,807	186,504.93	
	CHOICE PROPERTIES REIT	6,836	87,364.08	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	39,261.60	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	20,475.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200	2,662.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,214	48,917.08	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	3,700	38,406.00	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	37,372.32
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	56,960.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,012	123,546.60
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,000	11,850.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	16,530.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,634.00
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1,503	18,306.54
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	27,772.80
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	17,145.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,627	221,368.82
	SLATE OFFICE REIT	1,000	7,930.00
	SLATE RETAIL REIT	500	6,455.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,207	101,790.18
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	13,305.00
	カナダドル 小計	61,861	1,311,952.10 (112,368,697)
ユーロ	AEDIFICA	968	77,827.20
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,469	84,097.00
	ALTAREA	70	13,510.00
	BEFIMMO SCA	744	36,716.40
	BENI STABILU SPA	30,000	22,605.00
	COFINIMMO	1,095	120,778.50
	COVIVIO	2,687	241,023.90
	CROMWELL EUROPEAN REIT	40,000	23,200.00
	EUROCOMMERCIAL	2,364	72,716.64
	GECINA SA	2,314	338,769.60
	GREEN REIT PLC	27,000	42,174.00
	HAMBORNER REIT AG	2,840	25,986.00
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	37,702.84
	ICADE	2,012	165,185.20
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	23,712.86
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	17,478	161,846.28
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	300	6,930.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	15,412.60
	KLEPIERRE	9,961	302,814.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	21,353.00
	MERCIALYS	2,280	32,102.40
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	15,500	185,225.00
	NSI NV	727	25,881.20

	RETAIL ESTATES	200	14,820.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	6,230	1,089,253.20
	VASTNED RETAIL	925	29,877.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,023	124,192.20
	WERELDHAVE NV	1,995	59,071.95
	ユーロ 小計	216,580	3,394,784.87 (443,053,373)
英bond	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	5,000	4,765.00
	ASSURA PLC	116,800	66,342.40
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	65,676.00
	BRITISH LAND CO PLC	45,500	280,189.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	8,740.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	10,000	11,300.00
	DERWENT LONDON PLC	4,847	142,792.62
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	19,100.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	12,745	89,329.70
	HAMMERSON PLC	38,700	177,633.00
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	11,553.75
	INTU PROPERTIES PLC	33,500	51,422.50
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,363	314,023.44
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	37,101	67,894.83
	LXI REIT PLC	4,000	4,660.00
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	43,399.32
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	42,148	47,205.76
	RDI REIT PLC	40,100	13,032.50
	REGIONAL REIT LTD	5,000	4,850.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	12,700	69,405.50
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	9,135.00
	SEGRO PLC	48,493	313,264.78
	SHAFTESBURY PLC	10,700	96,835.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	64,900	97,025.50
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	31,255.00
	UNITE GROUP PLC	12,294	110,523.06
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	67,882.50
	英bond 小計	712,434	2,219,236.16 (326,227,715)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	20,971	72,769.37
	ARENA REIT	3,100	7,409.00
	BWP TRUST	29,090	100,360.50
	CHARTER HALL GROUP	22,550	163,036.50
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	5,000	21,800.00

	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	51,250.38
	CROMWELL PROPERTY GROUP	82,000	92,660.00
	DEXUS	48,837	529,393.08
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,100	20,448.00
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	23,760.00
	GOODMAN GROUP	74,756	805,869.68
	GPT GROUP	87,000	465,450.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	4,000	15,560.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	317.00
	INDUSTRIA REIT	1,000	2,760.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	24,253.02
	INVESTA OFFICE FUND	25,578	141,702.12
	MIRVAC GROUP	170,322	417,288.90
	NATIONAL STORAGE REIT	11,000	19,030.00
	PROPERTYLINK GROUP	28,000	30,100.00
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	21,800.00
	SCENTRE GROUP	239,409	995,941.44
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	104,264.16
	STOCKLAND	109,730	459,768.70
	VICINITY CENTRES	158,829	433,603.17
	VIVA ENERGY REIT	18,000	40,140.00
	オーストラリアドル 小計	1,236,281	5,060,735.02 (405,364,875)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	33,150.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	56,925	87,664.50
	INVESTORE PROPERTY LTD	2,250	3,397.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	61,522.59
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	44,000	63,580.00
	STRIDE STAPLED GROUP	23,000	44,620.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	39,805.00
	ニュージーランドドル 小計	220,082	333,739.59 (24,519,847)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	622,440.00
	FORTUNE REIT	58,000	536,500.00
	LINK REIT	98,600	7,473,880.00
	PROSPERITY REIT	60,000	184,800.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	91,000.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	200,170.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	88,000	450,560.00
	香港ドル 小計	483,600	9,559,350.00

シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	23,500	33,370.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	20,125.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	103,100	268,060.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	43,200.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	20,115.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	122,000	214,720.00
	CAPITALAND MALL TRUST	139,500	298,530.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	28,200.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	59,350	92,586.00
	ESR REIT	57,552	28,776.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	29,440.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	34,720.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	35,000	78,750.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	63,168.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	95,000	102,600.00
	KEPPEL DC REIT	57,000	76,380.00
	KEPPEL REIT	91,000	107,380.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	8,745.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	99,000	162,360.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	49,800	99,600.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	87,250	109,935.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	83,000	94,620.00
	OUE HOSPITALITY TRUST	36,000	25,200.00
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	28,000	76,160.00
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	12,710.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	15,080.00
	SPH REIT	16,000	15,920.00
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	38,610.00
	SUNTEC REIT	96,000	178,560.00
	シンガポールドル 小計	1,652,852	2,377,620.00 (193,466,939)
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	120,320.00
	イスラエルシュケル 小計	8,000	120,320.00 (3,762,406)
	合計		5,940,761,304 (5,940,761,304)

(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 159銘柄	71.3%	72.3%
カナダドル	投資証券 25銘柄	1.9%	1.9%
ユーロ	投資証券 28銘柄	7.4%	7.5%
英ポンド	投資証券 27銘柄	5.4%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 26銘柄	6.7%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	0.4%	0.4%
香港ドル	投資証券 7銘柄	2.3%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	3.2%	3.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	0.1%	0.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 9月18日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	488,666,663
国債証券	144,258,851,560
地方債証券	18,228,632,639
特殊債証券	24,961,077,531
社債証券	7,687,895,000
未収利息	713,818,011
前払費用	13,470,772
流動資産合計	196,352,412,176
資産合計	196,352,412,176
負債の部	
流動負債	
未払解約金	142,582,056
未払利息	1,375
その他未払費用	2,160
流動負債合計	142,585,591
負債合計	142,585,591
純資産の部	
元本等	
元本	156,243,981,253
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,965,845,332
元本等合計	196,209,826,585
純資産合計	196,209,826,585
負債純資産合計	196,352,412,176

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 9月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		156,243,981,253口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2558円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,558円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>
	(1)金融商品の内容

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	176,819,822,513円
同期中における追加設定元本額	19,201,712,901円
同期中における一部解約元本額	39,777,554,161円
平成30年 9月18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）	4,127,386,803円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,343,912,915円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,614,086,451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）	435,164,469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）	53,710,355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）	159,191,966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）	271,629,507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）	223,652,169円

(平成30年 9月18日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	86,584,420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)	186,323,704円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	72,886,153円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,686,378,534円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	434,988,432円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	396,913,769円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,473,869円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	7,392,488円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,950,441円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,202,839円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,542,455円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,669,123円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,353,833円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,835,498,623円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	20,606,650,976円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,000,634,181円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,588,603,267円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	362,538,660円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	629,074,675円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,980,578円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	301,786,908円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,214,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,136,089,504円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,354,397,695円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,064,205,195円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	11,858,000,050円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	6,060,549円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	5,671,602,197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)	16,989,743,969円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	567,882,547円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	903,895,355円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,349,197,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	981,786,019円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	201,444,041円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	46,468,709円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,198,767,299円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,694,675,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,574,471,716円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,083,041,690円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	251,752,028円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,275,498円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	378,750,836円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,840,008,717円

（平成30年 9月18日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	311,416,414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>	159,186,353円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	1,512,520,541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>	724,788,784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>	1,778,755,223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>	420,444円
合計	156,243,981,253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392回利付国債（2年）	250,000,000	251,050,000	
	第125回利付国債（5年）	50,000,000	50,215,500	
	第126回利付国債（5年）	730,000,000	733,460,200	
	第127回利付国債（5年）	920,000,000	924,719,600	
	第128回利付国債（5年）	1,215,000,000	1,221,694,650	
	第129回利付国債（5年）	1,180,000,000	1,186,926,600	
	第130回利付国債（5年）	930,000,000	935,756,700	
	第131回利付国債（5年）	850,000,000	855,661,000	
	第132回利付国債（5年）	655,000,000	659,558,800	
	第133回利付国債（5年）	600,000,000	604,332,000	
	第134回利付国債（5年）	750,000,000	755,595,000	
	第135回利付国債（5年）	870,000,000	876,864,300	
	第136回利付国債（5年）	1,060,000,000	1,068,586,000	
	第1回利付国債（40年）	40,000,000	56,418,800	
	第2回利付国債（40年）	252,000,000	343,546,560	
	第3回利付国債（40年）	255,000,000	349,209,750	
	第4回利付国債（40年）	392,000,000	539,109,760	
	第5回利付国債（40年）	360,000,000	476,013,600	
	第6回利付国債（40年）	375,000,000	486,525,000	
	第7回利付国債（40年）	400,000,000	495,420,000	

第8回利付国債(40年)	480,000,000	551,236,800
第9回利付国債(40年)	691,000,000	574,794,530
第10回利付国債(40年)	690,000,000	680,271,000
第11回利付国債(40年)	200,000,000	189,748,000
第310回利付国債(10年)	130,000,000	132,882,100
第312回利付国債(10年)	645,000,000	663,924,300
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,178,527,650
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,864,278,000
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,040,999,100
第318回利付国債(10年)	895,000,000	924,364,950
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,018,033,800
第320回利付国債(10年)	960,000,000	994,128,000
第321回利付国債(10年)	960,000,000	996,720,000
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,101,998,100
第323回利付国債(10年)	510,000,000	528,798,600
第324回利付国債(10年)	790,000,000	816,149,000
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,412,938,800
第326回利付国債(10年)	527,000,000	544,533,290
第327回利付国債(10年)	375,000,000	389,077,500
第328回利付国債(10年)	380,000,000	391,487,400
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,113,676,600
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,340,447,750
第332回利付国債(10年)	793,000,000	819,922,350
第333回利付国債(10年)	815,000,000	843,736,900
第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,311,286,350
第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,289,450,000
第336回利付国債(10年)	920,000,000	949,946,000
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,403,600
第338回利付国債(10年)	1,105,000,000	1,134,823,950
第339回利付国債(10年)	1,315,000,000	1,351,412,350
第340回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,613,975,700
第341回利付国債(10年)	1,407,000,000	1,436,561,070
第342回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,529,667,200
第343回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,377,946,000
第344回利付国債(10年)	1,881,000,000	1,890,743,580
第345回利付国債(10年)	1,498,000,000	1,504,770,960
第346回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,535,814,000
第347回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,384,195,200
第348回利付国債(10年)	1,635,000,000	1,637,910,300
第349回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,932,644,100
第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,900,893,000
第351回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,019,010,600

第2回利付国債(30年)	510,000,000	637,066,500
第4回利付国債(30年)	300,000,000	395,763,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	360,087,200
第7回利付国債(30年)	474,000,000	600,415,800
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,799,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	647,325,900
第11回利付国債(30年)	430,000,000	512,861,000
第12回利付国債(30年)	590,000,000	738,750,800
第14回利付国債(30年)	742,000,000	964,904,220
第16回利付国債(30年)	465,000,000	614,172,000
第18回利付国債(30年)	500,000,000	647,030,000
第19回利付国債(30年)	490,000,000	635,157,600
第21回利付国債(30年)	345,000,000	448,255,050
第22回利付国債(30年)	335,000,000	447,124,500
第23回利付国債(30年)	329,000,000	439,501,230
第24回利付国債(30年)	310,000,000	414,795,500
第25回利付国債(30年)	300,000,000	391,626,000
第26回利付国債(30年)	383,000,000	507,072,850
第27回利付国債(30年)	440,000,000	592,196,000
第28回利付国債(30年)	386,000,000	520,841,380
第29回利付国債(30年)	177,000,000	236,218,890
第30回利付国債(30年)	492,000,000	648,815,160
第31回利付国債(30年)	425,000,000	553,898,250
第32回利付国債(30年)	495,000,000	656,488,800
第33回利付国債(30年)	533,000,000	676,718,120
第34回利付国債(30年)	797,000,000	1,047,696,350
第35回利付国債(30年)	735,000,000	937,301,400
第36回利付国債(30年)	260,000,000	332,228,000
第37回利付国債(30年)	770,000,000	968,837,100
第38回利付国債(30年)	445,000,000	550,821,000
第39回利付国債(30年)	395,000,000	498,146,350
第40回利付国債(30年)	455,000,000	564,500,300
第41回利付国債(30年)	475,000,000	578,792,250
第42回利付国債(30年)	445,000,000	542,455,000
第43回利付国債(30年)	315,000,000	384,142,500
第44回利付国債(30年)	520,000,000	634,389,600
第45回利付国債(30年)	395,000,000	463,536,450
第46回利付国債(30年)	600,000,000	704,142,000
第47回利付国債(30年)	600,000,000	718,428,000
第48回利付国債(30年)	435,000,000	500,176,050
第49回利付国債(30年)	575,000,000	661,060,250
第50回利付国債(30年)	565,000,000	565,632,800
第51回利付国債(30年)	550,000,000	481,530,500

第52回利付国債(30年)	613,000,000	566,387,480
第53回利付国債(30年)	477,000,000	451,890,720
第54回利付国債(30年)	275,000,000	274,045,750
第55回利付国債(30年)	425,000,000	423,512,500
第56回利付国債(30年)	400,000,000	398,124,000
第57回利付国債(30年)	830,000,000	825,103,000
第58回利付国債(30年)	760,000,000	754,596,400
第59回利付国債(30年)	370,000,000	357,242,400
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,011,220,850
第50回利付国債(20年)	918,000,000	964,202,940
第52回利付国債(20年)	720,000,000	767,512,800
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,036,902,150
第56回利付国債(20年)	818,000,000	882,000,320
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,564,823,400
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,273,660,200
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,125,521,750
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,124,437,800
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,140,288,600
第70回利付国債(20年)	780,000,000	889,441,800
第72回利付国債(20年)	753,000,000	849,188,220
第74回利付国債(20年)	664,000,000	752,112,800
第75回利付国債(20年)	490,000,000	557,414,200
第78回利付国債(20年)	590,000,000	665,897,600
第82回利付国債(20年)	620,000,000	711,171,000
第84回利付国債(20年)	850,000,000	972,578,500
第85回利付国債(20年)	645,000,000	745,445,850
第88回利付国債(20年)	742,000,000	872,577,160
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,365,000
第90回利付国債(20年)	580,000,000	680,206,600
第92回利付国債(20年)	734,000,000	857,656,980
第93回利付国債(20年)	632,000,000	735,976,640
第95回利付国債(20年)	305,000,000	364,313,350
第97回利付国債(20年)	677,000,000	806,002,350
第99回利付国債(20年)	693,000,000	821,558,430
第100回利付国債(20年)	207,000,000	248,017,050
第101回利付国債(20年)	355,000,000	432,027,900
第102回利付国債(20年)	457,000,000	558,230,070
第105回利付国債(20年)	390,000,000	466,553,100
第106回利付国債(20年)	370,000,000	446,286,600
第107回利付国債(20年)	378,000,000	453,335,400
第108回利付国債(20年)	390,000,000	459,837,300
第109回利付国債(20年)	340,000,000	401,910,600

第111回利付国債(20年)	456,000,000	554,901,840
第113回利付国債(20年)	467,000,000	564,957,920
第114回利付国債(20年)	508,000,000	616,244,640
第116回利付国債(20年)	830,000,000	1,018,302,100
第118回利付国債(20年)	200,000,000	241,468,000
第119回利付国債(20年)	425,000,000	503,357,250
第120回利付国債(20年)	280,000,000	325,189,200
第121回利付国債(20年)	255,000,000	305,632,800
第122回利付国債(20年)	535,000,000	634,590,250
第123回利付国債(20年)	230,000,000	281,586,700
第124回利付国債(20年)	365,000,000	442,511,400
第125回利付国債(20年)	425,000,000	526,719,500
第126回利付国債(20年)	280,000,000	340,211,200
第127回利付国債(20年)	145,000,000	174,419,050
第128回利付国債(20年)	365,000,000	439,960,050
第129回利付国債(20年)	340,000,000	405,620,000
第130回利付国債(20年)	485,000,000	579,303,400
第131回利付国債(20年)	460,000,000	543,651,000
第132回利付国債(20年)	970,000,000	1,148,198,700
第133回利付国債(20年)	60,000,000	71,790,600
第134回利付国債(20年)	50,000,000	59,924,000
第135回利付国債(20年)	275,000,000	325,789,750
第136回利付国債(20年)	320,000,000	374,940,800
第137回利付国債(20年)	415,000,000	492,372,600
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,000,000
第139回利付国債(20年)	80,000,000	93,857,600
第140回利付国債(20年)	810,000,000	962,385,300
第141回利付国債(20年)	530,000,000	630,551,600
第142回利付国債(20年)	380,000,000	457,280,600
第143回利付国債(20年)	330,000,000	388,254,900
第144回利付国債(20年)	180,000,000	209,284,200
第145回利付国債(20年)	435,000,000	518,824,500
第146回利付国債(20年)	560,000,000	668,236,800
第147回利付国債(20年)	960,000,000	1,132,924,800
第148回利付国債(20年)	394,000,000	459,258,220
第149回利付国債(20年)	940,000,000	1,095,635,800
第150回利付国債(20年)	821,000,000	944,478,400
第151回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,231,461,000
第152回利付国債(20年)	525,000,000	587,727,000
第153回利付国債(20年)	497,000,000	564,119,850
第154回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,118,450,000
第155回利付国債(20年)	770,000,000	835,118,900
第156回利付国債(20年)	770,000,000	756,994,700

