

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月24日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 日経225インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド
【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】	(1)当初自己設定額 三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 日経225インデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド 100万円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド 100万円を上限とします。 (2)継続申込額 三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 日経225インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年8月6日付をもって提出しました有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、2022年2月24日に有価証券報告書を提出したことに伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

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】

(2)【ファンドの沿革】

<更新後>

2021年8月23日 信託契約締結、設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

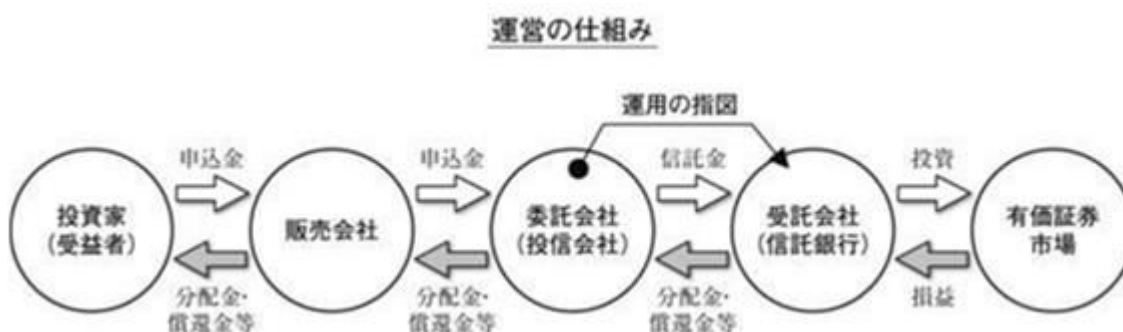
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(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。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2021年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

1987年2月20日 証券投資顧問業の登録

1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

1999年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

- 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
- 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

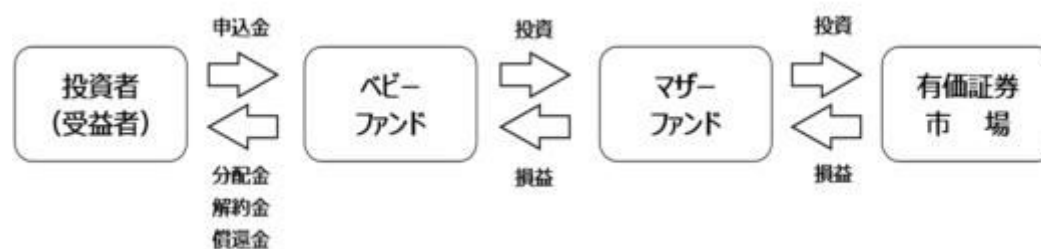
(八) 大株主の状況

(2021年12月30日現在)

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

八 ファンドの運用形態(ファミリーファンド方式による運用)

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



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

<更新後>

イ 基本方針

各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

- (イ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)への投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式^{*}に投資することにより、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。
- ^{*}2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。
- (ロ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (二) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)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。
- 東京証券取引所の市場は2022年4月に新しい市場区分(プライム市場、スタンダード市場、グロース市場)への再編が予定されております。これに伴い、TOPIXの算出方法について変更が予定されております。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

- (イ) 225マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本の株式に投資し、日経平均株価(日経225)の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- (ロ) 225マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用する場合があります。
- (二) 株式の実質投資比率は、原則として、純資産総額の+110%以内とします。
- (ホ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資することにより、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (二) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 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。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、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することにより、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。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせて運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入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。
- (二) 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。

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

- (イ) 外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資すること

により、F T S E世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- (ロ) 外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入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。
- (ニ) 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。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

(イ) Jリート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

- ・主として日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(R E I T)に投資することにより、東証R E I T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。
- ・不動産投資信託(R E I T)への投資にあたっては、東証R E I T指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- ・ベンチマークとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引等を活用する場合があります。このため、不動産投資信託(R E I T)の実質組入時価総額と不動産投信指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額を超えることがあります。

- (ロ) Jリート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

(イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(R E I T)等に投資することにより、S & P先進国R E I T指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ・不動産投資信託(R E I T)等への投資にあたっては、S & P先進国R E I T指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入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。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

「三井住友DS・ポートフォリオ・シリーズ」は、複数ファンドで構成されており、各ファンドは投資対象とする各マザーファンドへの投資を通じて、実質的に投資対象とする資産に投資します。

※各マザーファンドおよび投資対象とする資産については後掲の「ファンドのしくみ」をご参照ください。

2

各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

ファンド名	ベンチマーク
TOPIXインデックス	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
225インデックス	日経平均株価(日経225)
先進国株インデックス	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株インデックス	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)
先進国債インデックス	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
Jリートインデックス	東証REIT指数(配当込み)
Gリートインデックス	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

3

「三井住友DS・ポートフォリオ・シリーズ」の各ファンド間でのスイッチングが可能です。

■一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

ファンドのしくみ

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



※上記における各ファンド、各マザーファンドおよび各投資対象資産は以下のとおりになります。

ファンド	マザーファンド	投資対象資産
TOPIXインデックス	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	日本の株式等
225インデックス	225マザーファンド	
先進国株インデックス	外国株式インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の株式等
新興国株インデックス	エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国の株式および 株式指数先物取引等
先進国債インデックス	外国債券パッシブ・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の公社債等
Jリートインデックス	Jリート・インデックス・マザーファンド	日本のリート等
Gリートインデックス	外国リート・インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域のリート等

各ファンドの運用の基本方針等

▶ 国内株式

TOPIXインデックス

ベンチマーク TOPIX(東証株価指数、配当込み)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- *2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。
- ※株価指数先物取引等を利用することがあります。

※東京証券取引所の市場は2022年4月に新しい市場区分(プライム市場、スタンダード市場、グロース市場)への再編が予定されております。これに伴い、TOPIXの算出方法について変更が予定されております。

225インデックス

ベンチマーク 日経平均株価(日経225)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

▶ 先進国株式

先進国株インデックス

ベンチマーク MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- ※株価指数先物取引等を利用することがあります。
- 実質組入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。
- ※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国株式

新興国株インデックス

ベンチマーク MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式*、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対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- *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。
- ※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせて運用を行います。
- 実質組入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。
- ※基準価額は為替変動の影響を受けます。



預託証券(DR)とは

Depositary Receiptの略で、株式を海外で流通させるために、その株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいい、株式と同様に取引所などで取引されます。

▶ 先進国債券

先進国債インデックス

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※FTSE世界国債インデックスには、2021年11月より、段階的に中国国債の組入れが開始されています。
- 実質組入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。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 国内リート

Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※不動産投信指数先物取引等を利用することがあります。

▶ 外国リート

Gリートインデックス

ベンチマーク S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入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。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

為替の影響について

▶ 為替ヘッジなし

為替ヘッジなし

円安の場合(為替差益)
基準価額にプラス円高の場合(為替差損)
基準価額にマイナス

- 外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行わない場合、基準価額は為替変動の影響を受けます。

各ファンドの運用プロセス



*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

[ポートフォリオの構築手法]

構築手法	ファンド名
最適化法	TOPIXインデックス、先進国株インデックス、新興国株インデックス
層化抽出法	先進国債インデックス
完全法	225インデックス、Jリートインデックス、Gリートインデックス



最適化法とは

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

層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出して構成銘柄を選択し、ポートフォリオを構築する方法です。

完全法とは

指数を構成するすべての銘柄について、その時価構成比率に合わせて保有し、ポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

追加的記載事項

●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

<TOPIXインデックス、Jリートインデックス>

- TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数の商標は、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX、東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。
- 東京証券取引所は、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX、東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- 東京証券取引所は、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIX、東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 東京証券取引所は、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東京証券取引所は、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、TOPIX、東証REIT指数に連動した投資成果を目標として運用しますが、当ファンドの基準価額とTOPIX、東証REIT指数の指数値の間に乖離が発生する可能性があります。
- 当ファンドは、東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- 東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

<225インデックス>

- 日経平均株価(日経225)とは株式会社日本経済新聞社より発表されている株価指標で、東証第一部*上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象に算出されています。
*2022年4月4日以降、構成銘柄の対象市場は東証プライム市場に変更される予定です。
- 日経平均株価は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価自体および日経平均株価を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延もしくは中断に関して、責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価の構成銘柄、計算方法、日経平均株価の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<先進国株インデックス、新興国株インデックス>

MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)および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)は、MSCI INC.(以下「MSCI」)が公表する指数(MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス)を委託会社が独自に計算したものです。その指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、当ファンドを同社が保証するものではありません。

当ファンドは、MSCI、その関連会社、情報提供会社またはMSCI INDEXの編集または計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、売却または宣伝するものではありません。

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

MSCIおよびMSCI INDEXの名称は、MSCIもしくはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のための使用について許可されているものです。

いかなるMSCI当事者も、委託会社、受益者、またはその他の個人もしくは事業体に対して、ファンド投資一般、当ファンドへの投資、もしくはMSCI INDEXが対応する株式市場パフォーマンスを記録する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明または保証を行いません。

MSCIもしくは関連会社は、当ファンド、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体とは無関係にMSCIが決定、構成、計算するMSCI INDEXに関する特定の商標、サービスマーク、商号のライセンサーです。

いかなるMSCI当事者も、MSCI INDEXについて決定、構成または計算するにあたり、委託会社または受益者、またはその他のあらゆる個人または事業体のニーズを考慮する義務を負いません。

いかなるMSCI当事者も、当ファンドの発行時期、価格、数量に関する決定、当ファンドの償還価格および数式の決定および算定に参加しておらず、かつその責任を負いません。

さらに、いかなるMSCI当事者も、当ファンドの運営、マーケティング、またはオフリングに関連して、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体に対して一切の義務または責任を負いません。

MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI INDEXの算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI当事者も、MSCI INDEXまたはそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体がMSCI INDEXもしくはそのデータを使用して得る情報またはその結果に関して、明示・黙示の保証をしません。

MSCI当事者は、MSCI INDEXもしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示・黙示の保証責任も負わず、MSCI INDEXもしくはそのデータに関して、商品性および特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなるMSCI当事者も、直接、間接、特別、懲罰的、結果的な損害、およびその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

<先進国債インデックス>

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、FTSE Fixed income LLCが算出し公表している指数(FTSE世界国債インデックス)をもとに、委託会社が計算したものです。FTSE世界国債インデックスに関する知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed income LLCに帰属します。

また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

<Gリートインデックス>

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する指数(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み))を基に委託会社が独自に計算した値を用いています。

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。また、当ファンドを同社が保証するものではありません。

S&P先進国REIT指数は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社([SPDJ])の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC([S&P])の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC([Dow Jones])の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REIT指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対して一切の責任も負いません。

(5) 【投資制限】**<更新後>**

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドに

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

- 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、先物取引を含めた実質投資比率は、信託財産の純資産総額の110%以下とします。
- 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 国債を除く同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への投資は行いません。
- ニ 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せす。
- 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。

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- 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です。
- 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。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 信用取引の指図

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

ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外

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

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をい

ます。

ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ヌ 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。
- (ニ) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 信用取引の指図

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

ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限り

ではありません。

- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (チ)「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ)「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ヌ 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。

ル 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ヲ 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。
- (ニ) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債（日本および外国の国債証券を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一発行体にかかる公社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総

額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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

ニ 信用取引の指図

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

ホ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとしします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ヘ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとしします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定

元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (リ)「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

チ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

リ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ヌ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ル 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。

ヲ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える

額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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

ウ 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) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 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られたときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる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、上記(ロ)の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) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ハ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

二 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。
- (ニ) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 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) 上記(イ)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、上記(ロ)の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。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ハ 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。

ニ 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とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産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。

ホ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ヘ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、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
- (八) 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) 借入金の利息は受益者の負担とし、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。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式^{*}に投資を行い、T O P I X (東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

^{*}2022年4月4日以降は、T O P I X (東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。

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

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

東京証券取引所の市場は2022年4月に新しい市場区分(プライム市場、スタンダード市場、グロース市場)への再編が予定されております。これに伴い、T O P I Xの算出方法について変更が予定されております。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

(2.2.5 マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日経平均株価(日経225)に連動する投資成果をめざした運用を行うことを基本とします。

ロ 投資態度

(イ) 日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄に原則として、投資を行います。

(ロ) 株式の組入比率は高位を保ちます。

(ハ) 運用の効率化を図るため、日経平均先物取引を利用することもあります。

(ニ) 株式の実質投資比率は、原則として、純資産総額の+110%以内とします。また、実質投資比率が前記の上限を超過した場合には、すみやかに調整するものとします。なお、実質投資比率は、現物資産の時価総額と先物の買建玉の時価総額の合計額から先物の売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

(ホ) 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

- １．株券または新株引受権証書
- ２．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- ３．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質有するもの
- ４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- ５．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
- ６．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第１号の証券または証書を以下「株式」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・2 2 5 インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）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。

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 特別の法律により法人の発行する債券
 4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 5. コマーシャル・ペーパー
 6. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 8. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 9. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 11. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（エマージング株式インデックス・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

M S C I 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。

□ 投資態度

- (イ) 主として新興国の株式（預託証書（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、MSCIEマーキング・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。
- (ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせる運用を行います。
- (ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

□ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託

の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

(ハ) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(ニ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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と連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 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と連動する投資成果を目指します。

(ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

(ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

(ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（3）投資制限

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

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

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

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

(J) リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)されている不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 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。

(ロ) 不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ニ) 東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

(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。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 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。)

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの

4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

- (ロ) 株式への投資は行いません。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ホ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 不動産投資信託(REIT)などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (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。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーフンドが投資対象とする資産の種類に同じです(デリバティブ取引にかかる権利を除きます。)

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 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。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

3【投資リスク】

<更新後>

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

各ファンドの主要なリスクは以下の通りです。内容につきましては、後掲をご覧ください。

ファンド名	価格変動リスク			信用 リスク	為替変動 リスク	カント リー リスク	流動性 リスク
	株式市場 リスク	債券市場 リスク	不動産 投資信託 (リート) に関する リスク				
TOPIXインデックス							
225インデックス							
先進国株インデックス							
新興国株インデックス							
先進国債インデックス							
Jリートインデックス							
Gリートインデックス							

(イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向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。

(ロ) 債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、債券の種類

や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

(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や賃貸収入、個々のリートの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。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する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

(ヘ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等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) 流動性リスク

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、十分な数量の売買ができなかったり、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。

なお、海外の取引所によっては、長期間にわたる個別銘柄の売買停止措置がとられることがあり、そのような場合には一般社団法人投資信託協会規則もしくは委託会社の社内ルールに従って、当該有価証券の評価を行います。

(チ) 対象インデックスの動きと連動しない要因

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること
- ・225インデックスは、組入銘柄の配当金を受け取ること(対象インデックスは配当金を含まない指数です。)

(リ) 外国税制に関する留意点

投資対象国によっては、有価証券の売買を行う際の売買益等に対して課税される場合があります。将来、これらの税率や課税方法が変更された場合、または新たな税制が適用された場合、基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ヌ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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。

(ル) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ヲ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

（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。

■TOPIXインデックス（ベンチマーク:TOPIX(東証株価指数、配当込み)）



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。



■225インデックス（ベンチマーク:日経平均株価(日経225)）



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

※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。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※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。

■先進国株インデックス(ベンチマーク:MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース))



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。



■新興国株インデックス(ベンチマーク: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))



■先進国債インデックス(ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース))



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

※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。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※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。