	第157回利付国債(20年)	585,000,000	553,673,250
	第158回利付国債(20年)	725,000,000	721,418,500
	第159回利付国債(20年)	798,000,000	805,948,080
	第160回利付国債(20年)	775,000,000	795,181,000
	第161回利付国債(20年)	570,000,000	573,864,600
	第162回利付国債(20年)	710,000,000	713,038,800
	第163回利付国債(20年)	850,000,000	852,201,500
	第164回利付国債(20年)	910,000,000	894,111,400
	第165回利付国債(20年)	550,000,000	538,857,000
国債証券合計		131,628,000,000	144,258,851,560
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,989,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	124,012,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,196,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,129,000
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,476,000
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	505,964,000
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	610,560,000
	第674回東京都公募公債	100,100,000	101,458,357
	第684回東京都公募公債	100,000,000	102,152,000
	第685回東京都公募公債	100,000,000	101,924,000
	第688回東京都公募公債	193,500,000	197,017,830
	第689回東京都公募公債	200,000,000	204,196,000
	第703回東京都公募公債	100,000,000	103,088,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	103,560,000
	第710回東京都公募公債	100,000,000	102,866,000
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,146,000
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,345,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,212,000
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,032,000
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,910,000
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,301,000
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,017,000
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,295,000
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,030,000
	第157回神奈川県公募公債	115,600,000	116,058,932
	第167回神奈川県公募公債	100,000,000	101,498,000
	第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,250,000
	第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,846,000
	第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,726,000
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	206,438,000
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,893,000
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,215,000

平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	113,054,700	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,314,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,831,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	299,595,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	329,607,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	390,000,000	394,176,900	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	202,446,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,243,000	
平成25年度第15回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,068,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	123,629,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	228,376,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	304,284,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,969,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,828,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,404,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,504,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,321,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,063,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	100,891,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,058,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	202,460,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,328,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,428,000	
平成21年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,661,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,214,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,066,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,107,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,095,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	348,608,700	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,406,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,091,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	202,928,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,740,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,046,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	911,115,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,489,000	
第77回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,206,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,884,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,635,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,876,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,469,000	

第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,068,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,408,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,519,500	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,036,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	618,144,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,363,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,372,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,645,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	304,389,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,252,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	219,818,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,759,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,197,000	
第1回京都市公募公債(7年)	300,000,000	301,254,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	132,366,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	120,619,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,116,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	99,864,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	100,977,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,318,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,813,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	119,420,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	99,890,000	
平成25年度第11回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,084,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,487,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,813,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,694,000	
平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,788,000	
平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	151,962,720	
平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	201,880,000	
地方債証券合計	17,451,200,000	18,228,632,639	
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	221,586,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,821,000
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,059,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,554,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,481,000
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,324,000
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,066,000
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	117,143,000
	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	312,459,000
	第7回道路債券	100,000,000	109,927,000

第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,754,000	
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	104,847,000	
第 9 回道路債券	100,000,000	131,804,000	
第 1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	146,077,000	
第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	423,960,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	113,262,000	
第 4 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,406,000	
第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	243,164,000	
第 8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	238,546,000	
第 8 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	129,477,000	
第 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	1,268,251,290	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	358,992,000	
第 9 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,573,000	
第 9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	161,908,110	
第 9 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	121,021,000	
第 1 0 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,530,015,000	
第 1 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,948,000	
第 1 0 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,441,000	
第 1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,968,000	
第 1 2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,268,000	
第 1 3 7 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	1,033,950,000	
第 2 2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,818,000	
第 2 3 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,962,000	
第 3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	102,791,000	
第 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,393,000	
第 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,262,000	
第 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,334,000	
第 2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	120,325,000	
第 3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,359,000	
第 3 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,389,000	
第 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,317,000	
第 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,336,000	
第 5 回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,928,000	

第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,650,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,578,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	504,105,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	131,307,810	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,642,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,323,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,818,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,971,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	205,138,590	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,787,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,426,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,075,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,176,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,303,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,027,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	238,144,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,892,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,097,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,528,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,482,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,180,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,569,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,361,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,490,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,322,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,339,000	
第11回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	200,148,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,070,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	103,136,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	108,566,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	100,008,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	100,464,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	108,273,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,074,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,662,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,746,000	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,377,000	9,385,720	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	13,988,000	14,488,770	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,927,000	9,936,033	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,999,000	17,966,413	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,378,000	14,871,740	

第 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,256,000	22,605,419
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	18,374,000	19,451,451
第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,157,000	11,302,264
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	31,552,000	33,284,520
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	18,545,000	19,690,710
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	48,702,000	51,352,362
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	17,994,000	18,917,632
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	19,412,000	20,599,432
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,498,000	12,794,202
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	18,667,000	19,135,728
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	42,764,000	44,170,507
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,388,000	26,064,431
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,009,000
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,806,000	54,892,834
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,834,000
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,375,000	84,147,318
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,736,000	29,734,378
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,820,000	32,979,865
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,219,000	15,746,338
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,516,000	35,893,625
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,965,000	35,279,143
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,389,000	18,023,872
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,456,000	69,677,257
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,027,000	18,782,872
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,947,000	38,271,333
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,510,000	38,750,253
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,272,000	16,922,229
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,757,000	18,688,177
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,786,000	35,767,886
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,199,000	50,064,451
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,441,000	42,115,099
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,162,000	79,199,083
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,324,000	38,582,626
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,910,000	16,774,390
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,650,000	84,387,582
第 5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,578,000
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,035,000	17,957,274
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,278,000	108,906,651
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,279,000	52,004,621
第 5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,059,000	54,874,350

第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,788,000	106,410,962
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,581,000	165,633,389
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,736,000	53,111,966
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,751,000	58,963,153
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,822,000	121,554,030
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,412,000	108,175,156
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,466,000	60,332,978
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,542,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,035,000	83,489,550
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,834,000	96,125,335
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,054,000	96,038,631
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,421,000	96,395,930
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,133,000	96,947,475
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,086,000	97,056,874
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,623,000	97,856,318
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	234,554,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,252,000	33,803,966
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,878,000	36,790,011
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,177,000	18,176,529
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,881,000	17,762,863
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,270,000	37,147,774
い第768号農林債	100,000,000	100,192,000
い第810号農林債	300,000,000	300,114,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,102,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,138,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,338,000
第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,705,000
第197号商工債(3年)	200,000,000	199,968,000
第12回国際協力機構債券	100,000,000	103,188,000
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	100,585,000
第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,273,000
第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,294,000
第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,009,000
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,432,000
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	202,262,000
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,244,000
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	100,825,000
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,974,000
第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,127,000
第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,432,000
特殊債券合計	23,856,096,000	24,961,077,531
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	199,574,000

第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	200,632,000	
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,732,000	
第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,964,000	
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	101,717,000	
第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,871,000	
第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,602,000	
第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	198,932,000	
第47回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000	
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	99,666,000	
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,644,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,044,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,822,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,666,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,294,000	
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,985,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,419,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,725,000	
第69回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,766,000	
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	119,053,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	307,464,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,555,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	102,202,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	102,006,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,967,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	116,568,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,747,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,652,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,892,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	116,798,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,478,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,633,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,794,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,853,000	

第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,786,000	
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	99,928,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,605,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	129,190,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,450,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,034,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,513,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,832,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,451,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	240,454,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,290,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,328,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,149,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,899,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,890,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,994,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,790,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,803,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,502,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,496,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,429,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,602,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,752,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	110,936,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	211,334,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,290,000	
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	102,737,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,658,000	
社債券合計	7,400,000,000	7,687,895,000	
合計		195,136,456,730	

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）

（平成30年 9月18日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	362,350,430
コール・ローン	203,326,798
国債証券	173,429,049,559
派生商品評価勘定	1,008,385
未収利息	1,318,741,743
前払費用	27,818,582
流動資産合計	175,342,295,497
資産合計	175,342,295,497
負債の部	
流動負債	
未払解約金	266,814,079
未払利息	572
その他未払費用	1,458
流動負債合計	266,816,109
負債合計	266,816,109
純資産の部	
元本等	
元本	100,496,412,078
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	74,579,067,310
元本等合計	175,075,479,388
純資産合計	175,075,479,388
負債純資産合計	175,342,295,497

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>
	外貨建資産等の会計処理

項 目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「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	(平成30年 9月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		100,496,412,078口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7421円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,421円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

(平成30年 9月18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	510,252,358	-	509,243,973	1,008,385
	米ドル	249,364,121	-	249,136,287	227,834
	カナダドル	16,739,618	-	16,720,713	18,905
	ユーロ	167,195,602	-	166,920,331	275,271
	英ポンド	37,558,837	-	37,521,642	37,195
	ポーランドズロチ	9,119,700	-	9,105,000	14,700
	南アフリカランド	30,274,480	-	29,840,000	434,480
合計		510,252,358	-	509,243,973	1,008,385

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日

至 平成30年 9月18日

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

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	114,015,594,906円
--------------------------------	------------------

（平成30年 9月18日現在）	
同期中における追加設定元本額	6,281,494,378円
同期中における一部解約元本額	19,800,677,206円
平成30年 9月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	10,218,996,721円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	547,964,053円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,527,722,221円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	783,399,484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）	24,512,720円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,082,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	31,884,240円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	84,101,069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）	93,161,714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）	48,200,531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）	115,935,484円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	14,146,960円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	68,325,211円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	199,277,777円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	305,680,456円
イオン・バランス戦略ファンド	51,712,487円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,897,550円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	11,784,259円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	8,659,258円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	23,249,844円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	12,296,695円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	10,677,614円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	13,924,920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＞	1,816,267,350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＞	286,524,890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＞	13,099,715,465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＞	6,312,976,811円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	14,266,614,664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＞	44,184,531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＞	115,867,667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＞	600,777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＞	896,419,146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＞	130,475,879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＞	1,371,137,002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＞	1,727,753,184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＞	2,222,016,314円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 ＜適格機関投資家専用＞	7,404,839,356円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T ＜適格機関投資家限定＞	4,400,331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＞	11,950,077,478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）	981,199,918円

（平成30年 9月18日現在）	
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	2,047,111,618円
S M A M・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	206,182,810円
S M A M・バランスファンドV A 20 <適格機関投資家専用>	655,451,101円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	2,637,771,415円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	165,635,787円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	43,915,013円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	14,415,303円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	163,934,516円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	597,006,926円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T <適格機関投資家専用>	193,702,523円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A 2 <適格機関投資家専用>	182,591,770円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A 2 <適格機関投資家専用>	55,444,546円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A 2 <適格機関投資家専用>	7,191,746円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L 2 <適格機関投資家専用>	1,501,116,734円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T 2 <適格機関投資家専用>	23,493,972円
S M A M・グローバルバランスファンド（標準型）V A <適格機関投資家限定>	4,332,818,566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>	1,941,980,208円
S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	6,817,026,530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>	890,871,263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>	14,193,917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>	40,524,456円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	422,899,795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>	202,618,815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>	498,813,319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>	35,016円
合計	100,496,412,078円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,971,093.76	

US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,951,250.00	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,971,718.76	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,949,375.00	
US TREASURY N/B 1	2,300,000.00	2,265,859.37	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,967,500.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,965,937.50	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,962,187.50	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,941,640.64	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,940,703.14	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,732,406.26	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,923,125.00	
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,647,406.25	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,862,656.25	
US TREASURY N/B 1.125	4,500,000.00	4,286,953.12	
US TREASURY N/B 1.125	2,700,000.00	2,568,164.07	
US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,324,453.12	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,969,687.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,941,171.89	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,937,187.50	
US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,461,625.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,332,382.83	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,774,765.64	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,952,187.50	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,948,437.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,929,687.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,944,218.75	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,903,125.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,917,187.52	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,912,187.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,930,625.00	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,891,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,900,000.00	1,847,898.44	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,915,859.39	
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,591,023.45	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,900,390.64	
US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,312,062.51	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,847,812.52	
US TREASURY N/B 1.375	3,500,000.00	3,262,109.37	
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,322,851.57	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,784,609.39	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,962,265.64	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,931,640.65	

US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,936,835.93
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	978,437.50
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,954,375.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,868,281.25
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,824,453.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,821,640.64
US TREASURY N/B 1.5	5,800,000.00	5,197,343.75
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,984,062.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,973,281.25
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,945,937.52
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,967,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,429,453.12
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,936,718.75
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,410,859.37
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,860,312.50
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,810,937.52
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,326,093.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,834,296.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,831,718.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,816,718.75
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,462,343.78
US TREASURY N/B 1.625	5,300,000.00	4,811,406.25
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	3,964,687.52
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,249,687.50
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,952,812.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,897,812.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,889,375.00
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,367,929.70
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,882,812.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,881,406.25
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,880,468.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,877,890.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,869,453.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,858,203.14
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,413,218.75
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,953,593.75
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,910,000.00
US TREASURY N/B 1.875	3,600,000.00	3,484,687.50
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,868,125.00
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,932,656.26
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,896,406.25
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,893,359.39
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,636,914.07

US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,848,125.00	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,880,937.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,695,656.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,957,343.75	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,263,703.12	
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,572,125.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,944,453.14	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,940,937.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,934,843.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,928,281.25	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,923,125.00	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,189,476.58	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,404,570.33	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,012,812.50	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,902,500.00	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	482,539.06	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,893,359.39	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,294,179.71	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,902,968.76	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,756,250.00	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,375,585.95	
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,286,312.52	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,039,984.37	
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,758,734.40	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,961,796.89	
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,656,757.82	
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,667,328.12	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,920,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,936,015.64	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,930,390.64	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,918,203.14	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,874,375.00	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	2,981,570.32	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,919,531.26	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,837,187.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,346,601.58	
US TREASURY N/B 2.125	4,400,000.00	4,201,656.27	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,716,468.75	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	4,746,484.40	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,946,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,957,343.75	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,970,468.76	

US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,753,843.76
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,901,328.14
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,932,812.50
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,441,757.82
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,051,445.34
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	2,976,968.75
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,197,851.59
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,859,968.75
US TREASURY N/B 2.25	6,100,000.00	5,744,484.37
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,827,515.65
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,507,000.00
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,980,625.00
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	2,967,187.50
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,977,031.26
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,173,937.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	7,750,000.00
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,720,156.28
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,906,640.65
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,567,296.87
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,478,890.64
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,512,703.12
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,323,101.58
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,319,656.25
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,988,125.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,477,656.25
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	497,148.44
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,976,250.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,975,312.52
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,954,062.52
US TREASURY N/B 2.625	4,300,000.00	4,215,007.83
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	3,987,812.52
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	993,203.13
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,985,312.50
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,151,078.15
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,053,382.83
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,976,250.00
US TREASURY N/B 2.75	5,900,000.00	5,822,562.50
US TREASURY N/B 2.75	5,800,000.00	5,678,562.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,871,718.76
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	4,489,875.02
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,223,000.00
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,388,789.07
US TREASURY N/B 2.875	4,200,000.00	4,178,671.89

US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,094,070.31	
US TREASURY N/B 2.875	4,500,000.00	4,450,429.71	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,472,656.25	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,866,171.89	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,807,500.00	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,422,812.50	
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,761,609.38	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,903,750.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,900,000.00	
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,776,351.58	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,436,328.12	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,142,421.88	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,016,929.70	
US TREASURY N/B 3	1,500,000.00	1,459,453.12	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,022,265.64	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,000,312.50	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,000,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,397,375.00	
US TREASURY N/B 3.125	5,100,000.00	5,088,445.33	
US TREASURY N/B 3.125	900,000.00	898,031.25	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,040,625.00	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,167,500.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,553,085.96	
US TREASURY N/B 3.5	1,500,000.00	1,595,625.00	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,047,265.65	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,074,062.50	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,091,406.25	
US TREASURY N/B 3.625	4,800,000.00	5,203,875.02	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,425,390.65	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,653,750.00	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,425,312.52	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,682,226.57	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,177,187.50	
US TREASURY N/B 4.25	1,800,000.00	2,126,531.25	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	595,585.94	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,797,187.50	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,679,343.75	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,166,328.13	
US TREASURY N/B 4.5	900,000.00	1,077,187.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,210,937.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,216,328.13	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,599,242.19	

	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,894,687.50
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	638,242.19
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	597,578.12
	US TREASURY N/B 5.375	720,000.00	894,431.25
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	606,445.31
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,202,578.13
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,250,000.00
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	922,000.00
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	658,046.87
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	627,773.44
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,500,484.37
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,109,687.50
	米ドル 小計	708,720,000.00	693,059,885.79 (77,504,887,027)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,887,040.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,986,560.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,265,511.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,933,116.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,918,000.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	895,140.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,483,770.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,983,200.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,933,360.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,600,000.00	1,507,520.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	997,750.00
	CANADA-GOV'T 1.75	800,000.00	783,248.00
	CANADA-GOV'T 2	1,300,000.00	1,261,260.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,600,000.00	1,593,872.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,326,519.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,018,700.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,949,400.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	559,390.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,028,020.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,046,060.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,836,360.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,531,750.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,923,345.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,089,515.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	791,166.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,000,000.00	1,416,950.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	721,845.00
	カナダドル 小計	39,800,000.00	41,668,367.00 (3,568,895,633)

メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	38,000,000.00	41,817,860.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,516,200.00
	MEXICAN BONOS 6.5	35,000,000.00	33,394,900.00
	MEXICAN BONOS 7.5	7,000,000.00	6,767,740.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	50,068,000.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,048,400.00
	MEXICAN BONOS 8.5	37,000,000.00	38,221,370.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	41,488,400.00
メキシコペソ 小計		247,000,000.00	249,322,870.00 (1,475,991,390)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,373,060.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,340,170.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	708,974.00
	BELGIAN 0.8	500,000.00	501,090.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,891,620.00
	BELGIAN 0304 5	1,800,000.00	2,806,488.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,727,280.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,171,260.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,587,468.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	1,937,490.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,302,840.00
	BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	2,005,881.00
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,036,430.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,665,645.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,279,060.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	626,725.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,015,860.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	545,775.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,454,110.00
	BELGIAN 1	1,300,000.00	1,294,917.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	404,328.00
	BELGIAN 1.6	500,000.00	487,960.00
	BELGIAN 1.9	700,000.00	755,671.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	523,605.00
	BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,458,090.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	996,820.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	973,010.00
	BTPS 0.2	2,000,000.00	1,973,680.00
	BTPS 0.35	500,000.00	497,090.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,457,850.00
	BTPS 0.45	2,000,000.00	1,964,460.00
	BTPS 0.65	1,600,000.00	1,593,072.00
BTPS 0.65	2,000,000.00	1,877,380.00	

BTPS 0.7	2,000,000.00	2,000,240.00
BTPS 0.9	800,000.00	777,672.00
BTPS 0.95	2,000,000.00	1,927,260.00
BTPS 1.05	1,300,000.00	1,309,568.00
BTPS 1.2	1,000,000.00	988,700.00
BTPS 1.25	2,000,000.00	1,824,340.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	1,985,500.00
BTPS 1.45	2,000,000.00	1,982,860.00
BTPS 1.45	1,000,000.00	946,310.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,021,100.00
BTPS 1.5	1,600,000.00	1,518,832.00
BTPS 1.6	2,000,000.00	1,885,300.00
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,726,560.00
BTPS 1.85	1,000,000.00	984,690.00
BTPS 2	1,300,000.00	1,265,849.00
BTPS 2	1,600,000.00	1,514,672.00
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,431,120.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,049,220.00
BTPS 2.2	1,000,000.00	968,910.00
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,060,812.00
BTPS 2.45	600,000.00	558,420.00
BTPS 2.5	600,000.00	609,522.00
BTPS 2.7	1,900,000.00	1,677,320.00
BTPS 2.8	900,000.00	763,641.00
BTPS 2.95	1,000,000.00	949,350.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,459,785.00
BTPS 3.45	1,100,000.00	1,094,401.00
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,423,579.00
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,659,750.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,129,780.00
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,419,360.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,168,040.00
BTPS 4	2,500,000.00	2,650,450.00
BTPS 4	2,700,000.00	2,999,025.00
BTPS 4.25	1,500,000.00	1,555,770.00
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,420,336.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,846,043.00
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,563,764.00
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,362,940.00
BTPS 4.5	1,700,000.00	1,937,643.00
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,857,270.00
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,825,325.00

BTPS 4.75	2,100,000.00	2,461,221.00
BTPS 4.75	1,600,000.00	1,937,744.00
BTPS 5	2,000,000.00	2,233,300.00
BTPS 5	1,000,000.00	1,162,980.00
BTPS 5	2,670,000.00	3,290,881.80
BTPS 5	2,000,000.00	2,470,280.00
BTPS 5	1,900,000.00	2,338,273.00
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,302,235.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,289,240.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,292,800.00
BTPS 5.75	2,200,000.00	2,869,416.00
BTPS 6	2,900,000.00	3,802,393.00
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,391,822.40
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,345,900.00
BTPS 9	1,000,000.00	1,339,520.00
BUNDESÖBL-170 0.25	1,000,000.00	1,009,220.00
BUNDESÖBL-171 0	2,000,000.00	2,018,700.00
BUNDESÖBL-172 0.25	2,000,000.00	2,033,340.00
BUNDESÖBL-173 0	2,500,000.00	2,532,025.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,039,240.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,948,550.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,000,000.00	2,992,470.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	100,000.00	97,999.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,700,000.00	1,750,405.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,200,000.00	2,255,704.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,500,000.00	1,521,495.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,000,000.00	3,028,380.00
DEUTSCHLAND REP 1	1,800,000.00	1,909,170.00
DEUTSCHLAND REP 1	200,000.00	212,538.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	400,000.00	414,972.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,679,775.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,692,475.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,158,820.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,700,000.00	4,026,932.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,698,350.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,199,760.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,158,700.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,659,735.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,582,815.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,400,000.00	1,511,944.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,605,465.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,933,546.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	2,829,666.00

DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,192,900.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,152,880.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,229,495.00	
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,157,487.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,458,035.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,100,000.00	1,561,186.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,039,107.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	2,996,488.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,700,000.00	2,700,042.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,345,446.80	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,604,508.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	400,000.00	653,928.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,541,050.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	493,775.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	203,266.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,072,950.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,072,380.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,107,090.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	655,590.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	721,146.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	743,204.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,101,410.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,252,200.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,024,810.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,700,000.00	2,725,893.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,007,740.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,004,880.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,334,546.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,942,550.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,037,290.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,500,000.00	2,537,575.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,018,660.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,400,000.00	3,413,294.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,094,280.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,591,350.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,991,680.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,549,520.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,337,160.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	5,100,000.00	5,591,181.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,100,000.00	1,171,819.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	967,240.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,000,000.00	2,160,580.00	

FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,515,136.00
FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000.00	4,821,418.00
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,717,805.00
FRANCE O.A.T. 2.5	3,200,000.00	3,775,168.00
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,361,885.00
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,583,600.00
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,777,128.00
FRANCE O.A.T. 3.25	3,100,000.00	4,250,937.00
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,256,560.00
FRANCE O.A.T. 3.5	3,300,000.00	4,078,602.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,000,000.00	3,142,050.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,320,225.00
FRANCE O.A.T. 4	2,200,000.00	3,251,072.00
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,882,307.70
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,468,310.00
FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000.00	4,625,816.00
FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000.00	5,274,456.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000.00	4,485,285.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,454,700.00
FRANCE O.A.T. 5.75	2,900,000.00	4,711,340.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,205,730.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	934,983.00
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	837,438.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	400,264.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	722,792.00
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	697,788.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,026,960.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	306,198.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,050,910.00
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	682,704.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,172,880.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	587,335.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,067,833.80
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,113,380.00
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	1,975,350.00
IRISH GOVT 5.9	600,000.00	641,850.00
NETHERLANDS GOVT 0	1,500,000.00	1,516,380.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,022,900.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,707,786.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,522,320.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,436,680.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	400,000.00	407,472.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,743,968.00

NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,113,560.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,646,370.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	2,100,000.00	2,581,236.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	1,822,197.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	883,920.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,611,540.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,172,530.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,362,155.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,136,050.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,024,597.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,100,594.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,008,260.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	2,400,000.00	2,390,448.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,432,032.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	202,012.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	900,000.00	956,340.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	182,514.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	508,365.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,500,000.00	1,637,625.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,088,980.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	800,000.00	955,168.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	700,525.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	600,000.00	689,622.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	1,000,000.00	1,115,680.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,140,150.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	855,160.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,620,000.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,954,342.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,335,650.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,495,420.00	
SPANISH GOV'T 0.05	1,100,000.00	1,102,299.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,017,200.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,043,200.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,050,780.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,017,660.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,047,420.00	
SPANISH GOV'T 1.4	900,000.00	898,452.00	
SPANISH GOV'T 1.4	600,000.00	595,314.00	
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,008,540.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,525,680.00	
SPANISH GOV'T 1.6	2,200,000.00	2,305,204.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,336,598.00	

	SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,053,900.00
	SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,158,780.00
	SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,048,360.00
	SPANISH GOV'T 2.7	100,000.00	102,103.00
	SPANISH GOV'T 2.75	2,800,000.00	3,134,208.00
	SPANISH GOV'T 2.9	2,100,000.00	2,255,253.00
	SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,263,405.00
	SPANISH GOV'T 3.8	1,900,000.00	2,225,850.00
	SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,672,275.00
	SPANISH GOV'T 4.2	1,850,000.00	2,442,536.50
	SPANISH GOV'T 4.3	2,000,000.00	2,105,080.00
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,387,020.00
	SPANISH GOV'T 4.6	600,000.00	626,022.00
	SPANISH GOV'T 4.65	2,800,000.00	3,494,148.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,900,000.00	2,697,411.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,441,200.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,210,560.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,900,820.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,100,000.00	1,478,004.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,821,888.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,047,750.00
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,089,718.00
	SPANISH GOV'T 5.75	1,900,000.00	2,820,626.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,625,018.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,394,125.00
	SPANISH GOV'T 6	2,500,000.00	3,582,800.00
	ユーロ 小計	469,470,000.00	536,209,949.00 (69,980,760,443)
英ポンド	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,177,116.00
	UK TSY GILT 0.75	300,000.00	294,612.00
	UK TSY GILT 1.25	1,100,000.00	1,083,027.00
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,943,442.00
	UK TSY GILT 1.5	2,250,000.00	2,277,067.50
	UK TSY GILT 1.5	1,500,000.00	1,375,200.00
	UK TSY GILT 1.625	450,000.00	433,129.50
	UK TSY GILT 1.625	1,200,000.00	1,210,260.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,085,260.00
	UK TSY GILT 1.75	1,000,000.00	984,650.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,554,250.00
	UK TSY GILT 2	2,100,000.00	2,204,601.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,847,015.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	1,985,968.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,851,232.00

	UK TSY GILT 3.25	2,300,000.00	2,920,793.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,300,000.00	3,058,149.00	
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,162,220.00	
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,114,940.00	
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,516,760.00	
	UK TSY GILT 3.75	1,800,000.00	2,670,066.00	
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,656,360.00	
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,813,721.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,371,700.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,104,400.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,599,067.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,556,500.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,292,496.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,576,486.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,400,000.00	2,190,874.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,826,488.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,700,000.00	2,349,859.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,717,262.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,700,000.00	1,797,971.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,250,000.00	1,686,275.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,939,938.00	
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,974,848.00	
	UK TSY GILT 6	600,000.00	856,950.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,930,375.80	
	英bond 小計	64,170,000.00	78,991,328.80 (11,611,725,333)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,360,320.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,511,000.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,735,300.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,486,430.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,330,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	9,600,000.00	10,756,800.00	
	スウェーデンクローナ 小計	46,600,000.00	53,180,490.00 (666,351,539)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,895,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,005,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	8,500,000.00	8,687,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	2,000,000.00	2,012,400.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,287,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	6,000,000.00	6,394,200.00	
	ノルウェークローネ 小計	30,500,000.00	31,280,800.00 (427,608,536)	

デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	3,000,000.00	3,003,600.00
	DENMARK - BULLET 0.5	1,000,000.00	1,009,900.00
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,410,500.00
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,256,200.00
	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,753,200.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,430,400.00
	DENMARK - BULLET 4.5	13,500,000.00	22,993,200.00
デンマーククローネ 小計		48,500,000.00	60,857,000.00 (1,064,388,930)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,500,000.00	2,495,500.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,989,200.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,010,600.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,500,000.00	4,307,400.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	2,000,000.00	1,897,800.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,065,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,128,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,150,200.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	1,500,000.00	1,564,800.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,461,600.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,749,780.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,500,000.00	1,834,500.00
	ポーランドズロチ 小計		34,200,000.00
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,980,950.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	997,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	401,540.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,400,000.00	2,320,080.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	400,000.00	392,440.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	300,000.00	302,484.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,558,695.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	2,020,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,517,289.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,200,000.00	1,210,680.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	977,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	979,301.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,300,000.00	2,415,230.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,006,590.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,032,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,338,036.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,696,660.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,115,870.80
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,600,000.00	1,924,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,000,000.00	3,504,900.00

	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,859,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,285,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,399,900.00	
オーストラリアドル 小計		42,500,000.00	45,238,345.80 (3,623,591,498)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,106,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,023,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	394,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	689,689.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	409,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	311,550.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,040,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,600,000.00	1,640,048.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	537,622.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,400,000.00	1,514,100.00	
シンガポールドル 小計		8,400,000.00	8,667,609.50 (705,283,385)	
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,907,074.72	
	MALAYSIA GOVT 3.502	8,500,000.00	8,062,162.62	
	MALAYSIA GOVT 4.378	6,500,000.00	6,565,675.35	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,011,669.50	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,933,505.00	
マレーシアリングット 小計		31,000,000.00	30,480,087.19 (822,047,951)	
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	65,000,000.00	44,252,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	22,000,000.00	21,315,800.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	63,000,000.00	50,702,400.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	4,000,000.00	3,549,200.00	
南アフリカランド 小計		154,000,000.00	119,819,400.00 (895,050,918)	
合計			173,429,049,559 (173,429,049,559)	

(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 225銘柄	44.3%	44.7%
カナダドル	国債証券 27銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	0.8%	0.9%
ユーロ	国債証券 271銘柄	40.0%	40.4%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.6%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.2%	0.2%

デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	23銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.5%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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)

(平成30年 9月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	145,018,374
コール・ローン	367,165,339
国債証券	45,346,270,292
派生商品評価勘定	1,209,686
未収利息	330,160,269
前払費用	14,349,343
流動資産合計	46,204,173,303

資産合計

46,204,173,303

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	542,809,917
未払解約金	77,000,000
未払利息	1,033
その他未払費用	348
流動負債合計	619,811,298

負債合計

619,811,298

純資産の部

元本等

元本	33,296,978,321
剰余金	
剰余金又は欠損金()	12,287,383,684
元本等合計	45,584,362,005

純資産合計

45,584,362,005

負債純資産合計

46,204,173,303

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 9月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		33,296,978,321口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3690円
	(10,000口当たりの純資産額	13,690円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18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>
	(1)金融商品の内容

項目	自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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せん。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、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委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 9月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 9月18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	45,321,159,769	-	45,862,760,000	541,600,231
	米ドル	20,331,816,950	-	20,498,940,000	167,123,050
	カナダドル	941,213,464	-	949,605,000	8,391,536
	メキシコペソ	379,137,000	-	388,740,000	9,603,000
	ユーロ	18,197,393,360	-	18,452,700,000	255,306,640
	英ポンド	3,022,656,768	-	3,099,379,000	76,722,232
	スウェーデンクローナ	173,490,460	-	179,179,000	5,688,540
	ノルウェークローネ	104,318,710	-	107,835,000	3,516,290
	デンマーククローネ	277,937,520	-	281,589,000	3,651,480
	ポーランドズロチ	283,573,251	-	287,945,000	4,371,749
	オーストラリアドル	962,107,736	-	967,637,000	5,529,264
	シンガポールドル	403,360,000	-	406,250,000	2,890,000
	南アフリカランド	244,154,550	-	242,961,000	1,193,550
合計	45,321,159,769	-	45,862,760,000	541,600,231	

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 9月14日 至 平成30年 9月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(平成30年 9月18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	43,336,220,769円
同期中における追加設定元本額	7,168,523,113円
同期中における一部解約元本額	17,207,765,561円
平成30年 9月18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)	9,611,083,204円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	5,005,003,007円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,211,520,976円
イオン・バランス戦略ファンド	574,962,361円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	86,822,932円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	27,382,925円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	52,529,180円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	15,552,434円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	6,718,967円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,362,660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>	5,323,704,828円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	5,542,001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)	4,987,196,406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>	3,620,361,540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>	74,594,874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>	636,786,192円

(平成30年 9月18日現在)	
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>	305,130,365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>	747,723,469円
合計	33,296,978,321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	600,000.00	591,093.75	
		US TREASURY N/B 1	900,000.00	884,671.87	
		US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	981,093.75	
		US TREASURY N/B 1	700,000.00	686,382.81	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	686,164.06	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	975,859.38	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	974,375.00	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	959,843.75	
		US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	667,953.12	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	952,656.25	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	951,171.88	
		US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	949,843.75	
		US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	984,843.75	
		US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	980,390.63	
		US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	783,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	480,781.25	
		US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	952,109.38	
		US TREASURY N/B 1.25	700,000.00	647,445.31	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	984,062.50	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	982,812.50	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	982,421.88	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	981,406.25	
		US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	980,625.00	
		US TREASURY N/B 1.375	2,300,000.00	2,252,382.82	
		US TREASURY N/B 1.375	1,200,000.00	1,173,656.25	
		US TREASURY N/B 1.375	900,000.00	879,187.50	