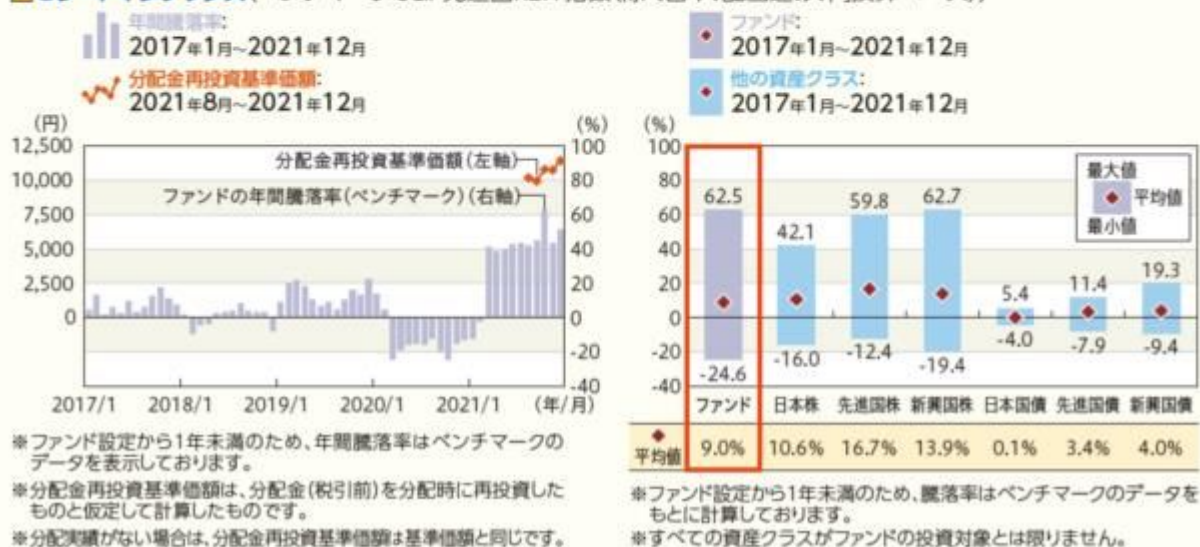
ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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。

■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



■Gリートインデックス(ベンチマーク:S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))



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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

イ 個別元本について

(イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申

込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

(ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

(ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

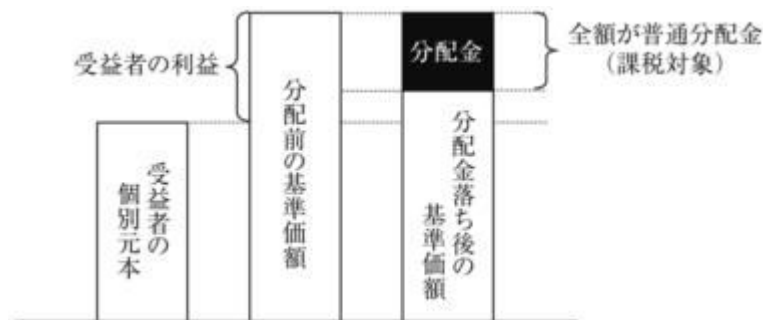
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

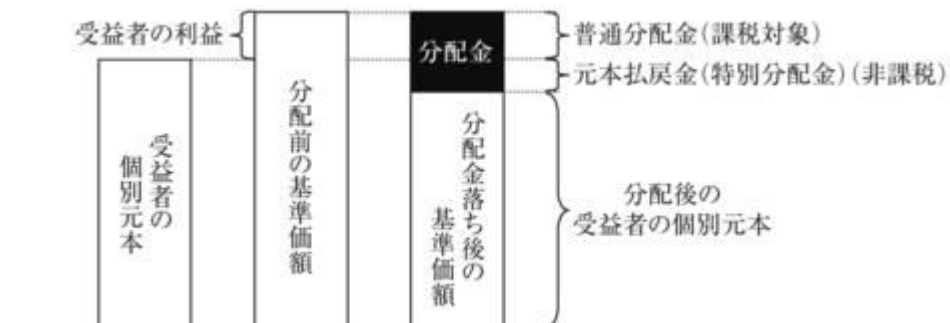
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

なお、「TOPIXインデックス」および「225インデックス」は、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。その他のファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。

また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年12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】

<更新後>

(1)【投資状況】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	7,861,674	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,926	0.02
合計(純資産総額)		7,859,748	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DS・日経225インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	79,458,223	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	23,526	0.03
合計(純資産総額)		79,434,697	100.00

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	103,851,274	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	32,351	0.03
合計(純資産総額)		103,818,923	100.00

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	9,615,452	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,131	0.02
合計(純資産総額)		9,613,321	100.00

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	16,958,066	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,847	0.01
合計(純資産総額)		16,956,219	100.00

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	12,864,632	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,081	0.01
合計(純資産総額)		12,863,551	100.00

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	13,259,202	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,506	0.01
合計(純資産総額)		13,257,696	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	2,357,960	3.2214	7,595,845	3.3341	7,861,674	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	225マザー ファンド	21,184,905	3.6233	76,759,695	3.7507	79,458,223	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	17,103,306	5.8063	99,307,359	6.0720	103,851,274	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	5,672,164	1.6926	9,600,708	1.6952	9,615,452	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.02

合 計	100.02
-----	--------

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	8,495,174	1.9870	16,879,554	1.9962	16,958,066	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合 計	100.01

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	4,710,594	2.6837	12,641,779	2.7310	12,864,632	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合 計	100.01

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	4,422,535	2.8317	12,523,078	2.9981	13,259,202	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合 計	100.01

【投資不動産物件】

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・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】

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

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D S ・T O P I Xインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
2021年 8月末日	1,041,929	-	10,419	-
9月末日	1,943,342	-	10,864	-
10月末日	10,433,478	-	10,694	-
11月末日	6,046,349	-	10,294	-
12月末日	7,859,748	-	10,650	-

三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
2021年 8月末日	1,040,355	-	10,404	-
9月末日	32,945,364	-	10,977	-
10月末日	50,879,997	-	10,764	-
11月末日	69,516,804	-	10,362	-
12月末日	79,434,697	-	10,740	-

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
2021年 8月末日	3,046,896	-	10,252	-
9月末日	19,428,857	-	9,989	-
10月末日	48,198,190	-	10,704	-
11月末日	74,584,829	-	10,652	-
12月末日	103,818,923	-	11,078	-

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
2021年 8月末日	1,040,647	-	10,406	-
9月末日	1,128,389	-	10,309	-
10月末日	3,028,457	-	10,717	-
11月末日	3,024,503	-	10,217	-
12月末日	9,613,321	-	10,327	-

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
2021年 8月末日	1,001,711	-	10,017	-
9月末日	6,502,806	-	9,939	-
10月末日	6,804,601	-	10,153	-
11月末日	6,787,059	-	10,037	-
12月末日	16,956,219	-	10,090	-

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513
2021年 8月末日	1,012,930	-	10,129	-
9月末日	1,657,609	-	9,805	-
10月末日	1,677,320	-	9,922	-

11月末日	2,142,283	-	9,513	-
12月末日	12,863,551	-	9,829	-

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
2021年 8月末日	1,019,980	-	10,200	-
9月末日	2,086,641	-	9,956	-
10月末日	2,266,945	-	10,816	-
11月末日	2,304,754	-	10,763	-
12月末日	13,257,696	-	11,446	-

【分配の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日 ~ 2021年11月30日	0

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日 ~ 2021年11月30日	0

【収益率の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.9

(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DS・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6

(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DS・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5

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

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2

(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DS・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1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DS・国内リートインデックス・ファンド

	収益率（％）
第1期	4.9

（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DS・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率（％）
第1期	7.6

（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DS・TOPIXインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	11,131,313	5,257,925

（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DS・日経225インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	68,267,713	1,179,562

（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DS・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	72,990,426	2,971,998

（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DS・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,960,151	0

（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DS・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	6,762,046	0

（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D S ・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,350,609	98,727

（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D S ・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,141,454	0

（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）

2021年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	204,383,864,360	98.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,963,292,801	1.90
合計（純資産総額）		208,347,157,161	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,924,240,000	1.88
合計	買建	-	3,924,240,000	1.88

2 2 5 マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	106,108,086,500	97.92
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,251,051,484	2.08
合計（純資産総額）		108,359,137,984	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,244,840,000	2.07
合計	買建	-	2,244,840,000	2.07

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	アメリカ	254,086,263,915	67.84

	イギリス	14,817,668,971	3.96
	カナダ	12,862,949,481	3.43
	スイス	12,366,082,856	3.30
	フランス	11,529,228,408	3.08
	ドイツ	9,458,674,066	2.53
	オランダ	7,312,795,374	1.95
	アイルランド	6,880,572,327	1.84
	オーストラリア	6,454,798,458	1.72
	スウェーデン	4,038,681,980	1.08
	デンマーク	2,903,662,631	0.78
	スペイン	2,449,765,043	0.65
	香港	2,185,697,823	0.58
	イタリア	1,985,486,068	0.53
	ジャージー	1,449,916,141	0.39
	フィンランド	1,372,861,833	0.37
	シンガポール	968,205,662	0.26
	ベルギー	851,443,078	0.23
	バミューダ	841,133,998	0.22
	イスラエル	792,513,828	0.21
	ノルウェー	706,746,677	0.19
	ケイマン諸島	689,006,976	0.18
	ルクセンブルグ	320,312,735	0.09
	ニュージーランド	313,130,264	0.08
	オーストリア	256,608,239	0.07
	オランダ領キュラソー	250,469,231	0.07
	ポルトガル	164,555,111	0.04
	パナマ	115,153,795	0.03
	リベリア	106,972,717	0.03
	マン島	74,384,643	0.02
	小計	358,605,742,329	95.75
投資証券	アメリカ	7,562,956,950	2.02
	オーストラリア	836,856,085	0.22
	イギリス	235,347,219	0.06
	香港	163,008,518	0.04
	フランス	148,745,637	0.04
	シンガポール	140,847,520	0.04
	カナダ	36,690,604	0.01
	小計	9,124,452,533	2.44
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,800,403,881	1.81
合計（純資産総額）		374,530,598,743	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	イギリス	285,855,055	0.08

株価指数先物取引	買建	ドイツ	979,889,961	0.26
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,035,365,688	1.34
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	185,567,790	0.05
合計	買建	-	6,486,678,494	1.73
種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	1,227,673,242	0.33
為替予約取引	売建	-	250,513,107	0.07

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	2,781,789,279	14.30
	台湾	2,361,758,303	12.14
	韓国	1,954,678,997	10.05
	インド	1,869,705,745	9.61
	中国	965,636,564	4.96
	ブラジル	561,967,073	2.89
	南アフリカ	459,402,205	2.36
	タイ	252,447,864	1.30
	メキシコ	232,965,204	1.20
	インドネシア	220,488,820	1.13
	マレーシア	206,287,070	1.06
	香港	170,599,441	0.88
	フィリピン	109,629,358	0.56
	ポーランド	106,311,337	0.55
	バミューダ	78,780,212	0.40
	チリ	54,288,775	0.28
	アメリカ	48,262,541	0.25
	ハンガリー	33,920,634	0.17
	トルコ	33,822,927	0.17
	ギリシャ	31,565,339	0.16
	コロンビア	24,794,804	0.13
	チェコ	20,912,881	0.11
	エジプト	12,960,790	0.07
ルクセンブルグ	12,231,742	0.06	
マン島	4,446,531	0.02	
シンガポール	2,968,437	0.02	
ペルー	2,399,033	0.01	
小計		12,615,021,906	64.85
投資信託受益証券	香港	813,023,455	4.18
投資証券	アメリカ	1,382,417,909	7.11
	メキシコ	71,868,920	0.37
	ブラジル	24,174,440	0.12
	南アフリカ	6,263,642	0.03
	小計		1,484,724,911

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,540,719,084	23.34
合計(純資産総額)		19,453,489,356	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	4,676,366,414	24.04
合計	買建	-	4,676,366,414	24.04
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	-	3,501,944,130	18.00
為替予約取引	売建	-	28,297,578	0.15

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	76,545,418,851	47.16
	フランス	15,730,569,301	9.69
	イタリア	14,109,443,800	8.69
	ドイツ	11,729,315,833	7.23
	イギリス	9,631,095,111	5.93
	スペイン	9,395,406,808	5.79
	ベルギー	3,521,311,517	2.17
	カナダ	3,135,410,921	1.93
	オランダ	2,978,374,974	1.84
	オーストラリア	2,679,415,613	1.65
	オーストリア	2,223,248,160	1.37
	アイルランド	1,323,597,051	0.82
	メキシコ	1,155,183,876	0.71
	フィンランド	936,173,287	0.58
	ポーランド	774,120,111	0.48
	マレーシア	769,409,367	0.47
	イスラエル	763,703,702	0.47
	シンガポール	732,661,168	0.45
	中国	711,045,929	0.44
	デンマーク	710,630,635	0.44
スウェーデン	467,394,826	0.29	
ノルウェー	393,207,768	0.24	
小計	160,416,138,609	98.83	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,891,085,717	1.17
合計(純資産総額)		162,307,224,326	100.00

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	9,627,403,550	99.02

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	94,890,558	0.98
合計(純資産総額)		9,722,294,108	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 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	40,960,000	0.42
合計	買建	-	40,960,000	0.42

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	14,619,356,123	75.15
	オーストラリア	1,326,287,282	6.82
	イギリス	1,035,047,910	5.32
	シンガポール	605,486,217	3.11
	カナダ	351,207,370	1.81
	フランス	317,815,678	1.63
	香港	255,296,926	1.31
	ベルギー	248,538,336	1.28
	ニュージーランド	73,026,291	0.38
	スペイン	71,743,740	0.37
	ドイツ	55,331,369	0.28
	韓国	30,288,949	0.16
	オランダ	29,851,420	0.15
	ガーンジー	29,558,670	0.15
	アイルランド	18,836,516	0.10
	イスラエル	13,745,319	0.07
イタリア	4,333,514	0.02	
小計		19,085,751,630	98.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	368,075,035	1.89
合計(純資産総額)		19,453,826,665	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	-	112,302,276	0.58

(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)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,798,800	2,003.64	7,611,431,836	2,105.50	7,998,373,400	3.84

日本	株式	ソニーグループ	電気機器	469,800	13,823.69	6,494,368,309	14,475.00	6,800,355,000	3.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	68,000	70,378.11	4,785,711,297	72,280.00	4,915,040,000	2.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	552,900	6,900.72	3,815,407,059	6,972.00	3,854,818,800	1.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	47,600	59,853.01	2,849,003,312	66,280.00	3,154,928,000	1.51
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,639,100	602.24	2,793,841,840	624.90	2,898,973,590	1.39
日本	株式	日本電産	電気機器	194,400	13,010.08	2,529,159,528	13,520.00	2,628,288,000	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	126,100	19,014.01	2,397,666,480	19,920.00	2,511,912,000	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	146,400	18,010.78	2,636,778,312	17,110.00	2,504,904,000	1.20
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,500	23,223.54	2,217,848,291	26,090.00	2,491,595,000	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	770,400	3,126.11	2,408,355,820	3,150.00	2,426,760,000	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	441,400	6,015.57	2,655,274,485	5,434.00	2,398,567,600	1.15
日本	株式	任天堂	その他製品	42,300	50,152.33	2,121,443,661	53,650.00	2,269,395,000	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	360,700	6,683.50	2,410,739,209	6,230.00	2,247,161,000	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	553,100	3,396.28	1,878,479,861	3,652.00	2,019,921,200	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	511,900	3,708.30	1,898,277,375	3,943.00	2,018,421,700	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	220,300	8,394.82	1,849,379,066	9,157.00	2,017,287,100	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	590,200	3,103.59	1,831,739,823	3,230.00	1,906,346,000	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	589,400	3,033.23	1,787,785,508	3,137.00	1,848,947,800	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	516,100	3,265.25	1,685,197,034	3,518.00	1,815,639,800	0.87
日本	株式	KDDI	情報・通信業	536,500	3,301.74	1,771,385,092	3,362.00	1,803,713,000	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	589,300	2,825.16	1,664,866,746	2,925.00	1,723,702,500	0.83
日本	株式	S M C	機械	22,000	72,748.77	1,600,472,871	77,590.00	1,706,980,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	84,700	17,870.78	1,513,654,759	19,395.00	1,642,756,500	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,115,100	1,560.97	1,740,635,478	1,454.50	1,621,912,950	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	65,800	22,285.33	1,466,374,728	24,380.00	1,604,204,000	0.77
日本	株式	デンソー	輸送用機器	165,000	8,350.77	1,377,876,890	9,529.00	1,572,285,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	573,300	2,558.25	1,466,645,929	2,723.50	1,561,382,550	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	243,500	5,719.87	1,392,788,718	6,392.00	1,556,452,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	288,700	4,564.05	1,317,640,331	5,056.00	1,459,667,200	0.70