US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,459,453.12
US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,069,148.44
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	970,546.88
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	966,796.88
US TREASURY N/B 1.375	400,000.00	385,343.75
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	961,953.13
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	466,015.62
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	929,140.63
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	928,203.13
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	987,421.88
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	986,328.13
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	980,781.25
US TREASURY N/B 1.5	1,700,000.00	1,664,207.02
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	573,656.25
US TREASURY N/B 1.5	1,800,000.00	1,694,671.88
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	470,273.44
US TREASURY N/B 1.5	1,400,000.00	1,254,531.25
US TREASURY N/B 1.625	400,000.00	396,437.50
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	986,484.38
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	983,750.00
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	783,875.00
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,468,359.37
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,169,437.50
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	762,750.00
US TREASURY N/B 1.625	1,600,000.00	1,520,500.00
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	944,765.63
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	943,906.25
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	469,453.12
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,638,703.13
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,634,062.50
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	684,687.50
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	676,156.25
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	192,625.00
US TREASURY N/B 1.75	900,000.00	866,039.06
US TREASURY N/B 1.75	800,000.00	768,750.00
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	576,281.25
US TREASURY N/B 1.75	1,200,000.00	1,152,187.50
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	956,484.38
US TREASURY N/B 1.75	1,100,000.00	1,044,656.25
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	492,265.62
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	582,000.00
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	967,968.75

US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	967,031.25
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	966,328.13
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	965,468.75
US TREASURY N/B 1.875	1,600,000.00	1,543,125.00
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	962,031.25
US TREASURY N/B 1.875	1,500,000.00	1,440,468.75
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	282,609.37
US TREASURY N/B 2	500,000.00	492,890.62
US TREASURY N/B 2	500,000.00	492,109.37
US TREASURY N/B 2	400,000.00	393,031.25
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,944,453.14
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,254,718.75
US TREASURY N/B 2	600,000.00	586,968.75
US TREASURY N/B 2	800,000.00	780,875.00
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,169,250.00
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	974,296.88
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	972,734.38
US TREASURY N/B 2	600,000.00	583,125.00
US TREASURY N/B 2	700,000.00	677,250.00
US TREASURY N/B 2	1,300,000.00	1,254,601.56
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,218,242.19
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,155,093.75
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	951,484.38
US TREASURY N/B 2	800,000.00	761,000.00
US TREASURY N/B 2	600,000.00	570,140.62
US TREASURY N/B 2	2,200,000.00	2,076,765.63
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,127,437.50
US TREASURY N/B 2	1,900,000.00	1,764,773.44
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	493,632.81
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	491,992.19
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	784,625.00
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	980,000.00
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	391,468.75
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	390,718.75
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	680,914.06
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	968,593.75
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	961,796.88
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	959,765.63
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	479,648.44
US TREASURY N/B 2.125	1,100,000.00	1,051,789.06
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	954,921.88
US TREASURY N/B 2.125	1,200,000.00	1,139,156.25
US TREASURY N/B 2.25	400,000.00	394,625.00

US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	591,468.75
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	492,617.19
US TREASURY N/B 2.25	700,000.00	688,460.94
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	967,109.38
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	966,406.25
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	768,937.50
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	864,492.19
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	480,156.25
US TREASURY N/B 2.25	1,100,000.00	1,048,867.19
US TREASURY N/B 2.25	1,900,000.00	1,795,796.87
US TREASURY N/B 2.25	1,700,000.00	1,600,921.87
US TREASURY N/B 2.25	1,200,000.00	1,127,906.25
US TREASURY N/B 2.25	1,300,000.00	1,085,500.00
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	495,156.25
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	494,257.81
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,937,500.00
US TREASURY N/B 2.375	1,600,000.00	1,525,375.00
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	883,195.31
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	976,718.75
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	973,671.88
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	884,843.75
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	882,265.63
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	793,406.25
US TREASURY N/B 2.625	1,400,000.00	1,395,843.75
US TREASURY N/B 2.625	1,800,000.00	1,792,687.50
US TREASURY N/B 2.625	700,000.00	695,843.75
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	496,914.06
US TREASURY N/B 2.625	500,000.00	490,117.19
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,495,429.69
US TREASURY N/B 2.75	900,000.00	893,390.62
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,488,164.07
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,486,289.07
US TREASURY N/B 2.75	1,100,000.00	1,086,937.50
US TREASURY N/B 2.75	1,800,000.00	1,776,375.00
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	685,343.75
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	561,515.62
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	374,156.25
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	370,500.00
US TREASURY N/B 2.75	1,200,000.00	1,111,031.25
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	795,937.50
US TREASURY N/B 2.875	600,000.00	596,765.62
US TREASURY N/B 2.875	1,600,000.00	1,582,375.00

US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	692,343.75
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	955,390.63
US TREASURY N/B 2.875	1,300,000.00	1,237,437.50
US TREASURY N/B 2.875	900,000.00	855,703.12
US TREASURY N/B 3	400,000.00	391,468.75
US TREASURY N/B 3	1,200,000.00	1,171,125.00
US TREASURY N/B 3	1,300,000.00	1,267,500.00
US TREASURY N/B 3	900,000.00	877,289.06
US TREASURY N/B 3	700,000.00	682,171.87
US TREASURY N/B 3	800,000.00	779,062.50
US TREASURY N/B 3	1,200,000.00	1,167,843.75
US TREASURY N/B 3	200,000.00	194,593.75
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	805,937.50
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	300,046.87
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	300,000.00
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	399,250.00
US TREASURY N/B 3.125	1,300,000.00	1,297,054.69
US TREASURY N/B 3.375	1,500,000.00	1,512,187.50
US TREASURY N/B 3.375	1,000,000.00	1,041,875.00
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	809,437.50
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	319,125.00
US TREASURY N/B 3.625	2,000,000.00	2,024,687.50
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,221,937.50
US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,300,968.75
US TREASURY N/B 3.625	1,300,000.00	1,410,601.56
US TREASURY N/B 3.75	500,000.00	551,250.00
US TREASURY N/B 3.75	1,200,000.00	1,327,593.75
US TREASURY N/B 3.875	400,000.00	448,593.75
US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	470,875.00
US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	472,562.50
US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	238,234.37
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	359,437.50
US TREASURY N/B 4.375	400,000.00	479,812.50
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	361,054.68
US TREASURY N/B 4.5	400,000.00	478,750.00
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	242,187.50
US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	364,898.43
US TREASURY N/B 4.625	500,000.00	618,867.19
US TREASURY N/B 4.75	600,000.00	757,875.00
US TREASURY N/B 5	200,000.00	255,296.87
US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	239,031.25
US TREASURY N/B 5.25	100,000.00	119,929.68
US TREASURY N/B 5.375	200,000.00	248,453.12

	US TREASURY N/B 6	200,000.00	240,515.62
	US TREASURY N/B 6.125	500,000.00	625,000.00
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	576,250.00
	US TREASURY N/B 6.25	200,000.00	263,218.75
	US TREASURY N/B 6.5	300,000.00	376,664.06
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	346,265.62
	米ドル 小計	185,100,000.00	181,147,800.81 (20,257,758,564)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	500,000.00	471,760.00
	CANADA-GOV'T 0.75	400,000.00	397,312.00
	CANADA-GOV'T 0.75	400,000.00	389,388.00
	CANADA-GOV'T 0.75	600,000.00	579,934.80
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	287,700.00
	CANADA-GOV'T 1	400,000.00	358,056.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,100,000.00	1,090,760.00
	CANADA-GOV'T 1.5	800,000.00	773,344.00
	CANADA-GOV'T 1.5	500,000.00	471,100.00
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	299,325.00
	CANADA-GOV'T 2	200,000.00	194,040.00
	CANADA-GOV'T 2.25	200,000.00	199,234.00
	CANADA-GOV'T 2.5	400,000.00	404,612.00
	CANADA-GOV'T 2.75	800,000.00	814,960.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	541,500.00
	CANADA-GOV'T 3.25	300,000.00	308,406.00
	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	306,909.00
	CANADA-GOV'T 3.5	500,000.00	612,120.00
	CANADA-GOV'T 3.75	700,000.00	708,890.00
	CANADA-GOV'T 4	600,000.00	769,338.00
	CANADA-GOV'T 5	300,000.00	417,903.00
	CANADA-GOV'T 5.75	200,000.00	263,722.00
	CANADA-GOV'T 5.75	200,000.00	283,390.00
	カナダドル 小計	10,500,000.00	10,943,703.80 (937,328,230)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	7,000,000.00	7,703,290.00
	MEXICAN BONOS 5	6,000,000.00	5,793,600.00
	MEXICAN BONOS 5.75	5,000,000.00	4,379,050.00
	MEXICAN BONOS 6.5	6,000,000.00	5,775,120.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,816,560.00
	MEXICAN BONOS 7.75	4,000,000.00	3,896,640.00
	MEXICAN BONOS 7.75	3,000,000.00	2,906,250.00
	MEXICAN BONOS 7.75	8,000,000.00	7,678,080.00
	MEXICAN BONOS 8	7,000,000.00	7,009,520.00

	MEXICAN BONOS 8	9,000,000.00	9,021,780.00
	MEXICAN BONOS 8.5	2,000,000.00	2,066,020.00
	MEXICAN BONOS 8.5	4,000,000.00	4,148,840.00
	メキシコペソ 小計	65,000,000.00	64,194,750.00 (380,032,920)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	200,000.00	274,612.00
	BELGIAN 0.8	400,000.00	412,360.00
	BELGIAN 0.8	300,000.00	303,846.00
	BELGIAN 0291 5.5	500,000.00	722,905.00
	BELGIAN 0304 5	700,000.00	1,091,412.00
	BELGIAN 0308 4	300,000.00	345,456.00
	BELGIAN 0318 3.75	300,000.00	325,689.00
	BELGIAN 0320 4.25	400,000.00	608,816.00
	BELGIAN 0321 4.25	200,000.00	227,940.00
	BELGIAN 0324 4.5	400,000.00	521,136.00
	BELGIAN 0325 4.25	500,000.00	589,965.00
	BELGIAN 0328 2.25	500,000.00	555,215.00
	BELGIAN 0332 2.6	400,000.00	455,812.00
	BELGIAN 0333 3	100,000.00	125,345.00
	BELGIAN 0338 0.5	300,000.00	304,758.00
	BELGIAN 1	400,000.00	415,460.00
	BELGIAN 1	300,000.00	298,827.00
	BELGIAN 1.6	300,000.00	292,776.00
	BELGIAN 1.9	100,000.00	107,953.00
	BELGIAN 2.15	200,000.00	209,442.00
	BELGIAN 3.75	200,000.00	291,618.00
	BTPS 0.35	400,000.00	388,760.00
	BTPS 0.45	500,000.00	491,115.00
	BTPS 0.65	200,000.00	199,134.00
	BTPS 0.65	300,000.00	281,607.00
	BTPS 0.7	1,500,000.00	1,500,180.00
	BTPS 0.95	600,000.00	578,178.00
	BTPS 1.05	600,000.00	604,416.00
	BTPS 1.2	500,000.00	494,350.00
	BTPS 1.25	500,000.00	456,085.00
	BTPS 1.35	600,000.00	595,650.00
	BTPS 1.45	600,000.00	594,858.00
	BTPS 1.45	300,000.00	286,596.00
	BTPS 1.5	200,000.00	202,110.00
	BTPS 1.5	800,000.00	759,416.00
	BTPS 1.6	600,000.00	565,590.00
	BTPS 1.65	600,000.00	517,968.00
	BTPS 1.85	300,000.00	295,407.00

BTPS 2	200,000.00	194,746.00	
BTPS 2.05	600,000.00	572,448.00	
BTPS 2.15	300,000.00	307,383.00	
BTPS 2.2	300,000.00	290,673.00	
BTPS 2.25	400,000.00	353,604.00	
BTPS 2.45	300,000.00	279,210.00	
BTPS 2.5	600,000.00	609,522.00	
BTPS 2.7	200,000.00	176,560.00	
BTPS 2.8	200,000.00	169,698.00	
BTPS 2.95	400,000.00	379,740.00	
BTPS 3.25	400,000.00	389,276.00	
BTPS 3.45	200,000.00	198,982.00	
BTPS 3.5	800,000.00	842,984.00	
BTPS 3.75	700,000.00	744,730.00	
BTPS 3.75	400,000.00	425,956.00	
BTPS 3.75	800,000.00	854,840.00	
BTPS 3.75	600,000.00	650,412.00	
BTPS 4	700,000.00	742,126.00	
BTPS 4	500,000.00	555,375.00	
BTPS 4.25	700,000.00	736,624.00	
BTPS 4.5	1,100,000.00	1,159,499.00	
BTPS 4.5	600,000.00	668,808.00	
BTPS 4.5	800,000.00	896,784.00	
BTPS 4.5	400,000.00	455,916.00	
BTPS 4.75	300,000.00	329,685.00	
BTPS 4.75	700,000.00	791,091.00	
BTPS 4.75	400,000.00	468,804.00	
BTPS 4.75	300,000.00	363,327.00	
BTPS 5	600,000.00	669,990.00	
BTPS 5	700,000.00	814,086.00	
BTPS 5	600,000.00	739,524.00	
BTPS 5	600,000.00	741,084.00	
BTPS 5	600,000.00	738,402.00	
BTPS 5.25	700,000.00	856,135.00	
BTPS 5.5	900,000.00	1,030,158.00	
BTPS 5.5	600,000.00	687,840.00	
BTPS 5.75	500,000.00	652,140.00	
BTPS 6	700,000.00	917,819.00	
BTPS 6.5	800,000.00	1,045,672.00	
BTPS 7.25	400,000.00	538,360.00	
BTPS 9	300,000.00	401,856.00	
BUNDESÖBL-170 0.25	100,000.00	100,922.00	

BUNDESUBL-171 0	700,000.00	706,545.00
BUNDESUBL-172 0.25	600,000.00	610,002.00
BUNDESUBL-174 0	200,000.00	202,616.00
BUNDESUBL-175 0	500,000.00	506,410.00
DEUTSCHLAND REP 0	600,000.00	589,710.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,300,000.00	1,296,737.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	400,000.00	391,996.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	400,000.00	411,860.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	900,000.00	922,788.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	200,000.00	202,866.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	200,000.00	201,892.00
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	318,195.00
DEUTSCHLAND REP 1	500,000.00	531,345.00
DEUTSCHLAND REP 1.25	100,000.00	103,743.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	700,000.00	750,337.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	646,194.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,200,000.00	1,295,292.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	653,016.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	400,000.00	431,736.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	700,000.00	769,916.00
DEUTSCHLAND REP 2	600,000.00	647,610.00
DEUTSCHLAND REP 2	400,000.00	442,596.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	400,000.00	422,084.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	200,000.00	215,992.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	535,155.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	666,715.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	700,000.00	943,222.00
DEUTSCHLAND REP 3	800,000.00	851,440.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	500,000.00	525,480.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	100,000.00	110,446.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	594,532.00
DEUTSCHLAND REP 4	600,000.00	923,886.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	400,000.00	655,476.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	500,000.00	799,765.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	400,000.00	705,056.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	400,000.00	635,304.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	608,628.60
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	267,418.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	326,964.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	500,000.00	770,525.00
FINNISH GOV'T 0.75	200,000.00	197,510.00
FINNISH GOV'T 0.875	300,000.00	312,078.00
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	321,885.00

FINNISH GOV'T 1.625	300,000.00	321,714.00
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	221,418.00
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	131,118.00
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	120,191.00
FINNISH GOV'T 3.375	200,000.00	212,344.00
FINNISH GOV'T 3.5	500,000.00	550,705.00
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	302,235.00
FRANCE O.A.T. 0	800,000.00	806,616.00
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,009,020.00
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	706,713.00
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	201,548.00
FRANCE O.A.T. 0.25	500,000.00	507,510.00
FRANCE O.A.T. 0.25	700,000.00	686,595.00
FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	911,187.00
FRANCE O.A.T. 0.5	700,000.00	710,521.00
FRANCE O.A.T. 0.5	800,000.00	804,976.00
FRANCE O.A.T. 0.75	900,000.00	903,519.00
FRANCE O.A.T. 0.75	200,000.00	199,608.00
FRANCE O.A.T. 1	700,000.00	732,998.00
FRANCE O.A.T. 1	800,000.00	829,232.00
FRANCE O.A.T. 1.25	200,000.00	202,266.00
FRANCE O.A.T. 1.25	800,000.00	796,672.00
FRANCE O.A.T. 1.5	1,100,000.00	1,168,530.00
FRANCE O.A.T. 1.75	1,100,000.00	1,192,719.00
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	1,096,310.00
FRANCE O.A.T. 1.75	300,000.00	319,587.00
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	193,448.00
FRANCE O.A.T. 2	700,000.00	756,203.00
FRANCE O.A.T. 2.25	900,000.00	988,632.00
FRANCE O.A.T. 2.25	800,000.00	897,008.00
FRANCE O.A.T. 2.5	500,000.00	531,115.00
FRANCE O.A.T. 2.5	900,000.00	1,061,766.00
FRANCE O.A.T. 2.75	1,200,000.00	1,429,836.00
FRANCE O.A.T. 3	1,200,000.00	1,340,064.00
FRANCE O.A.T. 3.25	900,000.00	999,828.00
FRANCE O.A.T. 3.25	600,000.00	822,762.00
FRANCE O.A.T. 3.5	1,100,000.00	1,170,554.00
FRANCE O.A.T. 3.5	400,000.00	494,376.00
FRANCE O.A.T. 3.75	1,400,000.00	1,550,850.00
FRANCE O.A.T. 4	600,000.00	886,656.00
FRANCE O.A.T. 4	200,000.00	321,762.00
FRANCE O.A.T. 4	400,000.00	658,216.00

FRANCE O.A.T. 4.25	1,400,000.00	1,704,248.00
FRANCE O.A.T. 4.5	800,000.00	1,278,656.00
FRANCE O.A.T. 4.75	900,000.00	1,391,985.00
FRANCE O.A.T. 5.5	400,000.00	593,960.00
FRANCE O.A.T. 5.75	600,000.00	974,760.00
FRANCE O.A.T. 6	900,000.00	1,261,719.00
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	219,996.00
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	279,146.00
IRISH GOVT 0.8	300,000.00	309,768.00
IRISH GOVT 1	200,000.00	205,392.00
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	102,066.00
IRISH GOVT 2	300,000.00	315,273.00
IRISH GOVT 2.4	200,000.00	227,568.00
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	234,576.00
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	234,934.00
IRISH GOVT 4.5	500,000.00	539,310.00
IRISH GOVT 5	600,000.00	668,028.00
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	395,070.00
IRISH GOVT 5.9	200,000.00	213,950.00
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	303,276.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	404,580.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	401,832.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	304,464.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	300,000.00	307,860.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	100,000.00	101,868.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	500,000.00	544,990.00
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	445,424.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	500,000.00	548,790.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	200,000.00	245,832.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	700,845.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	400,000.00	441,960.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	700,000.00	752,052.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	351,759.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	472,431.00
NETHERLANDS GOVT 4	400,000.00	610,300.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	585,484.00
REP OF AUSTRIA 0.25	200,000.00	201,652.00
REP OF AUSTRIA 0.5	100,000.00	99,602.00
REP OF AUSTRIA 0.75	500,000.00	511,440.00
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	202,012.00
REP OF AUSTRIA 1.2	100,000.00	106,260.00
REP OF AUSTRIA 1.5	300,000.00	305,019.00
REP OF AUSTRIA 1.65	300,000.00	327,525.00

REP OF AUSTRIA 1.75	500,000.00	544,490.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	200,000.00	238,792.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	200,000.00	280,210.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	229,874.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	223,136.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	400,000.00	456,060.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	171,032.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	300,000.00	324,000.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	300,000.00	451,002.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	400,000.00	534,260.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	200,000.00	299,084.00	
SPANISH GOV'T 0.05	700,000.00	701,463.00	
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	302,580.00	
SPANISH GOV'T 0.45	700,000.00	704,669.00	
SPANISH GOV'T 0.75	500,000.00	510,800.00	
SPANISH GOV'T 1.15	700,000.00	717,773.00	
SPANISH GOV'T 1.3	600,000.00	605,298.00	
SPANISH GOV'T 1.4	700,000.00	716,597.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	605,124.00	
SPANISH GOV'T 1.5	500,000.00	508,560.00	
SPANISH GOV'T 1.6	100,000.00	104,782.00	
SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	637,254.00	
SPANISH GOV'T 2.15	500,000.00	539,695.00	
SPANISH GOV'T 2.35	400,000.00	419,344.00	
SPANISH GOV'T 2.7	300,000.00	306,309.00	
SPANISH GOV'T 2.75	800,000.00	895,488.00	
SPANISH GOV'T 2.9	700,000.00	751,751.00	
SPANISH GOV'T 3.45	100,000.00	114,855.00	
SPANISH GOV'T 3.8	200,000.00	234,300.00	
SPANISH GOV'T 4	700,000.00	748,237.00	
SPANISH GOV'T 4.2	470,000.00	620,536.30	
SPANISH GOV'T 4.3	300,000.00	315,762.00	
SPANISH GOV'T 4.4	700,000.00	835,457.00	
SPANISH GOV'T 4.65	500,000.00	623,955.00	
SPANISH GOV'T 4.7	700,000.00	993,783.00	
SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	610,300.00	
SPANISH GOV'T 4.85	200,000.00	221,056.00	
SPANISH GOV'T 4.9	400,000.00	580,164.00	
SPANISH GOV'T 5.15	400,000.00	537,456.00	
SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	303,648.00	
SPANISH GOV'T 5.4	200,000.00	243,820.00	
SPANISH GOV'T 5.5	700,000.00	801,038.00	

	SPANISH GOV'T 5.75	700,000.00	1,039,178.00
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	715,914.00
	SPANISH GOV'T 5.9	700,000.00	950,355.00
	SPANISH GOV'T 6	700,000.00	1,003,184.00
	ユーロ 小計	123,080,000.00	140,307,532.90 (18,311,536,118)
英債券	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	490,465.00
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	196,408.00
	UK TSY GILT 1.25	300,000.00	295,371.00
	UK TSY GILT 1.5	800,000.00	811,984.00
	UK TSY GILT 1.5	500,000.00	506,015.00
	UK TSY GILT 1.5	550,000.00	504,240.00
	UK TSY GILT 1.625	200,000.00	201,710.00
	UK TSY GILT 1.75	700,000.00	719,894.00
	UK TSY GILT 1.75	200,000.00	196,930.00
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	297,117.00
	UK TSY GILT 2	900,000.00	919,530.00
	UK TSY GILT 2	600,000.00	629,886.00
	UK TSY GILT 2.25	500,000.00	527,225.00
	UK TSY GILT 2.5	500,000.00	620,615.00
	UK TSY GILT 2.75	400,000.00	435,584.00
	UK TSY GILT 3.25	800,000.00	1,015,928.00
	UK TSY GILT 3.5	800,000.00	1,063,704.00
	UK TSY GILT 3.5	400,000.00	632,444.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	528,735.00
	UK TSY GILT 3.75	300,000.00	325,020.00
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	741,685.00
	UK TSY GILT 4	500,000.00	552,120.00
	UK TSY GILT 4	400,000.00	662,052.00
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	374,100.00
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	526,100.00
	UK TSY GILT 4.25	450,000.00	615,568.50
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	566,000.00
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	573,124.00
	UK TSY GILT 4.25	500,000.00	757,790.00
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	469,473.00
	UK TSY GILT 4.25	200,000.00	332,528.00
	UK TSY GILT 4.5	500,000.00	691,135.00
	UK TSY GILT 4.5	300,000.00	452,877.00
	UK TSY GILT 4.75	200,000.00	211,526.00
	UK TSY GILT 4.75	300,000.00	404,706.00
	UK TSY GILT 4.75	400,000.00	596,904.00
	UK TSY GILT 5	450,000.00	555,426.00

	UK TSY GILT 6	200,000.00	285,650.00	
	UK TSY GILT 8	300,000.00	357,477.00	
英債券 小計		16,950,000.00	20,645,046.50 (3,034,821,835)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	1,100,000.00	1,113,860.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	2,000,000.00	2,090,080.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	2,500,000.00	2,682,500.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,000,000.00	1,147,060.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	2,300,000.00	2,610,799.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,100,000.00	1,527,284.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	2,500,000.00	2,801,250.00	
スウェーデンクローナ 小計		12,500,000.00	13,972,833.00 (175,079,597)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,468,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,001,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	1,900,000.00	1,941,800.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	1,400,000.00	1,500,520.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	1,700,000.00	1,811,690.00	
ノルウェークローネ 小計		7,500,000.00	7,723,510.00 (105,580,381)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	1,100,000.00	1,110,890.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	800,000.00	865,680.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	1,800,000.00	2,005,560.00	
	DENMARK - BULLET 3	1,900,000.00	2,104,440.00	
	DENMARK - BULLET 4	2,700,000.00	2,845,260.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	3,200,000.00	5,450,240.00	
	DENMARK - BULLET 7	820,000.00	1,172,108.00	
デンマーククローネ 小計		12,320,000.00	15,554,178.00 (272,042,573)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	800,000.00	798,560.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	1,000,000.00	996,400.00	
	POLAND GOVT BOND 2	1,400,000.00	1,407,420.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	957,200.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,200,000.00	1,138,680.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	500,000.00	506,500.00	
	POLAND GOVT BOND 4	500,000.00	532,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	400,000.00	417,280.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,100,000.00	1,226,940.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	900,000.00	1,017,810.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	300,000.00	366,900.00	
ポーランドズロチ 小計		9,100,000.00	9,365,690.00 (284,342,348)	

オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1,200,000.00	1,192,380.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	400,000.00	399,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	386,680.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	818,782.40
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	808,160.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	505,763.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	391,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	195,860.20
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	800,000.00	840,080.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	900,000.00	950,490.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	206,560.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	334,509.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	1,000,000.00	1,120,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	300,000.00	311,587.08
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	400,000.00	481,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	500,000.00	584,150.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	600,000.00	686,340.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	800,000.00	876,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	700,000.00	793,310.00
オーストラリアドル 小計		11,200,000.00	11,882,051.68 (951,752,339)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	400,000.00	390,720.00
	SINGAPORE GOV'T 2	600,000.00	600,987.42
	SINGAPORE GOV'T 2.125	400,000.00	392,200.00
	SINGAPORE GOV'T 2.25	300,000.00	301,800.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	307,140.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	197,200.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	197,054.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	200,000.00	206,100.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	300,000.00	307,350.00
	SINGAPORE GOV'T 3	600,000.00	623,100.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	200,000.00	208,000.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	300,000.00	307,509.00
	SINGAPORE GOV'T 3.375	200,000.00	215,049.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	600,000.00	648,900.00
	シンガポールドル 小計		4,800,000.00
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	20,000,000.00	13,616,000.00
	REP SOUTH AFRICA 7	14,000,000.00	11,267,200.00
	REP SOUTH AFRICA 7.75	5,000,000.00	4,848,500.00
	REP SOUTH AFRICA 8	2,000,000.00	1,999,140.00
南アフリカランド 小計		41,000,000.00	31,730,840.00 (237,029,374)

合計		45,346,270,292	
		(45,346,270,292)	

(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 202銘柄	44.4%	44.7%
カナダドル	国債証券 23銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 12銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 254銘柄	40.2%	40.4%
英ポンド	国債証券 39銘柄	6.7%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 19銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	0.9%	0.9%
南アフリカランド	国債証券 4銘柄	0.5%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

(純資産計算書)

区分	2017年10月31日現在	
	金額(千米ドル)	
債券	11,695,996	
短期金融資産	37,553	
投資総額	11,733,549	
その他資産及び負債	194,660	
純資産額	11,928,209	

(1口当たり情報)

(2017年10月31日現在)	
1口当たり純資産額	
(一般投資家クラス) 115.92米ドル	

【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2期中間計算期間(平成30年 9月19日から平成31年 3月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	140,573
金銭信託	9,192,045
コール・ローン	1,642,458
投資信託受益証券	7,409,510
親投資信託受益証券	757,315,990
流動資産合計	775,700,576
資産合計	775,700,576
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,007,886
未払受託者報酬	73,569
未払委託者報酬	2,084,430
未払利息	4
その他未払費用	14,706
流動負債合計	3,180,595
負債合計	3,180,595
純資産の部	
元本等	
元本	772,944,382
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	424,401
元本等合計	772,519,981
純資産合計	772,519,981
負債純資産合計	775,700,576

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
営業収益	
受取配当金	131,496
受取利息	121
有価証券売買等損益	14,298,655
為替差損益	5,830
営業収益合計	14,424,442
営業費用	
支払利息	1,792
受託者報酬	73,569
委託者報酬	2,084,430
その他費用	36,910
営業費用合計	2,196,701
営業利益又は営業損失（ ）	12,227,741
経常利益又は経常損失（ ）	12,227,741
中間純利益又は中間純損失（ ）	12,227,741
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（ ）	107,135
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,083,350
剰余金増加額又は欠損金減少額	884,288
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	884,288
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,560,215
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	11,560,215
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	424,401

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	自 平成30年 9月19日	至 平成31年 3月18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	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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		772,944,382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	424,401円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9995円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,995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2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
1.中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項 目	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
期首元本額	190,446,384円
期中追加設定元本額	633,469,955円
期中一部解約元本額	50,971,957円

【三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	152,557
金銭信託	4,855,865
コール・ローン	867,658
投資信託受益証券	7,239,176
親投資信託受益証券	360,433,994
流動資産合計	373,549,250
資産合計	373,549,250
負債の部	
流動負債	
未払解約金	999,001
未払受託者報酬	36,662
未払委託者報酬	1,038,772
未払利息	2
その他未払費用	7,301
流動負債合計	2,081,738
負債合計	2,081,738
純資産の部	
元本等	
元本	369,883,405
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	1,584,107
元本等合計	371,467,512
純資産合計	371,467,512
負債純資産合計	373,549,250

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
営業収益	
受取配当金	131,091
受取利息	148
有価証券売買等損益	7,112,807
為替差損益	10,983
営業収益合計	7,255,029
営業費用	
支払利息	742
受託者報酬	36,662
委託者報酬	1,038,772
その他費用	31,912
営業費用合計	1,108,088
営業利益又は営業損失（ ）	6,146,941
経常利益又は経常損失（ ）	6,146,941
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,146,941
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（ ）	57,887
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	220,859
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,245
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	98,245
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,824,051
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	4,824,051
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,584,107

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	自 平成30年 9月19日	至 平成31年 3月18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	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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		369,883,405口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0043円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,043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2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
期首元本額	95,204,855円
期中追加設定元本額	282,765,982円
期中一部解約元本額	8,087,432円

【三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	498,020
金銭信託	10,046,167
コール・ローン	1,795,074
投資信託受益証券	25,793,368
親投資信託受益証券	847,240,943
流動資産合計	885,373,572
資産合計	885,373,572
負債の部	
流動負債	
未払解約金	300,622
未払受託者報酬	89,041
未払委託者報酬	2,522,700
未払利息	5
その他未払費用	17,803
流動負債合計	2,930,171
負債合計	2,930,171
純資産の部	
元本等	
元本	863,534,702
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	18,908,699
元本等合計	882,443,401
純資産合計	882,443,401
負債純資産合計	885,373,572

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
営業収益	
受取配当金	479,764
受取利息	511
有価証券売買等損益	16,321,993
為替差損益	20,549
営業収益合計	16,822,817
営業費用	
支払利息	1,934
受託者報酬	89,041
委託者報酬	2,522,700
その他費用	57,412
営業費用合計	2,671,087
営業利益又は営業損失（ ）	14,151,730
経常利益又は経常損失（ ）	14,151,730
中間純利益又は中間純損失（ ）	14,151,730
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（ ）	695,184
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,584,878
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,523,093
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	501,842
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,021,251
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	18,908,699

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	自 平成30年 9月19日	至 平成31年 3月18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	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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期中間計算期間	
	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		863,534,702口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0219円
	(10,000口当たりの純資産額	10,219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2期中間計算期間 （平成31年 3月18日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第2期中間計算期間 （平成31年 3月18日現在）
期首元本額	286,534,708円
期中追加設定元本額	609,842,356円
期中一部解約元本額	32,842,362円

【三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	7,617
金銭信託	6,420,077
コール・ローン	1,147,155
投資信託受益証券	16,802,189
親投資信託受益証券	406,141,437
派生商品評価勘定	116
流動資産合計	430,518,591
資産合計	430,518,591
負債の部	
流動負債	
未払金	413,515
未払解約金	1,481,609
未払受託者報酬	49,694
未払委託者報酬	1,407,963
未払利息	3
その他未払費用	9,911
流動負債合計	3,362,695
負債合計	3,362,695
純資産の部	
元本等	
元本	415,705,079
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	11,450,817
元本等合計	427,155,896
純資産合計	427,155,896
負債純資産合計	430,518,591

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
営業収益	
受取配当金	361,717
受取利息	519
有価証券売買等損益	5,380,348
為替差損益	17,098
営業収益合計	5,725,486
営業費用	
支払利息	1,015
受託者報酬	49,694
委託者報酬	1,407,963
その他費用	41,814
営業費用合計	1,500,486
営業利益又は営業損失（ ）	4,225,000
経常利益又は経常損失（ ）	4,225,000
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,225,000
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（ ）	680,036
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,993,915
剰余金増加額又は欠損金減少額	514,103
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	514,103
剰余金減少額又は欠損金増加額	962,237
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	962,237
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（ ）	11,450,817

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 平成30年 9月19日	至 平成31年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		415,705,079口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0275円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,275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2期中間計算期間 (平成31年 3月18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せん。
2. 時価の算定方法	(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。 (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2期中間計算期間（平成31年 3月18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	413,362	-	413,478	116
	米ドル	413,362	-	413,478	116
合計		413,362	-	413,478	116

（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2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
期首元本額	191,465,549円
期中追加設定元本額	258,852,229円
期中一部解約元本額	34,612,699円

【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,358
金銭信託	7,484,698
コール・ローン	1,337,385
投資信託受益証券	30,720,875
親投資信託受益証券	596,617,841
流動資産合計	636,164,157
資産合計	
636,164,157	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	189,205
未払受託者報酬	85,322
未払委託者報酬	2,417,418
未払利息	3
その他未払費用	17,061
流動負債合計	2,709,009
負債合計	
2,709,009	
純資産の部	
元本等	
元本	615,145,622
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	18,309,526
元本等合計	633,455,148
純資産合計	
633,455,148	
負債純資産合計	636,164,157