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式(国内)	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.23
	建設業	2.17
	食料品	3.20
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.20
	化学	6.62
	医薬品	4.69
	石油・石炭製品	0.39
	ゴム製品	0.67
	ガラス・土石製品	0.77
	鉄鋼	0.73
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.62
	機械	5.44
	電気機器	19.76
	輸送用機器	7.96
	精密機器	2.85
	その他製品	2.18
	電気・ガス業	1.04
	陸運業	2.87
	海運業	0.51
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.83
	卸売業	5.18
	小売業	4.00
	銀行業	4.65
証券、商品先物取引業	0.72	
保険業	1.93	
その他金融業	1.12	
不動産業	1.80	
サービス業	6.18	
合計	98.10	

2.2.5 マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	130,000	56,194.17	7,305,241,650	66,280.00	8,616,400,000	7.95
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	130,000	75,310.93	9,790,421,410	65,310.00	8,490,300,000	7.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	780,000	6,503.63	5,072,832,540	5,434.00	4,238,520,000	3.91

日本	株式	ダイキン工業	機械	130,000	25,165.62	3,271,530,770	26,090.00	3,391,700,000	3.13
日本	株式	ファナック	電気機器	130,000	22,252.47	2,892,820,620	24,380.00	3,169,400,000	2.92
日本	株式	アドバンテス ト	電気機器	260,000	9,896.00	2,572,960,500	10,900.00	2,834,000,000	2.62
日本	株式	リクルート ホールディ ングス	サービ ス業	390,000	7,765.35	3,028,488,030	6,972.00	2,719,080,000	2.51
日本	株式	K D D I	情報・通 信業	780,000	3,409.86	2,659,692,480	3,362.00	2,622,360,000	2.42
日本	株式	信越化学工業	化学	130,000	19,840.31	2,579,240,380	19,920.00	2,589,600,000	2.39
日本	株式	テルモ	精密機器	520,000	4,748.92	2,469,436,440	4,860.00	2,527,200,000	2.33
日本	株式	ソニーグル ープ	電気機器	130,000	13,726.54	1,784,450,260	14,475.00	1,881,750,000	1.74
日本	株式	京セラ	電気機器	260,000	6,922.46	1,799,840,440	7,187.00	1,868,620,000	1.72
日本	株式	エムスリー	サービ ス業	312,000	6,320.61	1,972,029,840	5,793.00	1,807,416,000	1.67
日本	株式	T D K	電気機器	390,000	4,469.69	1,743,180,450	4,490.00	1,751,100,000	1.62
日本	株式	エヌ・ティ ・ティ・デー タ	情報・通 信業	650,000	2,416.01	1,570,405,350	2,466.00	1,602,900,000	1.48
日本	株式	オムロン	電気機器	130,000	11,131.89	1,447,145,340	11,460.00	1,489,800,000	1.37
日本	株式	中外製薬	医薬品	390,000	4,056.79	1,582,146,270	3,735.00	1,456,650,000	1.34
日本	株式	オリンパス	精密機器	520,000	2,564.94	1,333,766,200	2,649.50	1,377,740,000	1.27
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	650,000	2,007.70	1,305,002,700	2,105.50	1,368,575,000	1.26
日本	株式	キッコーマン	食料品	130,000	9,224.00	1,199,120,150	9,670.00	1,257,100,000	1.16
日本	株式	デンソー	輸送用機 器	130,000	8,260.86	1,073,911,170	9,529.00	1,238,770,000	1.14
日本	株式	アステラス製 薬	医薬品	650,000	1,961.49	1,274,967,850	1,870.50	1,215,825,000	1.12
日本	株式	バンダイナム コホールディ ングス	その他製 品	130,000	9,267.27	1,204,745,150	8,994.00	1,169,220,000	1.08
日本	株式	日東電工	化学	130,000	8,532.00	1,109,160,240	8,890.00	1,155,700,000	1.07
日本	株式	第一三共	医薬品	390,000	2,765.68	1,078,615,620	2,925.00	1,140,750,000	1.05
日本	株式	富士フイルム ホールディ ングス	化学	130,000	9,095.57	1,182,424,070	8,526.00	1,108,380,000	1.02
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	130,000	7,216.89	938,196,160	8,125.00	1,056,250,000	0.97
日本	株式	セコム	サービ ス業	130,000	7,678.59	998,217,150	7,986.00	1,038,180,000	0.96
日本	株式	村田製作所	電気機器	104,000	8,432.38	876,967,408	9,157.00	952,328,000	0.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	13,000	70,690.39	918,975,128	72,280.00	939,640,000	0.87

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.05
	建設業	1.51
	食料品	3.59
	繊維製品	0.13

パルプ・紙	0.08
化学	7.54
医薬品	6.69
石油・石炭製品	0.19
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	1.01
鉄鋼	0.07
非鉄金属	0.76
金属製品	0.03
機械	5.05
電気機器	26.76
輸送用機器	4.61
精密機器	3.81
その他製品	2.71
電気・ガス業	0.13
陸運業	1.24
海運業	0.29
空運業	0.03
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	10.19
卸売業	2.18
小売業	9.26
銀行業	0.52
証券、商品先物取引業	0.23
保険業	0.69
その他金融業	0.45
不動産業	1.05
サービス業	6.12
合計	97.92

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)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノ ロ ジー・ ハード ウェア および 機器	900,643	18,453.08	16,619,636,753	20,632.29	18,582,325,400	4.96
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービ ス	389,149	38,704.37	15,061,764,948	39,331.09	15,305,653,953	4.09

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	24,855	409,292.65	10,172,968,885	389,229.98	9,674,311,162	2.58
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	45,934	130,470.58	5,993,035,653	124,933.57	5,738,698,778	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,412	334,684.99	5,492,850,051	337,365.16	5,536,837,038	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,698	336,088.84	5,275,922,599	337,018.95	5,290,523,505	1.41
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	130,127	38,873.29	5,058,464,088	39,444.96	5,132,854,153	1.37
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	136,508	38,299.93	5,228,246,387	34,507.15	4,710,502,059	1.26
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	51,407	52,034.88	2,674,957,320	58,151.81	2,989,410,178	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	163,158	18,540.72	3,025,066,941	18,237.57	2,975,605,641	0.79
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	143,947	18,396.15	2,648,070,045	19,731.68	2,840,316,284	0.76
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	57,649	46,785.60	2,697,142,798	47,254.82	2,724,192,933	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	132,439	17,151.66	2,271,548,253	18,885.13	2,501,128,235	0.67
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,405	32,473.03	2,351,210,057	34,443.89	2,493,909,797	0.67
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	153,567	15,108.83	2,320,218,243	16,140.04	2,478,577,276	0.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	92,369	22,602.49	2,087,769,317	25,093.91	2,317,899,686	0.62

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	414,671	5,240.54	2,173,101,696	5,133.34	2,128,648,309	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,612	91,889.28	2,077,800,426	91,813.79	2,076,093,306	0.55
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	305,400	6,032.02	1,842,179,394	6,622.85	2,022,618,878	0.54
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	48,256	37,181.76	1,794,242,956	41,555.58	2,005,305,865	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	38,499	44,977.53	1,731,590,002	47,901.98	1,844,178,482	0.49
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	99,447	17,003.77	1,690,973,465	17,813.15	1,771,464,069	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	22,497	65,038.77	1,463,177,142	77,363.60	1,740,448,958	0.46
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	26,092	78,950.33	2,059,971,964	65,479.74	1,708,497,266	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	24,263	76,226.68	1,849,487,977	70,224.31	1,703,852,452	0.45
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	231,143	6,417.73	1,483,413,813	7,356.68	1,700,444,900	0.45
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	34,789	42,087.05	1,464,166,252	47,781.61	1,662,274,374	0.44

アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	21,497	74,591.85	1,603,501,095	76,227.20	1,638,656,217	0.44
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネル ギー	231,724	7,084.00	1,641,531,764	7,033.47	1,629,824,497	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・ 生活必 需品小 売り	24,247	63,804.24	1,547,061,499	65,304.91	1,583,448,041	0.42

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	3.23
	素材	4.03
	資本財	6.00
	商業・専門サービス	1.26
	運輸	1.88
	自動車・自動車部品	2.49
	耐久消費財・アパレル	1.88
	消費者サービス	1.78
	小売	5.42
	食品・生活必需品小売り	1.41
	食品・飲料・タバコ	3.65
	家庭用品・パーソナル用品	1.71
	ヘルスケア機器・サービス	4.70
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	7.86
	銀行	5.72
	各種金融	4.61
	保険	2.80
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	12.05
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.56
半導体・半導体製造装置	5.32	
電気通信サービス	1.39	
公益事業	2.77	
メディア・娯楽	6.84	
投資証券	-	2.44
合計		98.18

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）

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	411,000	2,469.95	1,015,150,994	2,562.44	1,053,161,524	5.41
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	901,400	892.5438	804,538,946	901.9564	813,023,455	4.18
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	96,300	6,815.46	656,329,229	6,560.80	631,805,040	3.25
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	79,880	7,017.45	560,554,024	7,667.24	612,459,131	3.15
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	-	108,054	5,129.58	554,271,621	4,888.35	528,205,770	2.72
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	104,586	4,546.22	475,471,419	4,716.97	493,329,045	2.54
ケイマ ン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	253,800	1,910.65	484,923,153	1,631.35	414,036,630	2.13
ケイマ ン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	68,500	3,594.03	246,191,206	3,186.00	218,241,000	1.12
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	47,846	3,784.48	181,072,279	3,723.88	178,172,523	0.92
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフト ウェア・ サービス	56,914	2,634.04	149,913,861	2,922.60	166,336,998	0.86
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	85,422	1,881.70	160,738,962	1,864.47	159,267,115	0.82
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,610,000	74.86	120,516,742	79.80	128,473,975	0.66
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・ 半導体製 造装置	25,000	4,269.22	106,730,380	4,929.36	123,234,075	0.63
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	48,609	2,325.02	113,016,965	2,361.36	114,783,377	0.59
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	28,669	4,203.25	120,502,846	3,973.50	113,916,343	0.59
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	9,135	11,251.25	102,780,137	12,357.10	112,882,108	0.58
ケイマ ン諸島	株式	JD.COM INC - CL A	小売	28,900	5,055.17	146,094,514	3,764.20	108,785,380	0.56

ブラジル	株式	VALE SA	素材	67,788	1,407.79	95,430,976	1,558.84	105,670,339	0.54
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	85,666	1,114.99	95,516,896	1,140.34	97,687,938	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	13,861	6,366.32	88,243,587	6,976.41	96,700,019	0.50
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	208,800	430.67	89,923,082	436.78	91,199,455	0.47
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	106,500	815.45	86,845,654	837.80	89,225,700	0.46
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	15,447	5,442.95	84,077,180	5,726.79	88,461,647	0.45
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	22,739	3,964.13	90,140,361	3,818.66	86,832,600	0.45
ケイマン諸島	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,500	1,569.72	94,968,162	1,289.89	78,038,193	0.40
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	2,078	37,507.45	77,940,478	37,168.60	77,236,350	0.40
ケイマン諸島	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	22,908	4,623.86	105,923,272	3,249.32	74,435,308	0.38
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	33,500	2,600.14	87,104,760	2,212.50	74,118,750	0.38
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,645	17,280.97	80,270,121	15,677.23	72,820,714	0.37
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	580,900	104.13	60,487,425	121.03	70,307,581	0.36

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	2.62
	素材	4.87
	資本財	1.84
	商業・専門サービス	0.07
	運輸	1.25
	自動車・自動車部品	2.73
	耐久消費財・アパレル	1.24
	消費者サービス	0.68
	小売	5.11

	食品・生活必需品小売り	0.85
	食品・飲料・タバコ	1.97
	家庭用品・パーソナル用品	0.69
	ヘルスケア機器・サービス	0.60
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.17
	銀行	7.74
	各種金融	1.50
	保険	1.91
	不動産	1.20
	ソフトウェア・サービス	2.23
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.86
	半導体・半導体製造装置	7.88
	電気通信サービス	1.74
	公益事業	1.62
	メディア・娯楽	5.48
投資信託受益証券	-	4.18
投資証券	-	7.63
合計		76.66

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)

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	14,950,000	11,730.20	1,753,664,852	11,687.07	1,747,216,543	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,037.53	1,600,991,904	11,988.07	1,594,413,911	2.250	2026/03/31	0.98
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,609.87	1,134,888,537	12,519.12	1,126,720,967	2.875	2028/05/15	0.69
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,152.55	1,032,967,015	12,104.93	1,028,919,461	2.500	2026/02/28	0.63
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,245.85	955,897,289	11,136.70	946,619,200	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,800,000	10,801.99	950,574,968	10,700.89	941,677,941	0.625	2030/08/15	0.58
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,420.57	913,645,267	11,407.11	912,568,680	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,461.97	882,571,924	11,445.76	881,323,151	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,365.36	875,132,430	11,349.60	873,919,084	0.125	2024/02/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,800,000	10,937.60	853,132,555	10,871.12	847,946,993	0.375	2027/09/30	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,100,000	11,617.02	824,808,420	11,561.24	820,847,706	1.375	2026/08/31	0.51

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	10,825.34	811,900,300	10,728.26	804,619,534	0.625	2030/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	11,061.59	796,434,366	10,991.54	791,390,969	0.625	2027/12/31	0.49
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	13,536.11	785,094,128	13,356.39	774,670,817	0.000	2030/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	11,862.70	771,075,676	11,837.51	769,438,367	2.125	2024/03/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,016.73	771,171,143	10,913.33	763,932,934	0.875	2030/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	14,216.59	767,695,699	13,963.20	754,012,689	3.000	2048/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	11,135.32	746,066,188	11,058.02	740,887,527	0.750	2028/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	11,776.90	730,167,663	11,748.60	728,413,378	1.750	2024/06/30	0.45
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000	15,971.55	702,748,322	15,763.78	693,606,357	3.500	2030/03/01	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,527.07	691,624,461	11,440.35	686,420,956	1.375	2028/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,977.26	682,703,970	11,947.24	680,992,817	2.500	2024/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	11,971.51	670,404,651	11,937.35	668,491,639	2.375	2024/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,262.87	664,509,531	11,183.85	659,847,426	1.000	2028/07/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,501.08	667,062,630	11,271.04	653,720,310	1.875	2051/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,403.54	650,001,944	11,386.98	649,057,860	0.125	2023/10/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,703.29	643,680,675	11,673.15	642,023,236	1.500	2024/10/31	0.40
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,237.63	635,406,206	13,219.10	634,516,650	0.000	2024/03/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,010.04	612,512,210	11,982.21	611,092,633	2.750	2024/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,950.35	609,467,745	11,916.65	607,749,002	2.250	2024/11/15	0.37

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.83
合計	98.83

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）

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	961	701,242.41	673,893,957	670,000.00	643,870,000	6.62
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,388	378,059.81	524,747,017	407,000.00	564,916,000	5.81
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	848	661,192.30	560,691,070	653,000.00	553,744,000	5.70
日本	投資証券	G L P 投資法人	2,748	191,150.63	525,281,920	198,900.00	546,577,200	5.62
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,274	318,587.18	405,880,065	348,500.00	443,989,000	4.57
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	2,744	166,721.53	457,483,874	161,800.00	443,979,200	4.57
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4,283	105,697.61	452,702,849	99,100.00	424,445,300	4.37
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	848	361,390.10	306,458,803	380,000.00	322,240,000	3.31
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,691	193,781.99	327,685,337	179,800.00	304,041,800	3.13
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,205	211,421.68	254,763,127	222,100.00	267,630,500	2.75
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,912	150,180.74	287,145,575	135,200.00	258,502,400	2.66
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	558	401,717.58	224,158,409	399,000.00	222,642,000	2.29
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,578	90,653.18	233,703,895	85,700.00	220,934,600	2.27
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,040	191,267.97	198,918,687	202,600.00	210,704,000	2.17
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	315	609,765.76	192,076,214	645,000.00	203,175,000	2.09
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	554	337,903.41	187,198,489	356,500.00	197,501,000	2.03
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	293	655,290.67	192,000,165	663,000.00	194,259,000	2.00
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	453	447,327.38	202,639,301	416,000.00	188,448,000	1.94
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	263	756,788.33	199,035,330	711,000.00	186,993,000	1.92
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,000	150,355.93	150,355,934	161,100.00	161,100,000	1.66