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
営業収益	
受取配当金	790,477
受取利息	1,073
有価証券売買等損益	1,613,535
為替差損益	24,185
営業収益合計	2,380,900
営業費用	
支払利息	1,781
受託者報酬	85,322
委託者報酬	2,417,418
その他費用	55,477
営業費用合計	2,559,998
営業利益又は営業損失（ ）	179,098
経常利益又は経常損失（ ）	179,098
中間純利益又は中間純損失（ ）	179,098
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（ ）	728,429
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	20,247,190
剰余金増加額又は欠損金減少額	946,821
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	946,821
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,433,816
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,433,816
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（ ）	18,309,526

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 平成30年 9月19日	至 平成31年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		615,145,622口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0298円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,298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2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第2期中間計算期間 (平成31年 3月18日現在)
期首元本額	455,009,598円
期中追加設定元本額	249,786,125円
期中一部解約元本額	89,650,101円

（参考）

「三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）」「三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）」「三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）」「三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）」および「三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）」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」、「エマーシ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」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマーシング・マーケット債券ETF」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」

および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

（単位：円）	
（平成31年 3月18日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,841,534,371
コール・ローン	507,732,437
株式	170,221,756,580
派生商品評価勘定	48,995,440
未収配当金	284,219,416
差入委託証拠金	27,320,000
流動資産合計	<u>173,931,558,244</u>
資産合計	<u>173,931,558,244</u>
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,044,400
前受金	45,045,000
未払金	276,480
未払解約金	258,680,722
未払利息	1,460
その他未払費用	15,846
流動負債合計	<u>308,063,908</u>
負債合計	<u>308,063,908</u>
純資産の部	
元本等	
元本	69,011,819,160
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	<u>104,611,675,176</u>
元本等合計	<u>173,623,494,336</u>
純資産合計	<u>173,623,494,336</u>
負債純資産合計	<u>173,931,558,244</u>

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 3月18日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: center;">株式</p> <p style="text-align: right;">2,660,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,011,819,160口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額</p> <p style="text-align: right;">2.5159円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額</p> <p style="text-align: right;">25,159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	(平成31年 3月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成31年 3月18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	3,292,778,960	-	3,337,730,000	44,951,040
	東証株価指数先物	3,292,778,960	-	3,337,730,000	44,951,040
合計		3,292,778,960	-	3,337,730,000	44,951,040

（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）

（平成31年 3月18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	66,849,199,400円
同期中における追加設定元本額	7,920,176,854円
同期中における一部解約元本額	5,757,557,094円
平成31年 3月18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	10,333,943,079円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	823,199,196円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,915,522,043円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,836,454,288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)	145,223,671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)	7,875,609円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	26,412,283円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	65,267,705円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	96,478,415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)	56,732,119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)	140,993,471円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,910,739,691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	8,818,029,344円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	823,934,367円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	809,833,198円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	771,892,477円
イオン・バランス戦略ファンド	45,381,856円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,540,435円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	18,570,739円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	20,503,819円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	73,298,270円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	43,840,415円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,167,493円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	7,884,526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)	5,607,218,087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 >	26,647,458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 >	268,631,972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 >	3,509,776,755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 >	2,507,018,556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 >	9,300,548,392円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	60,378,794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 >	226,593,592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 >	943,132,681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 >	384,921,677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 >	1,135,590,552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 >	968,752,439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 >	3,165,819,667円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,573,523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)	1,030,488,503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 >	65,794,715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 >	62,268,585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)	1,431,677,650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 >	22,983,689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 >	215,349,789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 >	397,647,488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 >	167,781,326円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	121,835,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	62,251,723円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,649,172円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	79,073,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	960,454,367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）	204,448,469円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,958,549円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	1,695,989,501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>	231,506,290円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	133,073,322円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	9,875,960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>	96,026,737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>	45,962,823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>	113,206,357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>	58,045,675円
合計	69,011,819,160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）

（平成31年 3月18日現在）

資産の部

流動資産

預金	2,130,013,208
金銭信託	327,494,047
コール・ローン	58,517,452
株式	174,818,180,738
投資証券	4,400,951,330
派生商品評価勘定	90,497,491
未収入金	37,172,170
未収配当金	409,280,870
差入委託証拠金	1,584,168,014
流動資産合計	183,856,275,320

資産合計

183,856,275,320

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	1,176,525
前受金	88,918,776
未払金	42,351,262
未払解約金	443,143,088
未払利息	168
その他未払費用	948
流動負債合計	575,590,767

負債合計

575,590,767

純資産の部

元本等

元本	51,316,586,210
剰余金	

(平成31年 3月18日現在)

剰余金又は欠損金（ ）	131,964,098,343
元本等合計	183,280,684,553
純資産合計	183,280,684,553
負債純資産合計	183,856,275,320

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	51,316,586,210口

項目	(平成31年 3月18日現在)	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3,5716円
	(10,000口当たりの純資産額)	35,716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	(平成31年 3月18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	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成31年 3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,660,867,180	-	3,749,785,956	88,918,776
	SPMINI 1906	2,598,625,673	-	2,668,079,759	69,454,086
	DJ EUR 1906	638,399,806	-	654,860,564	16,460,758
	FTSE 1906	240,160,608	-	243,844,628	3,684,020
	SPI200 1903	183,681,093	-	183,001,005	680,088
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	453,263,390	-	452,861,200	402,190
	米ドル	301,600,000	-	301,225,000	375,000
	カナダドル	17,556,000	-	17,562,300	6,300
	ユーロ	50,516,000	-	50,528,000	12,000
	英ポンド	25,202,500	-	25,211,000	8,500
	スイスフラン	12,241,900	-	12,245,200	3,300
	スウェーデンクローナ	3,985,080	-	3,983,100	1,980

ノルウェークローネ	914,830	-	914,200	630
デンマーククローネ	2,707,680	-	2,708,800	1,120
オーストラリアドル	23,757,000	-	23,721,000	36,000
香港ドル	11,379,500	-	11,360,000	19,500
シンガポールドル	2,472,600	-	2,472,900	300
イスラエルシケル	930,300	-	929,700	600
合計	4,114,130,570	-	4,202,647,156	89,320,966

(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)

(平成31年 3月18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	52,677,733,208円
同期中における追加設定元本額	6,303,057,586円
同期中における一部解約元本額	7,664,204,584円
平成31年 3月18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	14,424,288,335円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	292,536,747円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,212,174,929円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	810,550,202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)	42,440,999円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,801,776円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	8,692,511円

(平成31年 3月18日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	23,728,153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)	43,791,570円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	29,449,637円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	74,849,049円
外国株式指数ファンド	524,982,511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	3,144,481,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	393,409,210円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	404,446,029円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	405,508,744円
イオン・バランス戦略ファンド	13,182,809円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,658,488円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	13,215,358円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	14,671,222円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	51,774,774円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	30,981,413円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	54,736,093円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	11,260,882円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,877,720,831円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	9,379,099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〉	90,816,207円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,658,229,462円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,569,174,842円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	6,648,070,957円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	21,758,026円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	109,228,489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〉	775,166,836円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	61,481,215円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	184,465,889円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	812,818,548円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	691,176,263円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,688,805,369円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,160,682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)	504,033,057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)	727,052,865円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	144,777,097円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	44,001,456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)	1,014,823,793円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	25,082,064円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	14,526,973円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	7,111,626円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	52,066,697円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	124,138,256円

（平成31年 3月18日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	119,958,521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>	1,204,323,887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>	165,644,297円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,385,115,375円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	304,867,679円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,971,103,168円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	7,312,415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>	84,309,234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>	40,358,181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>	99,542,000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>	42,948,292円
合計	51,316,586,210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）

（平成31年 3月18日現在）

資産の部

流動資産

預金	144,983,052
金銭信託	469,250,286
コール・ローン	83,846,810
株式	2,928,333,495
投資信託受益証券	196,448,403
投資証券	16,270,842
派生商品評価勘定	116,028,209
現先取引勘定	2,000,800,000
未収配当金	5,406,842
差入委託証拠金	717,872,158
流動資産合計	6,679,240,097

資産合計

6,679,240,097

負債の部

流動負債

前受金	108,753,120
未払金	989
未払解約金	16,440,000
未払利息	241
その他未払費用	2,868
流動負債合計	125,197,218

負債合計

125,197,218

純資産の部

元本等

元本	4,818,194,069
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,735,848,810

元本等合計	6,554,042,879
-------	---------------

純資産合計

6,554,042,879

（平成31年 3月18日現在）

負債純資産合計

6,679,240,097

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18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	（平成31年 3月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		4,818,194,069口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3603円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,603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	(平成31年 3月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成31年 3月18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	3,299,667,192	-	3,408,420,312	108,753,120
	MSCIE 1906	3,299,667,192	-	3,408,420,312	108,753,120
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,550,335,998	-	2,557,611,025	7,275,027
	米ドル	2,550,335,998	-	2,557,611,025	7,275,027
	売建	35,998	-	35,936	62
	メキシコペソ	35,998	-	35,936	62
	合計	5,850,039,188	-	5,966,067,273	116,028,209

（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)

(平成31年 3月18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	3,133,325,803円
同期中における追加設定元本額	1,966,568,883円
同期中における一部解約元本額	281,700,617円
平成31年 3月18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	1,160,344,896円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,331,880,638円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	668,461,692円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	712,335,996円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	708,420,051円
イオン・バランス戦略ファンド	27,262,037円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,424,636円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	11,400,706円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,948,693円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	38,648,544円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	31,233,869円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	78,731,570円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,670,444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>	19,430,297円
合計	4,818,194,069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)

(平成31年 3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	145,484,762
コール・ローン	25,995,579
投資証券	10,836,669,600
未収配当金	114,142,396
流動資産合計	11,122,292,337
資産合計	11,122,292,337
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,000,000
未払利息	74
その他未払費用	330
流動負債合計	20,000,404
負債合計	20,000,404
純資産の部	
元本等	
元本	4,973,019,050
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,129,272,883
元本等合計	11,102,291,933
純資産合計	11,102,291,933
負債純資産合計	11,122,292,337

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至平成31年 3月18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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成31年 3月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		4,973,019,050口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2,2325円
	(10,000口当たりの純資産額)	22,325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	（平成31年 3月18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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成31年 3月18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	5,029,327,804円
同期中における追加設定元本額	2,101,965,544円
同期中における一部解約元本額	2,158,274,298円
平成31年 3月18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）	392,095,508円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	602,940,886円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	557,671,592円

(平成31年 3月18日現在)	
イオン・バランス戦略ファンド	52,287,394円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	577,259,023円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,188,322円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	6,857,788円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,917,449円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	15,562,020円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,361,696円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,440,690円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,309,921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)	1,190,551,089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)	827,079,343円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	28,836,098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>	24,672,873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>	249,550,041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>	119,559,694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>	294,428,427円
合計	4,973,019,050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)

(平成31年 3月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	53,981,422
金銭信託	3,698,039
コール・ローン	660,775
投資証券	4,892,704,452
派生商品評価勘定	16,302
未収入金	34,182,538
未収配当金	10,820,455
流動資産合計	4,996,063,983

資産合計

4,996,063,983

負債の部

流動負債

未払金	90,600,057
未払解約金	2,253,032
未払利息	1
その他未払費用	99
流動負債合計	92,853,189

負債合計

92,853,189

純資産の部

元本等

元本

2,263,920,188

(平成31年 3月18日現在)

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,639,290,606
元本等合計	4,903,210,794
純資産合計	4,903,210,794
負債純資産合計	4,996,063,983

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至平成31年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,263,920,188口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1658円
	(10,000口当たりの純資産額 21,658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	（平成31年 3月18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）

（平成31年 3月18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	85,450,000	-	85,466,302	16,302
	米ドル	74,000,000	-	74,014,129	14,129
	カナダドル	1,000,000	-	1,000,358	358
	ユーロ	2,600,000	-	2,600,618	618
	英ポンド	1,000,000	-	1,000,336	336
	オーストラリアドル	5,850,000	-	5,850,740	740
	シンガポールドル	1,000,000	-	1,000,121	121
合計		85,450,000	-	85,466,302	16,302

（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)

(平成31年 3月18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	2,888,731,950円
同期中における追加設定元本額	603,493,724円
同期中における一部解約元本額	1,228,305,486円
平成31年 3月18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)	1,950,412円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	3,428,057円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	8,380,238円
イオン・バランス戦略ファンド	4,086,177円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	1,289,267,142円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,309,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	10,782,424円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	6,795,266円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	20,117,526円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	11,699,554円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,698,999円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	13,737,164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)	859,501,630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>	3,841,655円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	13,864,371円
合計	2,263,920,188円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成31年 3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	596,471,018
コール・ローン	106,578,927
国債証券	136,811,079,290
地方債証券	14,719,509,505
特殊債券	22,219,360,347

(平成31年 3月18日現在)

社債券	7,695,085,000
未収利息	625,794,862
前払費用	17,826,111
流動資産合計	182,791,705,060
資産合計	182,791,705,060
負債の部	
流動負債	
未払解約金	566,290,636
未払利息	306
その他未払費用	5,715
流動負債合計	566,296,657
負債合計	566,296,657
純資産の部	
元本等	
元本	142,383,107,779
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,842,300,624
元本等合計	182,225,408,403
純資産合計	182,225,408,403
負債純資産合計	182,791,705,060

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年 9月19日 至平成31年 3月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	142,383,107,779口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2798円

項目	(平成31年 3月18日現在)
	(10,000口当たりの純資産額 12,798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	(平成31年 3月18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)

(平成31年 3月18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	156,243,981,253円
同期中における追加設定元本額	11,901,477,590円
同期中における一部解約元本額	25,762,351,064円
平成31年 3月18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)	4,431,244,037円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	7,723,754,314円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,671,717,441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)	497,623,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	55,308,074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)	166,202,317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)	282,599,219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)	246,144,268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)	96,387,868円

(平成31年 3月18日現在)

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	202,554,882円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	87,726,396円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,752,992,336円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,617,624,062円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	845,968,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,848,563円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	29,471,808円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	11,262,944円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,693,703円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,210,649円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,671,322円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,136,719円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,794,130,861円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	18,496,276,091円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,314,559,645円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,857,476,316円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	349,856,151円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	586,552,080円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,742,513円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	252,488,538円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	112,648,590円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,028,499,975円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,167,297,178円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,827,653,411円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,808,811,394円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,063,620円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,315,887,560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)	12,097,306,245円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	520,836,297円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	486,758,339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)	12,615,290,220円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	927,922,952円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	187,670,363円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,513,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,006,588,161円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,523,671,562円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,418,895,975円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,044,549,639円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	244,033,609円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,543,248円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	358,205,168円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,326,614,945円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	301,457,933円

(平成31年 3月18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>	167,793,523円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,522,407,413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>	729,581,965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>	1,796,257,001円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,360,122,395円
合計	142,383,107,779円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成31年 3月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	303,634,573
金銭信託	18,224,103
コール・ローン	3,256,328
国債証券	164,246,633,491
派生商品評価勘定	326
未収入金	710,130,420
未収利息	1,244,439,835
前払費用	35,412,576
流動資産合計	166,561,731,652

資産合計

166,561,731,652

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	1,524,026
未払解約金	358,147,000
未払利息	9
その他未払費用	1,080
流動負債合計	359,672,115

負債合計

359,672,115

純資産の部

元本等

元本	93,968,333,031
剰余金	
剰余金又は欠損金()	72,233,726,506
元本等合計	166,202,059,537

純資産合計

166,202,059,537

負債純資産合計

166,561,731,652

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	93,968,333,031口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7687円
	(10,000口当たりの純資産額 17,687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	(平成31年 3月18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	(平成31年 3月18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)

(平成31年 3月18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	662,618	-	661,737	881
	米ドル	390,781	-	390,418	363
	英ポンド	271,837	-	271,319	518
	売建	714,746,116	-	716,268,935	1,522,819
	米ドル	336,823,990	-	337,565,745	741,755
	カナダドル	16,742,088	-	16,741,939	149
	ユーロ	282,270,244	-	282,756,006	485,762
	英ポンド	53,466,773	-	53,661,761	194,988
	オーストラリアドル	25,443,021	-	25,543,484	100,463
合計		715,408,734	-	716,930,672	1,523,700

(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）

（平成31年 3月18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	100,496,412,078円
同期中における追加設定元本額	4,311,082,988円
同期中における一部解約元本額	10,839,162,035円
平成31年 3月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	10,900,714,310円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	587,938,520円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,613,357,625円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	813,052,090円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	128,395,445円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	9,428,957円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	33,553,817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）	87,993,255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）	103,281,369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）	54,119,313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）	127,959,716円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	17,062,581円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	403,771,699円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	396,177,063円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	357,460,927円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,514,354円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	47,339,542円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	33,220,503円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	68,914,587円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	26,160,724円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	13,819,922円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	22,427,277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＞	1,784,821,590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＞	96,071,119円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	11,768,530,654円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	5,832,068,681円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	13,142,128,390円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	42,432,859円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	106,870,983円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	558,437円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	762,181,383円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,301,862,418円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,585,915,151円