日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,000	155,839.52	155,839,515	156,100.00	156,100,000	1.61
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	297	479,800.16	142,500,649	497,000.00	147,609,000	1.52
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,605	62,416.11	162,593,955	56,200.00	146,401,000	1.51
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	792	181,111.57	143,440,364	173,100.00	137,095,200	1.41
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,745	40,443.80	151,462,035	36,400.00	136,318,000	1.40
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,150	117,455.05	135,073,312	118,500.00	136,275,000	1.40
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	381	340,749.28	129,825,477	341,500.00	130,111,500	1.34
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	581	224,729.53	130,567,857	222,300.00	129,156,300	1.33
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	814	152,897.02	124,458,176	155,200.00	126,332,800	1.30
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	180	755,797.59	136,043,567	700,000.00	126,000,000	1.30

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.02
合計	99.02

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)

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	72,662	15,278.38	1,110,157,531	19,286.55	1,401,399,557	7.20
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	8,825	94,242.03	831,685,922	96,846.84	854,673,363	4.39
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	14,958	36,753.28	549,755,512	42,858.75	641,081,218	3.30
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	32,378	15,544.89	503,312,588	18,260.58	591,240,903	3.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	27,815	18,559.24	516,225,153	20,158.41	560,706,040	2.88
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	55,353	7,878.88	436,119,531	8,269.94	457,765,878	2.35
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	42,606	9,711.93	413,786,308	9,789.35	417,085,139	2.14

アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,828	25,746.71	356,025,573	29,048.30	401,679,906	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	168,331	1,930.86	325,024,063	2,230.65	375,487,679	1.93
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,802	23,561.51	325,195,944	25,715.02	354,918,725	1.82
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	33,460	9,469.90	316,862,821	10,415.06	348,487,941	1.79
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,988	20,710.97	268,994,130	25,927.81	336,750,375	1.73
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	57,887	4,632.92	268,185,613	5,195.45	300,749,210	1.55
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,259	21,673.12	244,017,668	26,260.22	295,663,774	1.52
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	37,662	5,807.09	218,706,444	7,492.40	282,178,874	1.45
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	11,470	22,662.28	259,936,336	24,201.36	277,589,578	1.43
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,380	36,517.48	232,981,501	40,511.19	258,461,418	1.33
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	117,406	1,996.17	234,362,246	2,199.75	258,263,942	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	39,304	6,251.99	245,728,055	5,828.06	229,066,203	1.18
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,677	4,039.12	216,807,759	4,152.22	222,878,820	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	61,008	3,382.70	206,372,029	3,387.34	206,654,777	1.06
香港	投資証券	LINK REIT	203,100	1,066.25	216,554,508	1,002.26	203,559,513	1.05
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	9,913	16,676.67	165,315,878	20,434.45	202,566,734	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	28,192	6,060.75	170,864,664	6,880.50	193,974,954	1.00
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	13,850	13,157.63	182,233,203	13,294.01	184,122,060	0.95
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	18,469	8,843.25	163,325,968	9,552.41	176,423,478	0.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	28,888	5,311.08	153,426,576	6,068.46	175,305,533	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,832	9,511.76	160,101,894	10,061.95	169,362,735	0.87
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	60,030	2,511.91	150,790,146	2,789.24	167,437,777	0.86
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	59,289	2,342.22	138,868,147	2,685.72	159,233,475	0.82

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

投資証券	98.11
合計	98.11

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。

2 2 5 マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

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。

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。

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)

2021年12月30日現在

種類	地域	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	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0403 月 2022年 3月	買建	197	日本・円	3,901,456,700	3,924,240,000	1.88

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2 2 5 マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	地域	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	日本	大阪取引 所	NK22 5 先 物 0403 月 2022年 3月	買建	78	日本・円	2,207,495,800	2,244,840,000	2.07

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又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

2021年12月30日現在

種類	地域	取引 所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E- EU	F T S E 1 0 O I D X F U T M A R 2 2 2022年3月	買建	25	イギリ ス・ポ ンド	1,799,895.00	279,415,699	1,841,375.00	285,855,055	0.08
	ドイ ツ	EU RE X	EUR O S T O X X 5 0 M A R 2 2 2022年3月	買建	176	ユーロ	7,332,989.50	957,028,459	7,508,160.00	979,889,961	0.26
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T M A R 2 2 2022年3月	買建	183	アメリ カ・ド ル	42,868,561.50	4,930,741,943	43,778,175.00	5,035,365,688	1.34
	オー スト ラリ ア	シド ニー 先物 取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M A R 2 2 2022年 3月	買建	12	オー スト ラリ ア・ド ル	2,183,654.00	182,160,416	2,224,500.00	185,567,790	0.05

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	7,820,000.00	898,427,698	899,415,083	0.24
	ユーロ	買建	900,000.00	117,032,385	117,470,152	0.03
	イギリス・ポンド	買建	300,000.00	46,305,936	46,569,828	0.01
	カナダ・ドル	買建	490,000.00	43,965,815	44,117,027	0.01
	スイス・フラン	買建	330,000.00	41,350,305	41,505,450	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	320,000.00	26,599,105	26,694,400	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	1,370,000.00	17,360,015	17,456,229	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	660,000.00	11,540,769	11,589,600	0.00
	香港・ドル	買建	730,000.00	10,755,410	10,767,500	0.00
	シンガポール・ドル	買建	60,000.00	5,088,326	5,108,258	0.00
	イスラエル・シェケル	買建	90,000.00	3,323,280	3,315,700	0.00
	ノルウェー・クローネ	買建	220,000.00	2,864,039	2,877,209	0.00
	ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	781,930	786,806	0.00
	アメリカ・ドル	売建	1,480,000.00	170,212,284	170,219,832	0.05
ユーロ	売建	240,000.00	31,329,960	31,326,072	0.01	

イギリス・ポンド	売建	90,000.00	13,971,420	13,970,817	0.00
カナダ・ドル	売建	110,000.00	9,903,069	9,903,674	0.00
スイス・フラン	売建	70,000.00	8,804,775	8,804,425	0.00
オーストラリア・ドル	売建	70,000.00	5,840,009	5,839,400	0.00
スウェーデン・クローナ	売建	260,000.00	3,313,700	3,312,894	0.00
香港・ドル	売建	180,000.00	2,654,982	2,655,000	0.00
デンマーク・クローネ	売建	100,000.00	1,755,410	1,756,000	0.00
シンガポール・ドル	売建	20,000.00	1,702,308	1,702,694	0.00
ノルウェー・クローネ	売建	50,000.00	653,860	653,890	0.00
イスラエル・シケル	売建	10,000.00	367,985	368,409	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

2021年12月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ICE - US	MSCI EM GMTMA R22 2022年3月	買建	667	アメリカ・ドル	40,301,817.00	4,635,514,991	40,656,985.00	4,676,366,414	24.04

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年12月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	30,467,928.85	3,457,900,000	3,501,944,130	18.00
	アメリカ・ドル	売建	246,197.13	28,000,000	28,297,578	0.15

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	日本	大阪取引所	TREIT先物 0403 月 2022年 3月	買建	20	日本・円	40,136,400	40,960,000	0.42

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	634,736.80	73,000,000	73,003,237	0.38
	オーストラリア・ドル	買建	185,787.38	15,500,000	15,498,383	0.08
	ユーロ	買建	72,773.79	9,500,000	9,498,820	0.05
	シンガポール・ドル	買建	79,891.54	6,800,000	6,801,542	0.03
	カナダ・ドル	買建	49,984.50	4,500,000	4,500,274	0.02
	香港・ドル	買建	203,391.21	3,000,000	3,000,020	0.02

(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:2021年12月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移

■TOPIXインデックス



※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
2021年11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。

■225インデックス



※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
2021年11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。

■先進国株インデックス



※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
2021年11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。

■新興国株インデックス



※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
2021年11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。

■先進国債インデックス



※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
2021年11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。

■Jリートインデックス



※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
2021年11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。

■Gリートインデックス



※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
2021年11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

■TOPIXインデックス

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	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.02

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.90
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て1.88%

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	3.84
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.51
日本	株式	三井FJフィナンシャルグループ	銀行業	1.39
日本	株式	日本電産	電気機器	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	1.20
日本	株式	ダイキン工業	機械	1.20

■225インデックス

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	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
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	225マザーファンド	100.03

■225マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.08
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て2.07%

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	東京エレクトロン	電気機器	7.95
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	7.84
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.91
日本	株式	ダイキン工業	機械	3.13
日本	株式	ファナック	電気機器	2.92
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	2.62
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2.51
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2.42
日本	株式	信越化学工業	化学	2.39
日本	株式	テルモ	精密機器	2.33

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■先進国株インデックス

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	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
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	外国株式インデックス・マザーファンド	100.03

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	67.84
	イギリス	3.96
	カナダ	3.43
	スイス	3.30
	フランス	3.08
	ドイツ	2.53
	その他	11.61
投資証券	アメリカ・その他	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.81
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	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.96
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.09
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.58
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.41
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.37
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.26
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.79

※株価指数先物取引の買建て1.73%

■新興国株インデックス

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	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
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	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100.02

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	14.30
	台湾	12.14
	韓国	10.05
	インド	9.61
	その他	18.75
投資証券	アメリカ	7.11
	その他	0.53
投資信託受益証券	香港	4.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23.34
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	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.41
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-ONV	-	4.18
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.25
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	3.15
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	-	2.72
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	2.54
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	2.13
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	1.12
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	0.92
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	0.86

※株価指数先物取引の買建て24.04%

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■先進国債インデックス

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	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
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	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.01

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	47.16
	フランス	9.69
	イタリア	8.69
	ドイツ	7.23
	イギリス	5.93
	スペイン	5.79
	ベルギー	2.17
	その他	12.17
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/08/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2023/06/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	0.52

■Jリートインデックス

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	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
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	Jリート・インデックス・マザーファンド	100.01

■Jリート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	99.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.98
合計(純資産総額)		100.00

※リート指数先物取引の買建て0.42%

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	6.62
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	5.81
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.70
日本	投資証券	GLP投資法人	5.62
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.57
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.57
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.37
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.31
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.13
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2.75

■Gリートインデックス

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	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
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	外国リート・インデックス・マザーファンド	100.01

■外国リート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	75.15
	オーストラリア	6.82
	イギリス	5.32
	シンガポール	3.11
	カナダ	1.81
	フランス	1.63
	香港	1.31
	その他	2.96
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

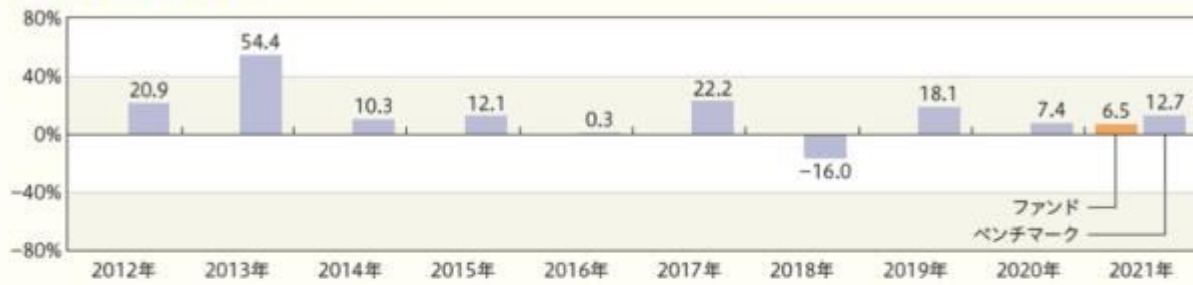
国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	7.20
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.39
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.30
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.88
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2.35
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.06
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.93
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.82

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

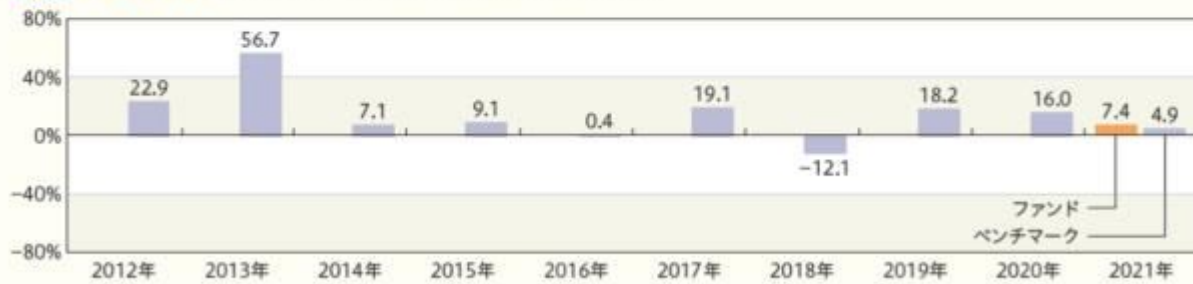
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■TOPIXインデックス(ベンチマーク:TOPIX(東証株価指数、配当込み))



■225インデックス(ベンチマーク:日経平均株価(日経225))



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

※2021年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2021年8月23日)から年末までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

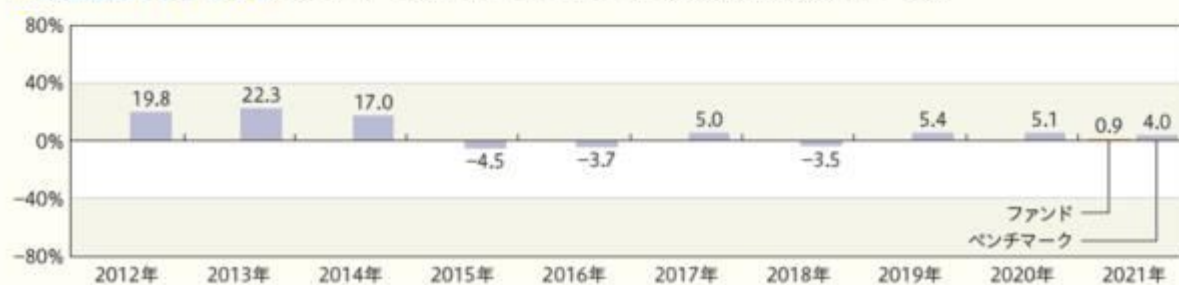
■先進国株インデックス(ベンチマーク:MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース))



■新興国株インデックス(ベンチマーク: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))



■先進国債インデックス(ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース))



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りと異なります。

※2021年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2021年8月23日)から年末までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



■Gリートインデックス(ベンチマーク:S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))



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

※2021年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2021年8月23日)から年末までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(4)【計算期間】

<更新後>

毎年12月1日から翌年11月30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。

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

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（2021年 8月23日から2021年 11月30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D S・T O P I Xインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)	
第1期 (2021年11月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	6,051,301
流動資産合計	6,051,301
資産合計	6,051,301
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	268
未払委託者報酬	4,663
その他未払費用	21
流動負債合計	4,952
負債合計	4,952
純資産の部	
元本等	
元本	5,873,388
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	172,961
(分配準備積立金)	13,736
元本等合計	6,046,349
純資産合計	6,046,349
負債純資産合計	6,051,301

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)	
第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日	
営業収益	
有価証券売買等損益	104,008
営業収益合計	104,008
営業費用	
受託者報酬	268
委託者報酬	4,663
その他費用	21

第1期	
自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日	
営業費用合計	4,952
営業利益又は営業損失（ ）	108,960
経常利益又は経常損失（ ）	108,960
当期純利益又は当期純損失（ ）	108,960
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（ ）	117,673
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	744,703
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	744,703
剰余金減少額又は欠損金増加額	345,109
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	345,109
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（ ）	172,961

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期
	（2021年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,873,388口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0294円 (1万口当たりの純資産額10,294円)
----------------	---

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,736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(159,225円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は172,961円(1万口当たり294.48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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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る場合、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 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	219,001円
合計	219,001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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	10,131,313円
期中一部解約元本額	5,257,925円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザー ファンド(B号)	1,878,586	6,051,301	
	親投資信託受益証券 小計		6,051,301	
合 計			6,051,301	

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D S・日経225インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2021年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		69,557,660
流動資産合計		69,557,660
資産合計		69,557,660
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		2,295
未払委託者報酬		38,037
その他未払費用		524
流動負債合計		40,856
負債合計		40,856
純資産の部		
元本等		
元本		67,088,151
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		2,428,653
(分配準備積立金)		173,689
元本等合計		69,516,804
純資産合計		69,516,804
負債純資産合計		69,557,660

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益		3,544,012
営業収益合計		3,544,012
営業費用		
受託者報酬		2,295
委託者報酬		38,037
その他費用		524
営業費用合計		40,856
営業利益又は営業損失()		3,584,868
経常利益又は経常損失()		3,584,868
当期純利益又は当期純損失()		3,584,868
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()		30,095
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		6,085,896
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		6,085,896
剰余金減少額又は欠損金増加額		102,470
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		102,470

第1期
自 2021年 8月23日
至 2021年11月30日

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（ ）	2,428,653

（3）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,088,151口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0362円 (1万口当たりの純資産額10,362円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（173,689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（2,254,964円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は2,428,653円（1万口当たり362.01円）であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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る場合、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 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,520,643円
合計	3,520,643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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	67,267,713円
期中一部解約元本額	1,179,562円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	2 2 5 マザーファンド	19,228,634	69,557,660	
	親投資信託受益証券 小計		69,557,660	
合 計			69,557,660	

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D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2021年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		74,627,082
流動資産合計		74,627,082
資産合計		74,627,082
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,930
未払委託者報酬		39,784
その他未払費用		539
流動負債合計		42,253
負債合計		42,253
純資産の部		
元本等		
元本		70,018,428
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()		4,566,401
(分配準備積立金)		1,578,993
元本等合計		74,584,829
純資産合計		74,584,829
負債純資産合計		74,627,082

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益		1,764,416
営業収益合計		1,764,416
営業費用		
受託者報酬		1,930
委託者報酬		39,784
その他費用		539
営業費用合計		42,253
営業利益又は営業損失 ()		1,722,163
経常利益又は経常損失 ()		1,722,163
当期純利益又は当期純損失 ()		1,722,163
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 ()		143,170
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		3,061,837
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		3,061,837
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,429
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,429
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		-

第1期
自 2021年 8月23日
至 2021年11月30日

期末剰余金又は期末欠損金() 4,566,401

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,018,428口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0652円 (1万口当たりの純資産額10,652円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(139,167円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,439,826円)、収益調整金(2,987,408円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は4,566,401円(1万口当たり652.17円)であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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る場合、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 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,625,367円
合計	1,625,367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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	71,990,426円
期中一部解約元本額	2,971,998円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザー ファンド	12,792,410	74,627,082	
	親投資信託受益証券 小計		74,627,082	
合 計			74,627,082	

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D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)	
第1期 (2021年11月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	3,026,951
流動資産合計	3,026,951
資産合計	3,026,951
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	93
未払委託者報酬	2,355
流動負債合計	2,448
負債合計	2,448
純資産の部	
元本等	
元本	2,960,151
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	64,352
(分配準備積立金)	4,096
元本等合計	3,024,503
純資産合計	3,024,503
負債純資産合計	3,026,951

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)	
第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日	
営業収益	
有価証券売買等損益	67,098
営業収益合計	67,098
営業費用	
受託者報酬	93
委託者報酬	2,355
営業費用合計	2,448
営業利益又は営業損失 ()	69,546
経常利益又は経常損失 ()	69,546
当期純利益又は当期純損失 ()	69,546
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 ()	-
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	133,898
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	133,898
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	64,352

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,960,151口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0217円 (1万口当たりの純資産額10,217円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,096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(60,256円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は64,352円(1万口当たり217.39円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日

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

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	67,098円
合計	67,098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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,960,151円
期中一部解約元本額	-円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	1,807,891	3,026,951	
	親投資信託受益証券 小計		3,026,951	
合計			3,026,951	

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D S ・先進国債インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第1期
(2021年11月30日現在)

資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		6,791,702
流動資産合計		6,791,702
資産合計		6,791,702
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		339
未払委託者報酬		4,253
その他未払費用		51
流動負債合計		4,643
負債合計		4,643
純資産の部		
元本等		
元本		6,762,046
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		25,013
(分配準備積立金)		28,398
元本等合計		6,787,059
純資産合計		6,787,059
負債純資産合計		6,791,702

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益		30,456
営業収益合計		30,456
営業費用		
受託者報酬		339
委託者報酬		4,253
その他費用		51
営業費用合計		4,643
営業利益又は営業損失（ ）		25,813
経常利益又は経常損失（ ）		25,813
当期純利益又は当期純損失（ ）		25,813
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（ ）		-
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		-
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		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		800
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		800
分配金		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		25,013

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,762,046口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30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（28,398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（3,046円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は31,444円（1万口当たり46.50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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価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る場合、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 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	30,456円
合計	30,456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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	5,762,046円
期中一部解約元本額	-円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	3,423,237	6,791,702	
	親投資信託受益証券 小計		6,791,702	
合 計			6,791,702	

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D S ・国内リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2021年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		2,143,958
流動資産合計		2,143,958
資産合計		2,143,958
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		98
未払委託者報酬		1,577
流動負債合計		1,675
負債合計		1,675
純資産の部		
元本等		
元本		2,251,882
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()		109,599
(分配準備積立金)		14,855
元本等合計		2,142,283
純資産合計		2,142,283
負債純資産合計		2,143,958

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益		104,093
営業収益合計		104,093
営業費用		
受託者報酬		98
委託者報酬		1,577
営業費用合計		1,675
営業利益又は営業損失 ()		105,768
経常利益又は経常損失 ()		105,768
当期純利益又は当期純損失 ()		105,768
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 ()		575
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		-
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		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,256
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		471
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,785
分配金		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		109,599

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,251,882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 109,599円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9513円 (1万口当たりの純資産額9,513円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,855円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,305円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は16,160円(1万口当たり71.76円)であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	104,511円
合計	104,511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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,350,609円
期中一部解約元本額	98,727円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	Jリート・インデックス・マ ザーファンド	812,567	2,143,958	
	親投資信託受益証券 小計		2,143,958	
合 計			2,143,958	

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D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)	
第1期 (2021年11月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	2,307,225
流動資産合計	2,307,225
資産合計	2,307,225
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	96
未払委託者報酬	2,375
流動負債合計	2,471
負債合計	2,471
純資産の部	
元本等	
元本	2,141,454
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	163,300
(分配準備積立金)	140,653
元本等合計	2,304,754
純資産合計	2,304,754
負債純資産合計	2,307,225

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)	
第1期 自 2021年 8月23日 至 2021年11月30日	
営業収益	
有価証券売買等損益	143,124
営業収益合計	143,124
営業費用	
受託者報酬	96
委託者報酬	2,375
営業費用合計	2,471
営業利益又は営業損失 ()	140,653
経常利益又は経常損失 ()	140,653
当期純利益又は当期純損失 ()	140,653
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 ()	-
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	22,647
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	22,647
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	163,300

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,141,454口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0763円 (1万口当たりの純資産額10,763円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,546円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(126,107円)、収益調整金(22,647円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は163,300円(1万口当たり762.57円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月23日 至 2021年11月30日

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

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	143,124円
合計	143,124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 2021年8月23日 至 2021年11月30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 (2021年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,141,454円
期中一部解約元本額	-円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国リート・インデックス・マ ザーファンド	819,793	2,307,225	
	親投資信託受益証券 小計		2,307,225	
合計			2,307,225	

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DS・TOPIXインデックス・ファンド」、「三井住友DS・日経225インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド」および「三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「225マザーファンド」、「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」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1)貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	103,624,846
コール・ローン	3,056,237,624
株式	192,569,963,990
未収配当金	1,330,297,687
前払金	133,950,000
差入委託証拠金	165,240,000

流動資産合計	197,359,314,147
資産合計	197,359,314,147
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	261,119,400
未払金	19,827,373
未払解約金	24,033,101
その他未払費用	14,521
流動負債合計	304,994,395
負債合計	304,994,395
純資産の部	
元本等	
元本	61,173,269,127
剰余金	
剰余金又は欠損金()	135,881,050,625
元本等合計	197,054,319,752
純資産合計	197,054,319,752
負債純資産合計	197,359,314,147

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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>
----------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	61,173,269,127口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2212円 (1万口当たりの純資産額32,212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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なりリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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る場合、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	(2021年11月30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)

(2021年11月30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				
	TOPIX 先物 0312 月	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
	小計	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
合計		5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	60,972,880,728円
同期中における追加設定元本額	3,082,168,879円
同期中における一部解約元本額	2,881,780,480円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	893,111,379円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,314,610,252円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,302,572,824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)	123,293,850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)	4,679,600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)	20,378,358円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,968,056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)	145,617,764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)	123,379,159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)	223,865,395円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,383,108,545円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,082,196円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,921,518円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,302,327円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	71,078,321円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	69,299,615円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円
日興FWS・日本株インデックス	300,009,523円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,839,797,359円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	12,523,734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>	108,824,691円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,852,669,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,648,623,694円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,291,332,987円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	41,040,556円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	166,358,728円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	748,263,991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>	46,344,355円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	259,277,705円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	856,981,897円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	603,670,244円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,898,722,676円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	42,261,700円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	47,434,130円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	34,163,089円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	16,669,461円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	115,063,306円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	248,882,682円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	61,933,489円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	39,574,438円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	7,375,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	45,508,490円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	613,464,436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)	180,359,966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>	237,022,466円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	110,132,461円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	259,324,316円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,476,018円
SMAM・年金ワリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	37,709,634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>	55,155,389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>	59,877,017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>	197,029,085円
合計	61,173,269,127円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,700	2,900.000	10,730,000	
日本水産	97,100	573.000	55,638,300	
マルハニチロ	15,000	2,277.000	34,155,000	
雪国まいたけ	8,100	1,217.000	9,857,700	
カネコ種苗	5,000	1,348.000	6,740,000	
サカタのタネ	11,600	3,125.000	36,250,000	
ホクト	8,000	1,842.000	14,736,000	
日鉄鉱業	2,300	6,160.000	14,168,000	
三井松島HLDGS	4,800	1,293.000	6,206,400	
INPEX	396,900	937.000	371,895,300	
石油資源開発	11,700	2,291.000	26,804,700	
K&Oエナジーグループ	5,500	1,502.000	8,261,000	
ヒノキヤグループ	2,900	2,118.000	6,142,200	
ショーボンドHD	14,100	4,885.000	68,878,500	
ミライト・ホールディングス	31,300	1,965.000	61,504,500	
タマホーム	6,100	2,290.000	13,969,000	
ベステラ	3,900	1,276.000	4,976,400	
ROBOT HOME	20,800	221.000	4,596,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,700	1,658.000	4,476,600	
安藤・間	54,100	841.000	45,498,100	
東急建設	30,200	645.000	19,479,000	
コムシスホールディングス	31,600	2,476.000	78,241,600	
ビーアールホールディングス	17,000	353.000	6,001,000	
高松建設	6,700	1,869.000	12,522,300	
東建コーポレーション	2,900	8,950.000	25,955,000	

オリエンタル白石	36,700	227.000	8,330,900
大成建設	66,000	3,310.000	218,460,000
大林組	227,900	836.000	190,524,400
清水建設	213,800	717.000	153,294,600
飛島建設	8,700	977.000	8,499,900
長谷工コーポレーション	67,200	1,354.000	90,988,800
松井建設	11,600	703.000	8,154,800
銭高組	1,700	3,765.000	6,400,500
鹿島建設	167,000	1,251.000	208,917,000
不動テトラ	5,800	1,612.000	9,349,600
大末建設	5,100	1,118.000	5,701,800
鉄建建設	6,500	1,717.000	11,160,500
西松建設	14,000	3,385.000	47,390,000
三井住友建設	53,200	414.000	22,024,800
大豊建設	3,500	3,620.000	12,670,000
奥村組	13,300	3,140.000	41,762,000
東鉄工業	9,900	2,273.000	22,502,700
浅沼組	2,900	5,260.000	15,254,000
戸田建設	95,700	668.000	63,927,600
熊谷組	11,200	2,628.000	29,433,600
北野建設	2,700	2,050.000	5,535,000
矢作建設	12,500	691.000	8,637,500
ピーエス三菱	9,300	593.000	5,514,900
日本ハウスHLDGS	20,700	347.000	7,182,900
大東建託	23,400	12,290.000	287,586,000
新日本建設	10,600	745.000	7,897,000
NIPPO	18,600	4,010.000	74,586,000
東亜道路	1,400	4,650.000	6,510,000
日本道路	2,200	7,800.000	17,160,000
東亜建設	5,900	2,379.000	14,036,100
日本国土開発	22,200	532.000	11,810,400
若築建設	4,800	1,900.000	9,120,000
東洋建設	25,700	524.000	13,466,800
五洋建設	91,200	651.000	59,371,200
世紀東急	12,800	824.000	10,547,200
福田組	2,800	4,110.000	11,508,000
住友林業	58,500	2,287.000	133,789,500
巴コーポレーション	14,600	432.000	6,307,200
大和ハウス	211,200	3,316.000	700,339,200
ライト工業	14,800	2,025.000	29,970,000
積水ハウス	247,900	2,210.000	547,859,000
北陸電気工事	5,200	1,051.000	5,465,200
ユアテック	14,100	601.000	8,474,100
日本リーテック	5,800	1,393.000	8,079,400
中電工	9,900	2,027.000	20,067,300
関電工	37,500	810.000	30,375,000
きんでん	50,000	1,643.000	82,150,000
東京エネシス	8,800	1,032.000	9,081,600

トーエネック	2,900	3,120.000	9,048,000
住友電設	5,800	1,926.000	11,170,800
日本電設工業	11,700	1,549.000	18,123,300
エクシオグループ	33,900	2,406.000	81,563,400
新日本空調	6,300	2,093.000	13,185,900
九電工	17,700	3,360.000	59,472,000
三機工業	13,600	1,373.000	18,672,800
日揮ホールディングス	70,900	957.000	67,851,300
中外炉工業	3,600	1,552.000	5,587,200
ヤマト	8,800	738.000	6,494,400
太平電業	5,300	2,706.000	14,341,800
高砂熱学	21,100	1,908.000	40,258,800
朝日工業社	2,200	2,809.000	6,179,800
明星工業	17,000	652.000	11,084,000
大 氣 社	11,100	2,900.000	32,190,000
ダイダン	5,400	2,050.000	11,070,000
日比谷総合設備	7,500	1,864.000	13,980,000
フィル・カンパニー	1,700	2,192.000	3,726,400
テスホールディングス	4,700	2,422.000	11,383,400
インフロニアHD	97,400	939.000	91,458,600
東洋エンジニア	11,100	710.000	7,881,000
レイズネクスト	10,800	1,121.000	12,106,800
ニッポン	20,100	1,567.000	31,496,700
日清製粉G本社	82,200	1,636.000	134,479,200
昭和産業	6,400	2,617.000	16,748,800
鳥越製粉	8,700	710.000	6,177,000
中部飼料	8,600	944.000	8,118,400
フィード・ワン	10,300	714.000	7,354,200
日本甜菜糖	5,300	1,595.000	8,453,500
DM三井製糖ホールディ	6,400	1,862.000	11,916,800
日新製糖	4,300	1,629.000	7,004,700
森永製菓	17,300	3,530.000	61,069,000
中 村 屋	2,500	3,605.000	9,012,500
江崎グリコ	20,000	3,505.000	70,100,000
名糖産業	5,000	1,650.000	8,250,000
井村屋グループ	4,500	2,162.000	9,729,000
不 二 家	4,400	2,232.000	9,820,800
山崎製パン	54,700	1,475.000	80,682,500
モロゾフ	1,700	5,290.000	8,993,000
亀田製菓	4,100	4,325.000	17,732,500
寿スピリッツ	7,000	6,160.000	43,120,000
カルビー	33,400	2,548.000	85,103,200
森永乳業	13,600	5,440.000	73,984,000
六甲バター	6,500	1,528.000	9,932,000
ヤクルト	54,100	5,670.000	306,747,000
明治ホールディングス	48,100	6,660.000	320,346,000
雪印メグミルク	17,400	1,920.000	33,408,000
プリマハム	8,400	2,371.000	19,916,400