(平成31年 3月18日現在)	
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,070,136,538円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,770,749,662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>	11,275,869,753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)	632,995,573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)	1,450,857,259円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	190,617,998円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	354,176,221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)	2,024,452,580円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	154,601,447円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,886,445円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	152,401,822円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	565,241,602円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	179,680,865円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	175,400,758円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	53,384,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,686,052円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,382,294,388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>	3,897,703,188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>	1,710,666,027円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,196,835,258円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	704,570,800円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	23,693,613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>	32,712,094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>	408,003,839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>	195,415,657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>	481,504,514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>	402,716,026円
合計	93,968,333,031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)

(平成31年 3月18日現在)

資産の部

流動資産

預金

233,408,476

（平成31年 3月18日現在）

金銭信託	51,365,238
コール・ローン	9,178,069
国債証券	35,150,342,646
派生商品評価勘定	94,322,893
未収入金	399,598,496
未収利息	256,171,717
前払費用	12,430,160
流動資産合計	36,206,817,695
資産合計	36,206,817,695
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,744,546
未払金	1,530,580
未払解約金	137,113,000
未払利息	26
その他未払費用	951
流動負債合計	144,389,103
負債合計	144,389,103
純資産の部	
元本等	
元本	25,794,041,172
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,268,387,420
元本等合計	36,062,428,592
純資産合計	36,062,428,592
負債純資産合計	36,206,817,695

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18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>
	外貨建資産等の会計処理

項目	自 平成30年 9月19日 至 平成31年 3月18日
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「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	(平成31年 3月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		25,794,041,172口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3981円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,981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	(平成31年 3月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成31年 3月18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	2,374	-	2,371	3
	オーストラリアドル	2,374	-	2,371	3
	売建	35,717,335,985	-	35,628,757,635	88,578,350
	米ドル	16,461,353,623	-	16,461,169,003	184,620
	カナダドル	719,659,809	-	710,007,144	9,652,665

メキシコペソ	289,082,449	-	290,231,000	1,148,551
ユーロ	13,881,625,880	-	13,806,369,200	75,256,680
英ポンド	2,448,234,343	-	2,452,418,405	4,184,062
スウェーデンクローナ	134,992,364	-	134,819,962	172,402
ノルウェークローネ	88,644,800	-	88,740,000	95,200
デンマーククローネ	187,301,400	-	186,230,000	1,071,400
ポーランドズロチ	229,885,422	-	228,696,000	1,189,422
オーストラリアドル	751,737,829	-	750,934,514	803,315
シンガポールドル	313,289,181	-	312,895,844	393,337
南アフリカランド	211,528,885	-	206,246,563	5,282,322
合計	35,717,338,359	-	35,628,760,006	88,578,347

(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)

(平成31年 3月18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	33,296,978,321円
同期中における追加設定元本額	2,200,141,560円
同期中における一部解約元本額	9,703,078,709円
平成31年 3月18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)	6,426,423,130円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,578,741,400円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,152,255,142円
イオン・バランス戦略ファンド	654,454,584円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	348,884,534円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	104,977,673円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	154,902,263円

(平成31年 3月18日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,962,128円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,640,354円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,020,362円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,323,704,828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)	3,830,378,816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>	3,259,512,464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>	82,242,217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>	686,777,670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>	329,048,911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>	810,298,056円
合計	25,794,041,172円

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

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は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

(純資産計算書)

区分	2018年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	14,469,132
短期金融資産	62,171
投資総額	14,531,303
その他資産及び負債	213,427
純資産額	14,744,730

(1口当たり情報)

(2018年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 104.57米ドル

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

2019年 3月29日現在

資産総額	812,766,867円
負債総額	4,445,912円
純資産総額（ - ）	808,320,955円
発行済口数	803,310,453口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0062円
（1万口当たり純資産額）	（10,062円）

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

2019年 3月29日現在

資産総額	391,853,429円
負債総額	5,863,897円
純資産総額（ - ）	385,989,532円
発行済口数	383,148,705口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0074円
（1万口当たり純資産額）	（10,074円）

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

2019年 3月29日現在

資産総額	910,438,075円
負債総額	4,199,850円
純資産総額（ - ）	906,238,225円
発行済口数	886,809,198口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0219円
（1万口当たり純資産額）	（10,219円）

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

2019年 3月29日現在

資産総額	436,583,777円
負債総額	1,386,978円

純資産総額（ - ）	435,196,799円
発行済口数	424,694,012口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0247円
（1万口当たり純資産額）	（10,247円）

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

2019年 3月29日現在

資産総額	634,143,212円
負債総額	2,167,874円
純資産総額（ - ）	631,975,338円
発行済口数	617,447,387口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0235円
（1万口当たり純資産額）	（10,235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、
- 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、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、
- 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】

（2019年4月1日現在）

イ 資本金の額および株式数

資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

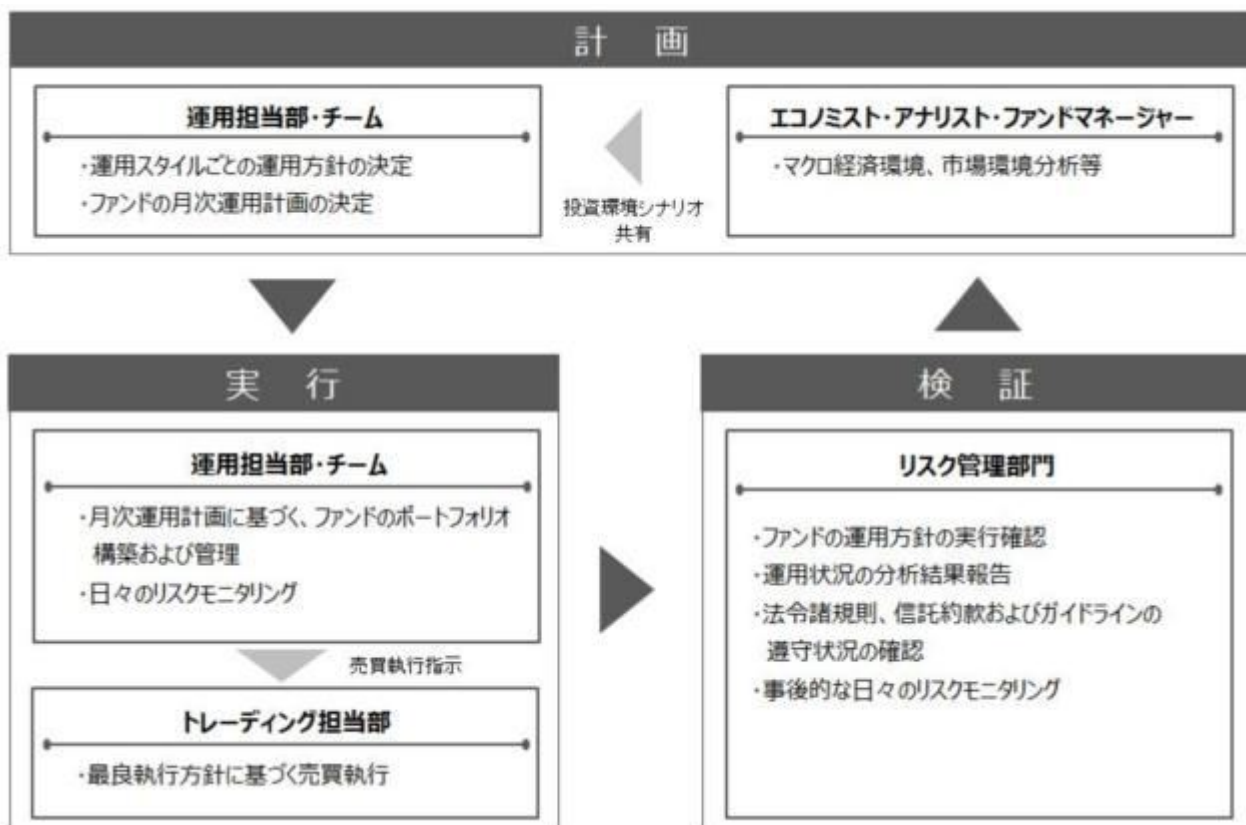
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2019年3月29日現在における三井住友アセットマネジメント株式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(円)
追加型株式投資信託	467	5,759,755,732,324
単位型株式投資信託	92	523,512,840,677
追加型公社債投資信託	1	28,812,487,686
単位型公社債投資信託	115	311,786,512,725
合 計	675	6,623,867,573,412

（ご参考）

2019年3月29日現在における大和住銀投信投資顧問株式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(円)
追加型株式投資信託	309	2,926,233,606,958
単位型株式投資信託	21	57,872,142,748
追加型公社債投資信託	-	-
単位型公社債投資信託	72	250,140,415,808
合 計	402	3,234,246,165,514

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第33期（平成29年4月1日から平成30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34期中

間会計期間(平成30年4月1日から平成30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。

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

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に続き、大和住銀投信投資顧問株式会社の第46期事業年度の財務諸表及び第47期中間会計期間の中間財務諸表を参考情報として記載しております。

(1)【貸借対照表】

			(単位：千円)	
			前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金及び預金			13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託			20,008	20,010
前払費用			351,526	402,249
未収入金			40,544	39,030
未収委託者報酬			5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬			1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬			343,523	316,407
未収収益			20,789	50,321
繰延税金資産			482,535	715,988
その他の流動資産			5,560	10,891
流動資産合計			21,352,691	30,486,188
固定資産				
有形固定資産	1			
建物			198,767	185,371
器具備品			261,096	300,694
有形固定資産合計			459,864	486,065
無形固定資産				
ソフトウェア			493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定			141,025	5,755
電話加入権			68	56
商標権			3	-
無形固定資産合計			634,903	415,576
投資その他の資産				
投資有価証券			12,098,372	10,616,594
関係会社株式			10,412,523	10,412,523
長期差入保証金			677,681	658,505
長期前払費用			61,282	69,423
会員権			7,819	7,819
繰延税金資産			871,577	678,459
投資その他の資産合計			24,129,257	22,443,325
固定資産合計			25,224,025	23,344,968
資産合計			46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

			前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
--	--	--	-----------------------	-----------------------

負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	31,628,014	36,538,981
運用受託報酬	5,649,190	8,362,118

投資助言報酬	1,726,511	1,440,233
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	5,000
サービス支援手数料	61,268	128,324
その他	54,261	55,820
営業収益計	39,124,246	46,530,479
営業費用		
支払手数料	14,908,517	16,961,384
広告宣伝費	366,227	353,971
公告費	1,140	1,140
調査費		
調査費	1,325,978	1,654,233
委託調査費	4,343,104	5,972,473
営業雑経費		
通信費	46,030	40,066
印刷費	338,254	339,048
協会費	21,669	-
諸会費	20,054	45,465
情報機器関連費	2,516,497	2,582,734
販売促進費	24,896	34,333
その他	149,177	136,669
営業費用合計	24,061,549	28,121,520
一般管理費		
給料		
役員報酬	225,885	196,529
給料・手当	6,121,741	6,190,716
賞与	610,533	601,375
賞与引当金繰入額	989,925	1,566,810
交際費	23,136	25,709
事務委託費	317,928	256,413
旅費交通費	229,248	220,569
租税公課	268,527	282,036
不動産賃借料	622,662	654,286
退職給付費用	423,954	419,884
固定資産減価償却費	384,068	329,756
諸経費	335,840	285,490
一般管理費合計	10,553,451	11,029,580
営業利益	4,509,246	7,379,378
営業外収益		
受取配当金	1	106,651
受取利息	1	745
時効成立分配金・償還金		1,721
原稿・講演料		1,474
雑収入		12,592
営業外収益合計	123,184	66,042
営業外費用		
為替差損	9,737	5,125
雑損失	1,084	913
営業外費用合計	10,821	6,038
経常利益	4,621,608	7,439,383
特別利益		
投資有価証券償還益	353,462	61,842

投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		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	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

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

[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) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3.引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

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

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30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
借入金未実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

(損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	当事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)
受取配当金	106,640千円	- 千円
受取利息	18千円	- 千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	当事業年度 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)
建物	6,952千円	- 千円
器具備品	1,204千円	0 千円
ソフトウェア	- 千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年 6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

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

平成29年 6月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年 6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年 6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

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

平成30年 6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
----------------------	------	-------	-----------	---------	----------------	----------------

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

め、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-
(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

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

(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、(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)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29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	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

2.その他有価証券

前事業年度(平成29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	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(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	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

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

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

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

3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29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
228,204	2,579	15,012

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(退職給付関係)

1.採用している退職給付制度の概要

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

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212

退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
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	3,177,131	3,319,830

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(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になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	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137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988

固定の部

繰延税金資産

退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 子会社及び関連会社等

(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
子会社	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投信の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等
受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

(2) 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	2,737,677	未払 手数料	489,567
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	委託販売 手数料	5,485,934	未払 手数料	862,697

(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。
3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。
4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。
なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

親会社 の子会 社	SMBC日興証 券㈱	東京都 千代田 区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売 委託 役員 兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752
-----------------	---------------	-----------------	------------	-----	--------	-------------------------	-------------	-----------	-----------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11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. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
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)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	19,085,678
顧客分別金信託	20,010
前払費用	414,616
未収委託者報酬	7,225,367
未収運用受託報酬	1,541,190

未収投資助言報酬		306,565
未収収益		51,614
その他		53,465
流動資産合計		28,698,508
固定資産		
有形固定資産	1	508,186
無形固定資産		437,397
投資その他の資産		
投資有価証券		9,519,317
関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351
未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
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
資本剰余金合計		8,628,984
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		26,222,740
利益剰余金合計		28,043,944

株主資本合計	38,672,928
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	701,911
評価・換算差額等合計	701,911
純資産合計	39,374,840
負債純資産合計	52,441,002

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			20,003,107
運用受託報酬			3,216,910
投資助言報酬			696,543
その他の営業収益			117,677
営業収益計			24,034,239
営業費用			15,495,987
一般管理費	1		5,200,633
営業利益			3,337,618
営業外収益	2		13,622
営業外費用	3		10,296
経常利益			3,340,944
特別利益	4		293,441
特別損失	5		35,355
税引前中間純利益			3,599,031
法人税、住民税及び事業税			1,010,764
法人税等調整額			104,205
法人税等合計			1,114,969
中間純利益			2,484,061

(3)中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,822,400	2,822,400	2,822,400

中間純利益							2,484,061	2,484,061	2,484,061
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	-	-	-	-	-	-	338,338	338,338	338,338
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,222,740	28,043,944	38,672,928

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

（表示方法の変更）

「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）を当中間会計期間の期首から適用し、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ております。

（中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,162,157千円
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 Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額198,989千円の支払保証を行っております。	

（中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
1. 減価償却実施額 有形固定資産 80,772千円 無形固定資産 84,457千円	
2. 営業外収益のうち主要なもの 雑益 13,281千円	
3. 営業外費用のうち主要なもの 為替差損 10,293千円	
4. 特別利益のうち主要なもの 投資有価証券償還益 289,451千円 投資有価証券売却益 3,990千円	
5. 特別損失のうち主要なもの 合併関連費用 23,103千円 合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等 あります。 投資有価証券売却損 12,101千円	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640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
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

(リース取引関係)

第34期中間会計期間 (自 平成30年 4月 1日 至 平成30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	595,231千円
1年超	3,853,814千円
合 計	4,449,045千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間(平成30年9月30日)

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	19,085,678	19,085,678	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	7,225,367	7,225,367	-
(4)未収運用受託報酬	1,541,190	1,541,190	-
(5)未収投資助言報酬	306,565	306,565	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	9,519,019	9,519,019	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	1,434,365	1,434,365	-
資産計	39,132,197	39,132,197	-
(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金			
未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

(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

其他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
其他有価証券	
非上場株式	298
合計	298
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523

合計	10,412,523
----	------------

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

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間（平成30年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,621,299	5,533,700	1,087,599
小計	6,621,299	5,533,700	1,087,599
(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	2,897,719	2,973,628	75,908
小計	2,897,719	2,973,628	75,908
合計	9,519,019	8,507,328	1,011,691

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 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。

（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。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30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	20,003,107	3,216,910	696,543	117,677	24,034,239

(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。

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。

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,232円13銭
1株当たり中間純利益	140円81銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。</p>	
<p>(注) 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、当事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益を算定しております。</p>	
<p>1株当たり純資産額の算定上の基礎</p>	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	39,374,840千円
普通株式に係る純資産額	39,374,840千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640,000株
<p>1株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
中間損益計算書上の中間純利益	2,484,061千円
普通株式に係る中間純利益	2,484,061千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式の期中平均株式数	17,640,000株

(追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間の合併契約の締結について

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」)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。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

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

(2) 企業結合を行う主な理由

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

(3) 企業結合日

平成31年4月1日（予定）

(4) 企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5) 結合後企業の名称

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社

(6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

(1) 合併比率

大和住銀の普通株式1株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

(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、大和住銀はP w Cアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であるとの判断し、合意に至ったものであります。