日本ハム	27,700	3,870.000	107,199,000
丸大食品	7,800	1,433.000	11,177,400
S Foods	6,300	3,285.000	20,695,500
柿安本店	2,900	2,590.000	7,511,000
伊藤ハム米久HLDGS	41,400	642.000	26,578,800
サッポロホールディングス	25,000	2,180.000	54,500,000
アサヒグループホールディング	171,800	4,194.000	720,529,200
麒麟HD	268,300	1,817.000	487,501,100
宝ホールディングス	50,200	1,220.000	61,244,000
オエノンホールディングス	24,500	356.000	8,722,000
養命酒	3,700	1,770.000	6,549,000
コカ・コーラボトラーズJHD	50,900	1,265.000	64,388,500
サントリー食品インター	48,800	4,005.000	195,444,000
ダイトーグループHD	3,700	4,910.000	18,167,000
伊藤園	22,200	6,670.000	148,074,000
キーコーヒー	6,900	1,941.000	13,392,900
日清オイリオグループ	8,400	2,778.000	23,335,200
不二製油グループ	15,800	2,236.000	35,328,800
かどや製油	1,400	4,040.000	5,656,000
J-オイルミルズ	7,400	1,651.000	12,217,400
キッコーマン	52,600	8,660.000	455,516,000
味の素	161,300	3,407.000	549,549,100
ブルドックソ-ス	3,900	2,049.000	7,991,100
キューピー	38,300	2,309.000	88,434,700
ハウス食品G本社	27,200	2,789.000	75,860,800
カゴメ	27,600	2,765.000	76,314,000
焼津水産化工	7,700	931.000	7,168,700
アリアケジャパン	6,700	6,400.000	42,880,000
ニチレイ	34,900	2,601.000	90,774,900
東洋水産	35,000	4,600.000	161,000,000
イトアンドHLDGS	3,600	2,079.000	7,484,400
日清食品HD	28,600	8,340.000	238,524,000
永谷園ホールディングス	4,100	1,933.000	7,925,300
一正蒲鉾	6,600	853.000	5,629,800
フジッコ	7,500	1,808.000	13,560,000
ロックフィールド	7,900	1,438.000	11,360,200
日本たばこ産業	391,800	2,273.500	890,757,300
ケンコーマヨネーズ	5,200	1,271.000	6,609,200
わらべや日洋HD	5,300	1,842.000	9,762,600
なとり	5,200	1,901.000	9,885,200
ピクルスコーポレーション	4,100	1,765.000	7,236,500
ファーマフーズ	7,000	2,272.000	15,904,000
ユーグレナ	38,500	795.000	30,607,500
紀文食品	5,000	979.000	4,895,000
ミヨシ油脂	5,100	1,267.000	6,461,700
理研ビタミン	8,100	1,603.000	12,984,300
グンゼ	5,100	3,945.000	20,119,500
東洋紡	29,200	1,195.000	34,894,000

ユニチカ	23,100	289.000	6,675,900
富士紡ホールディングス	3,500	3,765.000	13,177,500
倉敷紡績	6,700	1,822.000	12,207,400
シキボウ	8,200	894.000	7,330,800
日本毛織	23,300	841.000	19,595,300
帝国繊維	9,100	1,973.000	17,954,300
帝人	68,000	1,301.000	88,468,000
東レ	519,200	660.800	343,087,360
住江織物	3,300	1,534.000	5,062,200
アツギ	10,200	666.000	6,793,200
ダイニツク	7,400	685.000	5,069,000
セーレン	15,500	2,273.000	35,231,500
小松マテーレ	13,000	1,177.000	15,301,000
ワコールホールディングス	18,400	2,013.000	37,039,200
ホギメディカル	10,200	3,000.000	30,600,000
T S Iホールディングス	27,300	345.000	9,418,500
マツオカコーポレーション	3,500	1,217.000	4,259,500
ワールド	11,000	1,189.000	13,079,000
オンワードホールディングス	47,400	288.000	13,651,200
ゴ-ルドウイン	13,000	6,450.000	83,850,000
デサント	14,200	4,610.000	65,462,000
特種東海製紙	4,700	4,025.000	18,917,500
王子ホールディングス	297,100	525.000	155,977,500
日本製紙	35,200	1,066.000	37,523,200
北越コーポレーション	47,800	780.000	37,284,000
大王製紙	35,200	1,799.000	63,324,800
レンゴー	68,600	767.000	52,616,200
トーモク	5,600	1,761.000	9,861,600
ザ・バック	5,900	2,680.000	15,812,000
北の達人コーポ	26,600	356.000	9,469,600
クラレ	103,400	944.000	97,609,600
旭化成	473,000	1,071.500	506,819,500
昭和電工	61,900	2,502.000	154,873,800
住友化学	520,700	524.000	272,846,800
住友精化	3,600	3,020.000	10,872,000
日産化学	38,800	6,540.000	253,752,000
ラサ工業	2,800	1,658.000	4,642,400
クレハ	5,600	7,900.000	44,240,000
多木化学	2,900	5,450.000	15,805,000
テイカ	6,200	1,163.000	7,210,600
石原産業	12,200	1,166.000	14,225,200
日本曹達	9,000	3,215.000	28,935,000
東ソー	102,600	1,631.000	167,340,600
トクヤマ	23,000	1,784.000	41,032,000
セントラル硝子	12,000	1,944.000	23,328,000
東亜合成	40,900	1,176.000	48,098,400
大阪ソーダ	6,400	2,555.000	16,352,000
関東電化	16,200	1,008.000	16,329,600

デンカ	25,900	3,345.000	86,635,500
信越化学	122,600	19,000.000	2,329,400,000
堺化学	5,200	2,096.000	10,899,200
第一稀元素化学工	8,400	1,278.000	10,735,200
エア・ウォーター	67,300	1,677.000	112,862,100
日本酸素HLDGS	68,500	2,403.000	164,605,500
日本化学工業	2,600	2,520.000	6,552,000
日本パ - カライジング	36,400	1,060.000	38,584,000
高压ガス	13,100	736.000	9,641,600
四国化成	9,400	1,366.000	12,840,400
ステラ ケミファ	4,000	2,500.000	10,000,000
保土谷化学	2,400	4,625.000	11,100,000
日本触媒	12,100	5,070.000	61,347,000
大日精化	5,700	2,200.000	12,540,000
カネカ	18,400	3,700.000	68,080,000
三菱瓦斯化学	66,200	1,889.000	125,051,800
三井化学	64,500	3,045.000	196,402,500
J S R	66,500	4,240.000	281,960,000
東京応化工業	12,300	7,120.000	87,576,000
大阪有機化学	6,000	3,650.000	21,900,000
三菱ケミカルHLDGS	476,700	892.200	425,311,740
KHネオケム	11,800	3,080.000	36,344,000
ダイセル	103,300	783.000	80,883,900
住友ベ - クライト	11,300	5,310.000	60,003,000
積水化学	148,600	1,845.000	274,167,000
日本ゼオン	64,700	1,203.000	77,834,100
アイカ工業	20,000	3,315.000	66,300,000
宇部興産	33,200	1,900.000	63,080,000
積水樹脂	10,800	2,019.000	21,805,200
タキロンシーアイ	16,500	522.000	8,613,000
旭有機材	4,900	1,490.000	7,301,000
ニチバン	5,700	1,747.000	9,957,900
リケンテクノス	19,300	481.000	9,283,300
大倉工業	4,200	2,052.000	8,618,400
群栄化学	2,500	3,275.000	8,187,500
ミライアル	2,900	1,627.000	4,718,300
ダイキョーニシカワ	16,300	537.000	8,753,100
森六ホールディングス	5,000	1,710.000	8,550,000
恵和	1,900	6,130.000	11,647,000
日本化薬	56,800	1,114.000	63,275,200
カーリットホールディングス	8,800	653.000	5,746,400
日本精化	6,000	2,000.000	12,000,000
扶桑化学工業	6,400	4,720.000	30,208,000
トリケミカル	7,300	3,500.000	25,550,000
ADEKA	32,800	2,411.000	79,080,800
日油	24,300	5,600.000	136,080,000
新日本理化	20,100	244.000	4,904,400
ハリマ化成グループ	7,300	791.000	5,774,300

花 王	161,300	5,787.000	933,443,100
第一工業製薬	3,100	3,095.000	9,594,500
石原ケミカル	4,500	1,265.000	5,692,500
ニイタカ	2,400	2,250.000	5,400,000
三洋化成	4,100	5,090.000	20,869,000
大日本塗料	11,000	791.000	8,701,000
日本ペイントHOLD	268,500	1,193.000	320,320,500
関西ペイント	74,100	2,550.000	188,955,000
中国塗料	17,700	862.000	15,257,400
日本特殊塗料	7,000	793.000	5,551,000
藤倉化成	11,700	490.000	5,733,000
太陽ホールディングス	10,400	3,225.000	33,540,000
D I C	30,100	2,845.000	85,634,500
サカタインクス	14,400	972.000	13,996,800
東洋インキS Cホールディン	13,800	1,875.000	25,875,000
T & K T O K A	8,400	746.000	6,266,400
富士フイルムHLDGS	128,100	8,931.000	1,144,061,100
資 生 堂	135,800	6,503.000	883,107,400
ライオン	88,000	1,611.000	141,768,000
高砂香料	5,000	2,750.000	13,750,000
マンダム	15,700	1,424.000	22,356,800
ミルボン	9,100	5,760.000	52,416,000
ファンケル	29,500	3,425.000	101,037,500
コーセー	13,700	13,670.000	187,279,000
コタ	6,000	1,505.000	9,030,000
ポーラ・オルビスHD	31,400	2,022.000	63,490,800
ノエビアホールディングス	6,100	5,250.000	32,025,000
新日本製薬	3,600	1,243.000	4,474,800
エステー	5,600	1,537.000	8,607,200
コ ニ シ	11,900	1,598.000	19,016,200
長谷川香料	12,400	2,812.000	34,868,800
小林製薬	20,400	8,920.000	181,968,000
荒川化学工業	7,200	1,129.000	8,128,800
メック	5,500	4,120.000	22,660,000
タカラバイオ	19,000	2,639.000	50,141,000
J C U	8,000	4,800.000	38,400,000
デクセリアルズ	18,900	3,345.000	63,220,500
アース製薬	6,000	6,140.000	36,840,000
北興化学	7,800	846.000	6,598,800
大成ラミック	3,300	2,740.000	9,042,000
クミアイ化学	27,500	798.000	21,945,000
日本農薬	16,100	465.000	7,486,500
アキレス	6,200	1,209.000	7,495,800
有沢製作所	11,700	925.000	10,822,500
日東電工	44,000	7,900.000	347,600,000
レック	11,000	819.000	9,009,000
藤森工業	6,400	3,580.000	22,912,000
前澤化成工業	6,800	1,251.000	8,506,800

未来工業	3,800	1,616.000	6,140,800
ジェイ エス ピー	5,200	1,515.000	7,878,000
エフピコ	13,600	3,745.000	50,932,000
天馬	6,000	2,402.000	14,412,000
信越ポリマー	13,400	951.000	12,743,400
東 リ	27,300	219.000	5,978,700
ニ フ コ	24,400	3,120.000	76,128,000
バルカー	6,000	2,442.000	14,652,000
ユニ・チャ・ム	140,500	4,888.000	686,764,000
協和キリン	85,300	3,170.000	270,401,000
武田薬品	572,500	3,031.000	1,735,247,500
アステラス製薬	631,500	1,779.500	1,123,754,250
大日本住友製薬	45,300	1,382.000	62,604,600
塩野義製薬	91,500	7,923.000	724,954,500
日本新薬	19,100	8,400.000	160,440,000
中外製薬	227,800	3,680.000	838,304,000
科研製薬	11,500	4,045.000	46,517,500
エーザイ	87,100	6,873.000	598,638,300
ロート製薬	37,500	3,235.000	121,312,500
小野薬品	167,000	2,505.500	418,418,500
久光製薬	19,200	3,990.000	76,608,000
持田製薬	9,400	3,180.000	29,892,000
参天製薬	135,800	1,504.000	204,243,200
扶桑薬品	3,400	2,369.000	8,054,600
日本ケミファ	2,500	2,041.000	5,102,500
ツムラ	22,600	3,235.000	73,111,000
日医工	23,300	672.000	15,657,600
キッセイ薬品工業	13,200	2,284.000	30,148,800
生化学工業	13,000	938.000	12,194,000
栄研化学	12,700	1,893.000	24,041,100
鳥居薬品	4,100	2,778.000	11,389,800
J C Rファーマ	20,700	2,499.000	51,729,300
東和薬品	10,200	2,626.000	26,785,200
富士製薬工業	6,300	1,080.000	6,804,000
ゼリア新薬工業	13,100	1,919.000	25,138,900
第一三共	572,500	2,824.500	1,617,026,250
キョーリン製薬HD	14,500	1,688.000	24,476,000
大幸薬品	12,900	808.000	10,423,200
ダイト	4,800	2,841.000	13,636,800
大塚ホールディングス	151,300	4,146.000	627,289,800
大正製薬HD	17,200	5,580.000	95,976,000
ペプチドリーム	38,400	2,862.000	109,900,800
あすか製薬HD	9,200	962.000	8,850,400
サワイグループHD	16,000	4,200.000	67,200,000
日本コークス工業	69,200	122.000	8,442,400
ニチレキ	10,400	1,307.000	13,592,800
ユシロ化学	7,000	1,038.000	7,266,000
MORESCO	5,400	1,077.000	5,815,800

出光興産	80,600	2,931.000	236,238,600
E N E O Sホールディングス	1,096,100	423.400	464,088,740
コスモエネルギーHLDGS	21,200	2,225.000	47,170,000
横浜ゴム	41,800	1,766.000	73,818,800
TOYO TIRE	38,600	1,726.000	66,623,600
ブリヂストン	209,800	4,605.000	966,129,000
住友ゴム	65,400	1,139.000	74,490,600
藤倉コンポジット	7,400	788.000	5,831,200
オカモト	4,400	3,770.000	16,588,000
ニッタ	7,600	2,602.000	19,775,200
住友理工	15,800	574.000	9,069,200
三ツ星ベルト	8,900	1,932.000	17,194,800
バンドー化学	13,000	850.000	11,050,000
日東紡績	11,000	2,666.000	29,326,000
A G C	66,800	5,550.000	370,740,000
日本板硝子	19,600	502.000	9,839,200
日本電気硝子	29,500	2,939.000	86,700,500
オハラ	3,800	1,363.000	5,179,400
住友大阪セメント	13,800	3,450.000	47,610,000
太平洋セメント	41,600	2,199.000	91,478,400
日本ヒユ-ム	12,100	666.000	8,058,600
日本コンクリ-ト	22,900	252.000	5,770,800
三谷セキサン	3,600	7,080.000	25,488,000
アジアパイルHD	16,500	412.000	6,798,000
東海カーボン	61,200	1,177.000	72,032,400
日本カーボン	3,800	4,145.000	15,751,000
東洋炭素	4,800	3,110.000	14,928,000
ノリタケ	4,100	4,630.000	18,983,000
TOTO	52,100	5,030.000	262,063,000
日本碍子	78,700	1,797.000	141,423,900
日本特殊陶業	55,400	1,888.000	104,595,200
MARUWA	2,600	13,400.000	34,840,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,475.000	6,950,000
黒崎播磨	1,600	3,900.000	6,240,000
ヨータイ	5,400	1,211.000	6,539,400
東京窯業	15,300	294.000	4,498,200
フジインコーポレーテッド	6,000	7,350.000	44,100,000
ニチアス	17,700	2,566.000	45,418,200
ニチハ	10,200	2,791.000	28,468,200
日本製鉄	322,200	1,699.500	547,578,900
神戸製鋼所	133,700	549.000	73,401,300
中山製鋼所	14,900	413.000	6,153,700
合同製鐵	5,200	1,314.000	6,832,800
J F Eホールディングス	194,000	1,316.000	255,304,000
東京製鐵	24,600	1,203.000	29,593,800
共英製鋼	9,100	1,251.000	11,384,100
大和工業	14,000	3,485.000	48,790,000
東京鐵鋼	4,700	1,241.000	5,832,700

淀川製鋼所	9,600	2,280.000	21,888,000
丸一鋼管	25,600	2,427.000	62,131,200
モリ工業	2,600	2,574.000	6,692,400
大同特殊鋼	11,900	3,930.000	46,767,000
日本冶金工	5,500	2,043.000	11,236,500
山陽特殊製鋼	7,600	1,818.000	13,816,800
愛知製鋼	4,700	2,427.000	11,406,900
日立金属	77,300	2,102.000	162,484,600
大平洋金属	4,900	2,030.000	9,947,000
新日本電工	47,200	292.000	13,782,400
栗本鉄工所	4,700	1,473.000	6,923,100
三菱製鋼	5,700	970.000	5,529,000
日本精線	1,500	4,375.000	6,562,500
エンビプロHD	3,400	1,897.000	6,449,800
大紀アルミニウム	10,600	1,462.000	15,497,200
日本軽金属HD	18,400	1,669.000	30,709,600
三井金属	19,300	2,930.000	56,549,000
東邦亜鉛	4,600	2,122.000	9,761,200
三菱マテリアル	47,400	1,954.000	92,619,600
住友鉱山	92,100	4,233.000	389,859,300
DOWAホールディングス	19,500	4,220.000	82,290,000
古河機金	11,800	1,198.000	14,136,400
大阪チタニウム	11,000	780.000	8,580,000
東邦チタニウム	13,500	948.000	12,798,000
UACJ	10,800	2,295.000	24,786,000
CKサンエツ	2,000	3,355.000	6,710,000
古河電工	22,600	2,255.000	50,963,000
住友電工	269,800	1,489.500	401,867,100
フジクラ	80,400	573.000	46,069,200
昭和電線HLDGS	6,400	1,878.000	12,019,200
タツタ電線	14,900	461.000	6,868,900
平河ヒューテック	5,400	1,102.000	5,950,800
リョービ	10,200	1,007.000	10,271,400
アサヒHD	28,700	1,914.000	54,931,800
宮地エンジニアリングG	3,200	2,906.000	9,299,200
トーカロ	18,400	1,484.000	27,305,600
アルファCO	4,900	1,070.000	5,243,000
SUMCO	110,900	2,488.000	275,919,200
川田テクノロジーズ	2,100	3,695.000	7,759,500
RS TECHNOLOGIES	2,400	6,440.000	15,456,000
東洋製罐グループHD	46,300	1,386.000	64,171,800
ホッカンホールディングス	5,400	1,410.000	7,614,000
横河ブリッジHLDGS	12,400	2,121.000	26,300,400
駒井ハルテック	3,100	1,720.000	5,332,000
三和ホールディングス	68,400	1,213.000	82,969,200
文化シヤツタ-	23,000	1,009.000	23,207,000
三協立山	12,000	684.000	8,208,000
アルインコ	8,000	934.000	7,472,000

L I X I L	113,400	2,789.000	316,272,600
ノーリツ	13,900	1,629.000	22,643,100
長府製作所	7,300	2,001.000	14,607,300
リンナイ	13,600	10,720.000	145,792,000
日東精工	13,000	593.000	7,709,000
岡 部	18,000	674.000	12,132,000
ジーテクト	9,200	1,333.000	12,263,600
東 プ レ	13,700	1,091.000	14,946,700
高周波熱錬	16,300	553.000	9,013,900
東京製綱	7,000	760.000	5,320,000
パイオラックス	11,000	1,610.000	17,710,000
エイチワン	9,900	621.000	6,147,900
日本発条	66,800	847.000	56,579,600
立川ブラインド	5,000	1,090.000	5,450,000
三益半導体	5,600	2,341.000	13,109,600
日本製鋼所	22,200	3,425.000	76,035,000
三浦工業	31,300	3,985.000	124,730,500
タ ク マ	24,100	1,370.000	33,017,000
ツ ガ ミ	17,400	1,411.000	24,551,400
オークマ	8,500	4,745.000	40,332,500
芝浦機械	8,300	3,370.000	27,971,000
アマダ	113,400	1,063.000	120,544,200
アイダエンジニア	19,000	922.000	17,518,000
F U J I	33,000	2,489.000	82,137,000
牧野フライス	7,800	3,455.000	26,949,000
オーエスジー	34,000	1,646.000	55,964,000
旭ダイヤモンド	19,400	634.000	12,299,600
D M G 森精機	42,900	1,774.000	76,104,600
ソディック	16,800	767.000	12,885,600
ディスコ	10,600	32,600.000	345,560,000
日東工器	4,800	1,740.000	8,352,000
日進工具	6,300	1,429.000	9,002,700
島精機製作所	10,800	1,908.000	20,606,400
オプトラ	9,300	2,243.000	20,859,900
N C ホールディングス	3,000	1,388.000	4,164,000
フリュー	7,200	1,272.000	9,158,400
ヤマシンフィルタ	15,400	523.000	8,054,200
日阪製作所	11,300	788.000	8,904,400
やまびこ	13,900	1,248.000	17,347,200
野村マイクロ・サイエンス	2,000	4,845.000	9,690,000
平田機工	3,500	5,970.000	20,895,000
マルマエ	3,300	2,993.000	9,876,900
タツモ	4,200	1,669.000	7,009,800
ナプテスコ	41,100	3,285.000	135,013,500
三井海洋開発	8,200	1,398.000	11,463,600
レオン自動機	8,600	1,309.000	11,257,400
S M C	21,300	72,650.000	1,547,445,000
ホソカワミクロン	5,100	2,842.000	14,494,200

ユニオンツール	2,800	3,745.000	10,486,000
オイレス工業	10,000	1,643.000	16,430,000
日精エーエスビー	2,700	2,844.000	7,678,800
サト - ホールディングス	9,700	2,126.000	20,622,200
技研製作所	6,400	4,130.000	26,432,000
日本エアーテック	4,700	1,210.000	5,687,000
日精樹脂工業	6,500	980.000	6,370,000
小松製作所	330,500	2,592.000	856,656,000
住友重機械	41,600	2,521.000	104,873,600
日立建機	29,200	3,300.000	96,360,000
日 工	13,600	610.000	8,296,000
巴工業	3,500	2,288.000	8,008,000
井関農機	7,700	1,409.000	10,849,300
T O W A	6,500	3,200.000	20,800,000
北川鉄工所	4,800	1,393.000	6,686,400
ローツェ	3,600	11,950.000	43,020,000
クボタ	355,800	2,369.000	842,890,200
荏原実業	3,600	2,510.000	9,036,000
三菱化工機	3,000	2,265.000	6,795,000
月島機械	13,800	1,068.000	14,738,400
帝国電機製作所	6,100	1,391.000	8,485,100
新東工業	18,500	677.000	12,524,500
渋谷工業	6,400	2,858.000	18,291,200
アイチ コーポレーション	11,800	779.000	9,192,200
小森コーポレーション	20,400	630.000	12,852,000
鶴見製作所	6,300	1,530.000	9,639,000
荏原製作所	30,300	6,100.000	184,830,000
西島製作所	10,000	863.000	8,630,000
北越工業	9,100	946.000	8,608,600
ダイキン工業	92,900	23,150.000	2,150,635,000
オルガノ	2,000	6,820.000	13,640,000
ト - ヨ - カネツ	3,400	2,494.000	8,479,600
栗田工業	39,400	5,300.000	208,820,000
椿本チエイン	9,500	2,875.000	27,312,500
大同工業	5,300	852.000	4,515,600
木村化工機	7,500	986.000	7,395,000
アネスト岩田	12,800	854.000	10,931,200
ダイフク	40,000	9,090.000	363,600,000
サムコ	2,300	2,911.000	6,695,300
タダノ	39,000	1,008.000	39,312,000
フジテック	27,300	2,382.000	65,028,600
C K D	21,400	2,223.000	47,572,200
キトー	7,200	1,754.000	12,628,800
平和	20,400	1,848.000	37,699,200
理想科学工業	6,400	2,022.000	12,940,800
S A N K Y O	16,100	2,894.000	46,593,400
日本金銭機械	9,100	688.000	6,260,800
マースグループH L D G S	6,200	1,590.000	9,858,000

フクシマガリレイ	5,100	4,180.000	21,318,000
ダイコク電機	5,000	1,190.000	5,950,000
竹内製作所	11,000	2,718.000	29,898,000
ア マ ノ	19,300	2,491.000	48,076,300
J U K I	11,800	919.000	10,844,200
ジャノメ	8,100	622.000	5,038,200
マックス	9,900	1,795.000	17,770,500
グローリー	19,200	2,075.000	39,840,000
新晃工業	7,000	1,831.000	12,817,000
大和冷機工業	10,500	1,206.000	12,663,000
セガサミーホールディングス	72,500	1,845.000	133,762,500
日本ピストンリング	4,400	1,219.000	5,363,600
リ ケ ン	3,700	2,437.000	9,016,900
T P R	10,000	1,368.000	13,680,000
ツバキ・ナカシマ	16,500	1,370.000	22,605,000
ホシザキ	21,300	8,620.000	183,606,000
大豊工業	8,200	728.000	5,969,600
日本精工	136,100	771.000	104,933,100
N T N	157,900	210.000	33,159,000
ジェイテクト	69,600	992.000	69,043,200
不 二 越	6,100	3,860.000	23,546,000
日本トムソン	22,100	691.000	15,271,100
T H K	42,500	2,711.000	115,217,500
ユーシン精機	8,700	728.000	6,333,600
前澤給装工業	7,300	1,001.000	7,307,300
イーグル工業	10,000	1,025.000	10,250,000
日本ピラ - 工業	7,400	3,200.000	23,680,000
キッツ	25,300	701.000	17,735,300
マキタ	88,900	4,984.000	443,077,600
日立造船	61,600	841.000	51,805,600
三菱重工業	114,600	2,561.000	293,490,600
I H I	45,600	2,141.000	97,629,600
スター精密	11,600	1,446.000	16,773,600
日清紡ホールディングス	44,900	819.000	36,773,100
イビデン	38,200	7,070.000	270,074,000
コニカミノルタ	160,300	469.000	75,180,700
ブラザー工業	88,800	1,954.000	173,515,200
ミネベアミツミ	125,200	3,000.000	375,600,000
日 立	350,500	6,688.000	2,344,144,000
東 芝	127,300	4,527.000	576,287,100
三菱電機	729,000	1,424.500	1,038,460,500
富士電機	43,900	5,940.000	260,766,000
安川電機	78,300	5,090.000	398,547,000
シンフォニア テクノロジー	9,500	1,261.000	11,979,500
明 電 舎	12,600	2,588.000	32,608,800
オリジン	4,300	1,262.000	5,426,600
山洋電気	3,300	5,670.000	18,711,000
デンヨー	7,000	1,657.000	11,599,000

PHCホールディングス	8,000	2,298.000	18,384,000
東芝テック	7,900	4,355.000	34,404,500
芝浦メカトロニクス	1,400	8,250.000	11,550,000
マブチモーター	17,100	3,730.000	63,783,000
日本電産	188,900	13,000.000	2,455,700,000
トレックス・セミコンダクター	4,200	3,785.000	15,897,000
東光高岳	5,200	1,304.000	6,780,800
ダイヘン	8,000	4,300.000	34,400,000
ヤーマン	12,400	1,008.000	12,499,200
JVCケンウッド	65,900	165.000	10,873,500
ミマキエンジニアリング	8,500	882.000	7,497,000
I - P E X	4,100	1,940.000	7,954,000
日新電機	17,200	1,417.000	24,372,400
大崎電気	18,000	441.000	7,938,000
オムロン	60,700	10,965.000	665,575,500
日東工業	9,800	1,487.000	14,572,600
I D E C	9,400	2,688.000	25,267,200
ジーエス・ユアサ コーポ	24,400	2,306.000	56,266,400
メルコホールディングス	2,200	3,900.000	8,580,000
日本電気	92,500	5,120.000	473,600,000
富士通	65,600	18,795.000	1,232,952,000
沖電気	31,100	838.000	26,061,800
電気興業	4,400	2,518.000	11,079,200
サンケン電気	6,900	5,780.000	39,882,000
アイホン	4,700	2,087.000	9,808,900
ルネサスエレクトロニクス	394,700	1,442.000	569,157,400
セイコーエプソン	90,500	1,830.000	165,615,000
ワコム	56,500	874.000	49,381,000
アルバック	13,500	6,500.000	87,750,000
E I Z O	5,700	3,940.000	22,458,000
日本信号	19,100	861.000	16,445,100
京三製作所	18,700	431.000	8,059,700
能美防災	9,900	1,999.000	19,790,100
ホーチキ	6,500	1,246.000	8,099,000
エレコム	16,800	1,325.000	22,260,000
パナソニック	777,600	1,242.500	966,168,000
シャープ	83,300	1,270.000	105,791,000
アンリツ	46,900	1,765.000	82,778,500
富士通ゼネラル	19,900	2,580.000	51,342,000
ソニーグループ	456,500	13,825.000	6,311,112,500
T D K	105,500	4,500.000	474,750,000
帝国通信工業	5,000	1,225.000	6,125,000
タムラ製作所	29,100	689.000	20,049,900
アルプスアルパイン	65,100	1,023.000	66,597,300
日本電波工業	8,200	1,684.000	13,808,800
メイコー	6,000	3,870.000	23,220,000
日本トリム	2,100	3,360.000	7,056,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	2,584.000	12,403,200

フオスタ - 電機	9,800	703.000	6,889,400
S M K	2,500	2,281.000	5,702,500
ヨコオ	5,500	2,684.000	14,762,000
ホシデン	17,400	1,174.000	20,427,600
ヒロセ電機	11,200	19,050.000	213,360,000
日本航空電子	17,000	1,815.000	30,855,000
T O A	9,800	725.000	7,105,000
マクセル	15,000	1,309.000	19,635,000
古野電気	9,600	1,146.000	11,001,600
ユニデンホールディングス	2,100	3,350.000	7,035,000
スミダコーポレーション	7,900	1,122.000	8,863,800
アイコム	3,400	2,310.000	7,854,000
リオン	3,600	2,135.000	7,686,000
横河電機	73,100	2,135.000	156,068,500
新電元工業	3,100	3,380.000	10,478,000
アズビル	42,700	5,020.000	214,354,000
東亜ディーケーケー	5,400	840.000	4,536,000
日本光電工業	29,900	3,345.000	100,015,500
共和電業	16,200	388.000	6,285,600
日本電子材料	4,000	2,194.000	8,776,000
堀場製作所	13,400	6,750.000	90,450,000
アドバンテスト	54,100	9,990.000	540,459,000
エスペック	6,200	2,103.000	13,038,600
キーエンス	66,000	70,330.000	4,641,780,000
日置電機	3,500	8,860.000	31,010,000
シスメックス	61,600	14,160.000	872,256,000
日本マイクロニクス	13,100	1,794.000	23,501,400
メガチップス	6,900	4,755.000	32,809,500
O B A R A G R O U P	3,700	3,320.000	12,284,000
コーセル	10,600	898.000	9,518,800
イリソ電子工業	6,300	4,575.000	28,822,500
オプテックスグループ	12,700	1,485.000	18,859,500
千代田インテグレ	4,000	2,169.000	8,676,000
レーザーテック	32,000	29,745.000	951,840,000
スタンレー電気	50,900	2,952.000	150,256,800
岩崎電気	3,600	2,246.000	8,085,600
ウシオ電機	37,600	2,107.000	79,223,200
日本セラミック	6,900	2,862.000	19,747,800
遠藤照明	4,800	1,023.000	4,910,400
古河電池	5,600	1,463.000	8,192,800
山一電機	6,100	2,305.000	14,060,500
図 研	4,800	3,735.000	17,928,000
日本電子	15,200	9,470.000	143,944,000
カ シ オ	53,000	1,474.000	78,122,000
ファナック	64,000	22,245.000	1,423,680,000
日本シイエムケイ	18,200	504.000	9,172,800
エンプラス	2,200	2,521.000	5,546,200
大真空	11,600	1,570.000	18,212,000