(3) 交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

（重要な後発事象）

株式分割

当社は、平成30年9月28日開催の取締役会決議に基づき、平成30年11月1日付で株式分割を行っております。

1. 株式分割の目的

合併に伴い株主の議決権割合が変更となる見込みであり、円滑に変更手続きを行うために株式分割を行っております。

2. 株式分割の概要

(1) 分割の方法

平成30年10月31日を基準日として、同日最終の株主名簿に記載された株主の所有する普通株式1株につき、1,000株の割合をもって分割しております。

(2) 分割により増加した株式数

株式分割前の発行済株式総数	17,640株
今回の分割により増加した株式数	17,622,360株
株式分割後の発行済株式数	17,640,000株
株式分割後の発行可能株式総数	60,000,000株

(3) 株式分割の日程

基準日公告日	平成30年10月12日
基準日	平成30年10月31日
効力発生日	平成30年11月1日

(4) 1株当たり情報に及ぼす影響

1株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

(参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
また、委託会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条の規定に基づき、「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。)により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第46期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表及び、第47期中間会計期間(平成30年4月1日から平成30年9月30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る監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月5日

大和住銀投信投資顧問株式会社
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 梅 津 広 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項の規定に基づき監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第46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、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成30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、平成30年5月11日付にて、会社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主が、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月3日

大和住銀投信投資顧問株式会社

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 坂 田 浩 司 印
 業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印
 業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経営状況」に掲げられている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期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月27日開催の会社の取締役会において、会社と三井住友アセットマネジメント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、平成30年9月28日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

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。

（注2）XBRLデータは中間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45期

第46期

(平成29年3月31日)

(平成30年3月31日)

資産の部

流動資産

現金・預金		21,770,643	21,360,895
前払費用		206,930	204,460
未収入金		7,453	12,823
未収委託者報酬		3,291,565	3,363,312
未収運用受託報酬		912,489	1,198,432
未収収益		50,722	41,310
繰延税金資産		447,651	504,497
その他		428	7,553
流動資産計		26,687,885	26,693,285

固定資産

有形固定資産

建物	1	110,298	75,557
器具備品	1	66,464	122,169
土地		710	710
リース資産	1	10,562	7,275
有形固定資産計		188,035	205,712

無形固定資産

ソフトウェア		96,732	73,887
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		109,439	86,593

投資その他の資産

投資有価証券		6,783,747	10,257,600
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,546	1,170
長期差入保証金		511,637	534,699
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		523,217	536,754
その他		192	-
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		8,838,366	12,348,249

固定資産計

	9,135,840	12,640,555
--	-----------	------------

資産合計

	35,823,726	39,333,840
--	------------	------------

(単位：千円)

第45期

第46期

(平成29年3月31日)

(平成30年3月31日)

負債の部

流動負債

リース債務		3,524	3,143
-------	--	-------	-------

未払金	61,012	29,207
未払手数料	1,419,878	1,434,393
未払費用	1,150,008	1,287,722
未払法人税等	459,723	1,397,293
未払消費税等	26,700	135,042
賞与引当金	1,251,100	1,263,100
役員賞与引当金	82,900	85,600
その他	46,283	23,128
流動負債計	4,501,131	5,658,632
固定負債		
リース債務	7,841	4,698
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
役員退職慰労引当金	93,560	88,050
固定負債計	1,583,902	1,632,952
負債合計	6,085,034	7,291,585

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30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	26,100,773	28,387,042
利益剰余金合計	27,544,504	29,830,773
株主資本合計	29,700,773	31,987,042
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	37,917	55,213
評価・換算差額等合計	37,917	55,213
純資産合計	29,738,691	32,042,255
負債純資産合計	35,823,726	39,333,840

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	4,371,647	5,111,757
委託者報酬	28,124,470	26,383,145
その他営業収益	64,558	82,997
営業収益計	32,560,677	31,577,899
営業費用		
支払手数料	13,056,474	11,900,832
広告宣伝費	169,346	93,131
公告費	2,915	-
調査費		
調査費	1,331,709	1,637,364
委託調査費	3,213,013	2,959,680
委託計算費	137,135	79,120
営業雑経費		
通信費	39,943	42,497
印刷費	501,370	517,371
協会費	24,788	24,374
諸会費	2,492	3,778
その他	109,609	122,930
営業費用計	18,588,799	17,381,079
一般管理費		
給料		
役員報酬	209,010	218,127
給料・手当	2,852,929	2,809,008
賞与	129,064	86,028
退職金	32,873	9,864
福利厚生費	639,080	647,269
交際費	22,638	29,121
旅費交通費	142,966	159,224
租税公課	174,826	199,255
不動産賃借料	620,232	622,807
退職給付費用	217,625	219,724
固定資産減価償却費	57,699	71,624
賞与引当金繰入額	1,251,100	1,263,100
役員退職慰労引当金繰入額	38,169	36,130
役員賞与引当金繰入額	80,300	85,500

諸経費	564,747	901,001
一般管理費計	7,033,264	7,357,787
営業利益	6,938,613	6,839,032
営業外収益		
受取配当金	4,517	23,350
受取利息	675	199
投資有価証券売却益	6,051	6,350
業務委託関連引当金戻入	4,000	-
為替差益	123	-
その他	5,690	2,831
営業外収益計	21,058	32,732
営業外費用		
投資有価証券売却損	21,990	5,000
為替差損	-	1,784
その他	113	0
営業外費用計	22,103	6,784
経常利益	6,937,568	6,864,980
税引前当期純利益	6,937,568	6,864,980
法人税、住民税及び事業税	1,881,549	2,242,775
法人税等調整額	225,697	78,014
法人税等合計	2,107,247	2,164,761
当期純利益	4,830,321	4,700,218

(3) 株主資本等変動計算書

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	
				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	24,034,752
当期変動額						
剰余金の配当						2,764,300
当期純利益						4,830,321
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,066,021
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				

当期首残高	25,478,483	27,634,752	27,182	27,182	27,661,934
当期変動額					
剰余金の配当	2,764,300	2,764,300			2,764,300
当期純利益	4,830,321	4,830,321			4,830,321
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			10,735	10,735	10,735
当期変動額合計	2,066,021	2,066,021	10,735	10,735	2,076,757
当期末残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691

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	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項 目の当期変動額 (純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	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

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 15～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（貸借対照表関係）

<p>第45期 （平成29年3月31日）</p>	<p>第46期 （平成30年3月31日）</p>
------------------------------	------------------------------

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	454,117千円	建物	465,964千円
器具備品	272,531千円	器具備品	266,621千円
リース資産	10,688千円	リース資産	8,719千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員		-
被保証債務の内容	住宅ローン		
金額	940千円		

(株主資本等変動計算書関係)

第45期(自平成28年4月1日至平成29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28年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,764,300	718	平成28年3月31日	平成28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29年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,413,950	利益 剰余金	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

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

(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。

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45期（平成29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	21,770,643	21,770,643	-
(2) 未収委託者報酬	3,291,565	3,291,565	-
(3) 未収運用受託報酬	912,489	912,489	-
(4) 未収入金	7,453	7,453	-
(5) 投資有価証券			
その他有価証券	6,732,611	6,732,611	-

資産計	32,714,763	32,714,763	-
(1) 未払手数料	1,419,878	1,419,878	-
(2) 未払費用(*)	891,704	891,704	-
負債計	2,311,583	2,311,583	-

(*) 金融商品に該当するものを表示しております。

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 其他有価証券	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。

(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。

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45期(平成29年3月31日)	第46期(平成30年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	511,637	534,699

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45期(平成29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	21,770,643	-	-	-
未収委託者報酬	3,291,565	-	-	-
未収運用受託報酬	912,489	-	-	-
未収入金	7,453	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券の うち満期があるもの	-	2,222,381	467,133	-
合計	25,982,151	2,222,381	467,133	-

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式

第45期(平成29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。

2.その他有価証券

第45期(平成29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	3,882,464	3,705,555	176,909
小計	3,882,464	3,705,555	176,909
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	2,850,146	2,972,404	122,257
小計	2,850,146	2,972,404	122,257
合計	6,732,611	6,677,959	54,652

(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。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第45期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,105,918	6,051	21,990

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

（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45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,546,322	1,482,500
退職給付費用	149,442	147,235
退職給付の支払額	213,264	105,520
その他	-	15,987
退職給付引当金の期末残高	1,482,500	1,540,203

（注）その他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

(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45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30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	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203
退職給付引当金	1,482,500	1,540,203
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,482,500	1,540,203

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第45期 149,442千円 第46期 147,235千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第45期は68,183千円、第46期は72,489千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第45期 (平成29年3月31日)	第46期 (平成30年3月31日)
(1) 流動資産		
繰延税金資産		
未払事業税	12,099	71,030
賞与引当金	386,089	386,761
社会保険料	29,075	30,549
未払事業所税	4,693	4,247
その他	21,191	11,908
繰延税金資産合計	453,148	504,497
繰延税金負債		
その他	5,496	-
繰延税金負債合計	5,496	-
繰延税金資産の純額	447,651	504,497
(2) 固定資産		
繰延税金資産		
退職給付引当金	454,152	471,610
投資有価証券	67,546	67,546
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	28,748	26,961
その他	57,051	62,550
繰延税金資産小計	618,499	639,668
評価性引当額	78,546	78,546
繰延税金資産合計	539,952	561,121
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	16,734	24,367
繰延税金負債合計	16,734	24,367
繰延税金資産の純額	523,217	536,754

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45期及び第46期は、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以下にあたるため注記を省略しております。

（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45期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	28,124,470	4,371,647	64,558	32,560,677

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。

(関連当事者との取引)

第45期(自平成28年4月1日 至平成29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	4,766,199	未払手数料	406,661
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	2,372,960	未払手数料	377,341

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46期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

	第45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,724円34銭	8,322円66銭
1株当たり当期純利益金額	1,254円63銭	1,220円84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45期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(千円)	4,830,321	4,700,218
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)	4,830,321	4,700,218
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)

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付にて、当社及び三井住友アセットマネジメント株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社、及び住友生命保険相互会社が、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成30年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,749,227
前払費用		220,062
未収入金		134,890
未収委託者報酬		3,199,531
未収運用受託報酬		1,318,844
未収収益		40,355
その他		3,640
流動資産計		23,666,551
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	304,462
器具備品	1	106,510
土地		710
リース資産	1	9,904
有形固定資産計		421,586
無形固定資産		103,187

投資その他の資産	
投資有価証券	11,160,853
関係会社株式	956,115
従業員長期貸付金	1,123
長期差入保証金	534,276
出資金	82,660
繰延税金資産	841,341
その他	945
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産計	13,556,564
固定資産計	14,081,338
資産合計	37,747,889

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成30年9月30日)

負債の部

流動負債

リース債務	3,727
未払金	66,584
未払手数料	1,372,290
未払費用	1,215,524
未払法人税等	754,735
未払消費税等	145,434
前受収益	43,935
賞与引当金	566,800
役員賞与引当金	36,000
その他	22,639
流動負債計	4,227,672

固定負債

リース債務	6,965
退職給付引当金	1,574,978
役員退職慰労引当金	100,760
資産除去債務	248,260
固定負債計	1,930,965

負債合計

6,158,637

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成30年9月30日)

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	156,268
資本剰余金合計	156,268
利益剰余金	
利益準備金	343,731
その他利益剰余金	
別途積立金	1,100,000
繰越利益剰余金	27,961,448
利益剰余金合計	29,405,179
株主資本合計	31,561,448
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	27,803
評価・換算差額等合計	27,803
純資産合計	31,589,252
負債純資産合計	37,747,889

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

当中間会計期間
(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	12,879,465
運用受託報酬	2,302,085
その他営業収益	34,382
営業収益計	15,215,933
営業費用	
一般管理費	1 3,616,813
営業利益	2,819,632
営業外収益	
受取配当金	14,987
受取利息	89
投資有価証券売却益	4,775
雑収入	635
営業外収益計	20,488
営業外費用	
投資有価証券売却損	4,300

為替差損		224
その他		389
営業外費用計		4,914
経常利益		2,835,206
特別損失	2	21,700
税引前中間純利益		2,813,506
法人税、住民税及び事業税		678,594
法人税等調整額		212,006
法人税等合計		890,600
中間純利益		1,922,905

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30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	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,348,500
中間純利益						1,922,905
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	-	-	-	-	-	425,594
当中間期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,961,448

	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,348,500	2,348,500			2,348,500
中間純利益	1,922,905	1,922,905			1,922,905
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			27,409	27,409	27,409
当中間期変動額合計	425,594	425,594	27,409	27,409	453,003
当中間期末残高	29,405,179	31,561,448	27,803	27,803	31,589,252

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	<p>有価証券</p> <p>(1)子会社株式 …総平均法による原価法</p> <p>(2)その他有価証券</p> <p>時価のあるもの…中間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、売却原価は総平均法により算定）</p> <p>時価のないもの…総平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産（リース資産を除く）</p> <p>定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物2年～30年、器具備品4年～15年 （会計上の見積りの変更）</p> <p>当中間会計期間において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社（以下「S M A M」）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。</p> <p>これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ2,226千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）</p> <p>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)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</p> <p>リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1)貸倒引当金</p> <p>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。</p> <p>(2)賞与引当金</p> <p>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中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(3)役員賞与引当金</p> <p>役員賞与の支払に備えるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(4)退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当中間会計期間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</p> <p>役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。</p>
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	<p>消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、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ております。

(追加情報)

当社とS M A Mとの間での合併契約の締結について

当社は、平成30年9月27日開催の当社取締役会において、当社とS M A Mとの間で合併契約を締結することについて決議し、平成30年9月28日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

1. 企業結合の概要

(1) 吸収合併存続会社及び吸収合併消滅会社の名称及び事業の内容

吸収合併存続会社の名称	三井住友アセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業、投資助言・代理業等
吸収合併消滅会社の名称	大和住銀投信投資顧問株式会社
事業の内容	投資運用業、投資助言・代理業等

(2) 企業結合を行う主な理由

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

(3) 企業結合日

平成31年4月1日(予定)

(4) 企業結合の法的形式

当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式であります。

(5) 結合後企業の名称

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社

(6) 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

(1) 合併比率

当社の普通株式1株に対し、S M A Mの普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

(2) 合併比率の算定方法

当社はP w Cアドバイザー合同会社を、S M A M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、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であるとの判断し、合意に至ったものであります。

(3) 交付株式数

普通株式：16,230,060株

（中間貸借対照表関係）

当中間会計期間（平成30年9月30日）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	781,783千円

（中間損益計算書関係）

当中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	40,478千円
	無形固定資産	16,211千円
2.特別損失	合併関連費用	21,700千円
	合併関連費用は、当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用等であります。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）						
1.発行済株式に関する事項						
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
	普通株式（千株）	3,850	-	-	3,850	
2.配当に関する事項						
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

（金融商品関係）

当中間会計期間（平成30年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成30年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。

（（注2）をご参照ください。）

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	18,749,227	18,749,227	-
(2)未収委託者報酬	3,199,531	3,199,531	-
(3)未収運用受託報酬	1,318,844	1,318,844	-
(4)未収入金	134,890	134,890	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	11,109,717	11,109,717	-
(6)長期差入保証金	519,765	519,765	-
資産計	35,031,976	35,031,976	-
(1)未払手数料	1,372,290	1,372,290	-
(2)未払費用	878,527	878,527	-

負債計	2,250,818	2,250,818	-
-----	-----------	-----------	---

() 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

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、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」をご参照ください。

(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

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115
(3) 長期差入保証金	14,511

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成30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 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

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
証券投資信託の受益証券	5,053,937	4,797,266	256,671
小計	5,053,937	4,797,266	256,671
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
証券投資信託の受益証券	6,055,780	6,272,376	216,596

小計	6,055,780	6,272,376	216,596
合計	11,109,717	11,069,643	40,074

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（平成30年9月30日）

デリバティブ取引を利用しておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）
期首残高	-
見積りの変更による増加額（注）	248,260
中間期末残高	248,260

（注）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、当中間会計期間において、新たな情報の入手に伴い合理的な見積りが可能となったため、使用見込期間を当該契約期間と見積り、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いません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

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

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. 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	12,879,465	2,302,085	34,382	15,215,933

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中間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

外部顧客からの営業収益のうち、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、記載を省略しております。

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

当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
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
当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
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
当中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成30年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	8,205円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	31,589,252
純資産の部の合計額から控除する金額(千円)	-
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	31,589,252
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の数(千株)	3,850

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	499円46銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,922,905
普通株式に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	1,922,905
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内

閣府令で定めるものを除きます。)

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

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

(ロ) その他の重要事項

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

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2018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 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2018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。

ロ 販売会社

- (イ) 名称 株式会社三井住友銀行
- (ロ) 資本金の額 1,770,996百万円（2018年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）
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

平成30年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30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、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年10月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の平成29年9月14日から平成30年9月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の平成30年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年10月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)の平成29年9月14日から平成30年9月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)の平成30年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年10月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の平成29年9月14日から平成30年9月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の平成30年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年10月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)の平成29年9月14日から平成30年9月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)の平成30年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年10月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の平成29年9月14日から平成30年9月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の平成30年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月28日開催の会社の取締役会において、会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、同日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

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

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の平成30年9月19日から平成31年3月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の平成31年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年9月19日から平成31年3月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）の平成30年9月19日から平成31年3月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）の平成31年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年9月19日から平成31年3月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の平成30年9月19日から平成31年3月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の平成31年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年9月19日から平成31年3月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）の平成30年9月19日から平成31年3月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）の平成31年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年9月19日から平成31年3月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成31年4月23日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の平成30年9月19日から平成31年3月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の平成31年3月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年9月19日から平成31年3月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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