ローム	32,600	10,630.000	346,538,000
浜松ホトニクス	52,200	6,980.000	364,356,000
三井ハイテック	7,200	9,160.000	65,952,000
新光電気工業	21,300	5,350.000	113,955,000
京セラ	102,600	6,731.000	690,600,600
太陽誘電	35,300	6,260.000	220,978,000
村田製作所	214,000	8,380.000	1,793,320,000
双葉電子工業	14,500	689.000	9,990,500
北陸電気工業	6,100	1,266.000	7,722,600
ニチコン	23,100	1,162.000	26,842,200
日本ケミコン	7,300	1,801.000	13,147,300
K O A	11,200	1,530.000	17,136,000
市光工業	10,700	496.000	5,307,200
小糸製作所	39,900	6,530.000	260,547,000
ミツバ	15,600	459.000	7,160,400
S C R E E Nホールディングス	12,700	11,500.000	146,050,000
キャノン電子	7,700	1,486.000	11,442,200
キャノン	362,000	2,500.000	905,000,000
リコー	202,300	1,003.000	202,906,900
象印マホービン	19,700	1,591.000	31,342,700
東京エレクトロン	46,200	59,840.000	2,764,608,000
トヨタ紡織	29,600	2,239.000	66,274,400
ユニプレス	12,600	710.000	8,946,000
豊田自動織機	58,900	9,320.000	548,948,000
モリタホールディングス	12,400	1,273.000	15,785,200
三桜工業	11,100	937.000	10,400,700
デンソー	160,500	8,331.000	1,337,125,500
東海理化電機	19,300	1,484.000	28,641,200
川崎重工業	53,200	1,908.000	101,505,600
日本車輛	3,600	2,008.000	7,228,800
三菱ロジスネクスト	10,600	1,027.000	10,886,200
日産自動車	859,200	562.900	483,643,680
いすゞ自動車	228,500	1,532.000	350,062,000
トヨタ自動車	3,691,100	2,001.000	7,385,891,100
日野自動車	91,500	944.000	86,376,000
三菱自動車工業	269,900	366.000	98,783,400
武蔵精密工業	16,400	1,772.000	29,060,800
日産車体	12,700	676.000	8,585,200
新明和工業	20,300	845.000	17,153,500
極東開発工業	13,400	1,402.000	18,786,800
トピー工業	7,900	1,051.000	8,302,900
ティラド	2,500	2,855.000	7,137,500
曙ブレーキ	44,800	194.000	8,691,200
タチエス	13,300	1,144.000	15,215,200
N O K	36,000	1,214.000	43,704,000
フタバ産業	20,800	385.000	8,008,000
K Y B	7,500	2,904.000	21,780,000
大同メタル工業	18,400	568.000	10,451,200

プレス工業	39,700	373.000	14,808,100
太平洋工業	15,600	1,051.000	16,395,600
アイシン	53,100	4,170.000	221,427,000
マ ッ ダ	228,800	918.000	210,038,400
本田技研	573,800	3,101.000	1,779,353,800
スズキ	166,500	4,585.000	763,402,500
S U B A R U	208,700	2,142.500	447,139,750
安永	5,000	963.000	4,815,000
ヤマハ発動機	95,000	2,859.000	271,605,000
T B K	14,500	393.000	5,698,500
エクセディ	10,900	1,610.000	17,549,000
豊田合成	23,500	2,269.000	53,321,500
愛三工業	13,400	761.000	10,197,400
ヨ ロ ズ	8,900	1,054.000	9,380,600
エフ・シー・シー	11,800	1,436.000	16,944,800
シマノ	29,400	31,400.000	923,160,000
テイ・エス テック	30,800	1,333.000	41,056,400
ジャムコ	6,300	827.000	5,210,100
テ ル モ	206,300	4,628.000	954,756,400
日 機 装	21,700	848.000	18,401,600
日本エム・ディ・エム	4,700	1,936.000	9,099,200
島津製作所	93,500	4,810.000	449,735,000
J M S	8,100	590.000	4,779,000
長野計器	5,900	1,691.000	9,976,900
ブイ・テクノロジ	3,400	3,445.000	11,713,000
東京計器	6,800	969.000	6,589,200
インターアクション	3,900	2,325.000	9,067,500
東京精密	12,200	4,800.000	58,560,000
マニ	29,600	1,660.000	49,136,000
ニコン	111,700	1,177.000	131,470,900
トプコン	34,700	1,791.000	62,147,700
オリンパス	382,700	2,539.000	971,675,300
理研計器	5,700	5,370.000	30,609,000
タムロン	5,700	2,523.000	14,381,100
H O Y A	142,300	18,020.000	2,564,246,000
ノーリツ鋼機	6,700	2,743.000	18,378,100
エー・アンド・デイ	7,600	1,118.000	8,496,800
朝日インテック	80,100	2,488.000	199,288,800
シチズン時計	83,800	519.000	43,492,200
リズム	3,400	1,190.000	4,046,000
メニコン	24,000	3,755.000	90,120,000
松 風	3,600	2,027.000	7,297,200
セイコーHD	10,100	2,198.000	22,199,800
ニプロ	55,600	1,075.000	59,770,000
スノーピーク	9,600	3,875.000	37,200,000
パラマウントベッドHD	14,000	1,931.000	27,034,000
トランザクション	5,500	967.000	5,318,500
ニホンフラッシュ	7,200	1,065.000	7,668,000

前田工織	8,000	3,510.000	28,080,000
永大産業	20,500	272.000	5,576,000
アートネイチャー	9,300	646.000	6,007,800
バンダイナムコHLDGS	65,300	8,837.000	577,056,100
SHOEI	7,200	4,800.000	34,560,000
フランスベッドHLDGS	12,400	853.000	10,577,200
パイロットコーポレーション	12,700	4,145.000	52,641,500
萩原工業	5,800	1,326.000	7,690,800
フジシールインターナショナル	17,700	2,058.000	36,426,600
タカラトミー	31,000	999.000	30,969,000
広済堂ホールディングス	5,400	819.000	4,422,600
プロネクサス	7,600	1,015.000	7,714,000
大建工業	4,600	2,158.000	9,926,800
凸版印刷	110,400	1,723.000	190,219,200
大日本印刷	86,000	2,663.000	229,018,000
共同印刷	3,100	2,761.000	8,559,100
NISSHA	15,200	1,578.000	23,985,600
TAKARA & COMPANY	4,800	1,731.000	8,308,800
アシックス	64,700	2,818.000	182,324,600
ローランド	5,200	4,330.000	22,516,000
ヤマハ	43,300	5,820.000	252,006,000
河合楽器	2,400	3,210.000	7,704,000
ピジョン	44,300	2,301.000	101,934,300
キングジム	8,400	853.000	7,165,200
リンテック	15,800	2,500.000	39,500,000
イトーキ	19,700	342.000	6,737,400
任天堂	41,200	50,100.000	2,064,120,000
三菱鉛筆	12,100	1,213.000	14,677,300
タカラスタンダ - ド	16,400	1,366.000	22,402,400
コクヨ	35,100	1,656.000	58,125,600
ナカバヤシ	11,400	499.000	5,688,600
グローブライド	6,500	3,460.000	22,490,000
オカムラ	26,700	1,275.000	34,042,500
美津濃	7,400	2,131.000	15,769,400
東京電力HD	545,700	303.000	165,347,100
中部電力	221,000	1,146.000	253,266,000
関西電力	275,500	1,027.000	282,938,500
中国電力	113,700	891.000	101,306,700
北陸電力	68,200	563.000	38,396,600
東北電力	168,000	786.000	132,048,000
四国電力	66,500	755.000	50,207,500
九州電力	147,800	811.000	119,865,800
北海道電力	64,200	469.000	30,109,800
沖縄電力	15,500	1,389.000	21,529,500
電源開発	62,100	1,445.000	89,734,500
エフオン	6,400	655.000	4,192,000
イーレックス	10,900	2,558.000	27,882,200
レノバ	14,200	5,350.000	75,970,000

東京瓦斯	139,300	1,945.000	270,938,500
大阪瓦斯	131,100	1,827.000	239,519,700
東邦瓦斯	33,400	3,205.000	107,047,000
北海道瓦斯	5,500	1,471.000	8,090,500
広島ガス	20,400	351.000	7,160,400
西部ガスHLDGS	8,400	2,120.000	17,808,000
静岡ガス	18,800	968.000	18,198,400
メタウォーター	8,500	1,950.000	16,575,000
SBSホールディングス	5,200	3,465.000	18,018,000
東武鉄道	70,300	2,565.000	180,319,500
相鉄ホールディングス	23,700	1,975.000	46,807,500
東急	182,900	1,571.000	287,335,900
京浜急行	93,300	1,122.000	104,682,600
小田急電鉄	107,700	2,187.000	235,539,900
京王電鉄	37,700	5,110.000	192,647,000
京成電鉄	50,700	3,110.000	157,677,000
富士急行	8,800	4,105.000	36,124,000
新京成電鉄	3,500	1,970.000	6,895,000
東日本旅客鉄道	128,400	6,986.000	897,002,400
西日本旅客鉄道	88,400	4,898.000	432,983,200
東海旅客鉄道	60,700	15,600.000	946,920,000
西武ホールディングス	95,600	1,085.000	103,726,000
鴻池運輸	11,900	1,089.000	12,959,100
西日本鉄道	20,500	2,544.000	52,152,000
ハマキョウレックス	5,200	2,850.000	14,820,000
サカイ引越センター	3,300	4,195.000	13,843,500
近鉄グループHLDGS	68,400	3,260.000	222,984,000
阪急阪神HLDGS	85,700	3,365.000	288,380,500
南海電鉄	31,500	2,032.000	64,008,000
京阪ホールディングス	30,800	2,548.000	78,478,400
神戸電鉄	2,800	3,205.000	8,974,000
名古屋鉄道	56,500	1,660.000	93,790,000
山陽電鉄	6,700	1,930.000	12,931,000
日本通運	23,800	6,470.000	153,986,000
ヤマトホールディングス	96,600	2,504.000	241,886,400
山 九	19,100	4,510.000	86,141,000
丸全昭和運輸	5,700	3,165.000	18,040,500
センコーグループHLDGS	33,200	926.000	30,743,200
トナミホールディングス	1,900	3,520.000	6,688,000
ニッコンホールディングス	23,700	1,983.000	46,997,100
福山通運	11,200	3,760.000	42,112,000
セイノーホールディングス	46,600	1,147.000	53,450,200
神奈川中央交通	2,500	3,220.000	8,050,000
日立物流	13,600	4,630.000	62,968,000
丸和運輸機関	14,300	1,380.000	19,734,000
C&Fロジホールディングス	7,800	1,502.000	11,715,600
九州旅客鉄道	53,700	2,395.000	128,611,500
SGホールディングス	130,400	2,510.000	327,304,000

日本郵船	57,500	7,400.000	425,500,000
商船三井	38,100	6,500.000	247,650,000
川崎汽船	21,300	4,870.000	103,731,000
N S ユナイテッド海運	4,000	3,230.000	12,920,000
明治海運	9,300	686.000	6,379,800
飯野海運	33,000	517.000	17,061,000
乾汽船	5,300	2,009.000	10,647,700
日本航空	158,600	2,056.000	326,081,600
A N A ホールディングス	175,600	2,239.500	393,256,200
トランコム	2,000	8,050.000	16,100,000
日 新	6,300	1,523.000	9,594,900
三菱倉庫	22,100	2,774.000	61,305,400
三井倉庫H O L D	7,500	2,280.000	17,100,000
住友倉庫	23,700	1,817.000	43,062,900
渋沢倉庫	4,600	2,097.000	9,646,200
東陽倉庫	19,900	305.000	6,069,500
日本トランスシティ	16,400	554.000	9,085,600
川西倉庫	3,500	1,067.000	3,734,500
安田倉庫	7,400	930.000	6,882,000
東洋埠頭	5,900	1,407.000	8,301,300
上 組	37,300	2,099.000	78,292,700
近鉄エクスプレス	12,700	2,728.000	34,645,600
エーアイティー	5,900	1,139.000	6,720,100
内外トランスライン	3,200	1,826.000	5,843,200
日本コンセプト	3,000	1,644.000	4,932,000
N E C ネットエスアイ	23,200	1,809.000	41,968,800
システナ	101,200	472.000	47,766,400
デジタルアーツ	3,900	9,430.000	36,777,000
日鉄ソリューションズ	10,100	3,440.000	34,744,000
コア	4,000	1,530.000	6,120,000
ラクーンホールディングス	6,000	1,533.000	9,198,000
ソリトンシステムズ	5,000	1,197.000	5,985,000
ソフトクリエイイトHD	3,300	4,385.000	14,470,500
T I S	68,100	3,510.000	239,031,000
グリー	44,100	998.000	44,011,800
コーエーテクモHD	22,800	4,755.000	108,414,000
三菱総合研究所	3,100	3,710.000	11,501,000
ファインデックス	8,700	1,014.000	8,821,800
ブレインパッド	2,000	5,640.000	11,280,000
K L a b	15,400	556.000	8,562,400
ポールトゥウィン・ピットクル	11,600	964.000	11,182,400
ネクソン	161,400	2,254.000	363,795,600
アイスタイル	26,000	275.000	7,150,000
エムアップホールディングス	2,300	4,300.000	9,890,000
エイチーム	5,900	1,058.000	6,242,200
エニグモ	8,900	975.000	8,677,500
コロプラ	24,400	693.000	16,909,200
ブロードリーフ	37,100	480.000	17,808,000

デジタルハーツHLDGS	4,200	2,478.000	10,407,600
システム情報	7,000	880.000	6,160,000
メディアドゥ	2,700	4,575.000	12,352,500
じげん	25,200	309.000	7,786,800
ブイキューブ	7,800	1,135.000	8,853,000
フィックスターズ	10,600	831.000	8,808,600
CARTA HOLDINGS	3,500	2,130.000	7,455,000
オプティム	6,000	1,437.000	8,622,000
セレス	3,000	2,252.000	6,756,000
SHIFT	3,600	25,320.000	91,152,000
ティーガイア	7,000	1,616.000	11,312,000
テクマトリックス	12,600	1,955.000	24,633,000
ガンホー・オンライン・エンター	19,800	3,040.000	60,192,000
GMOペイメントゲートウェイ	13,900	15,230.000	211,697,000
システムリサーチ	3,100	1,826.000	5,660,600
インターネットイニシアティブ	19,100	4,860.000	92,826,000
さくらインターネット	12,800	531.000	6,796,800
GMOグローバルサインHD	1,800	3,995.000	7,191,000
SRAホールディングス	4,200	2,758.000	11,583,600
eBASE	10,200	644.000	6,568,800
アバント	8,300	1,341.000	11,130,300
アドソル日進	3,700	1,708.000	6,319,600
フリービット	5,300	1,220.000	6,466,000
コムチュア	8,000	3,535.000	28,280,000
アステリア	7,900	803.000	6,343,700
アイル	4,400	1,551.000	6,824,400
マークライズ	4,100	2,648.000	10,856,800
メディカル・データ・ビジ	10,000	1,329.000	13,290,000
gumi	11,000	816.000	8,976,000
テラスカイ	3,300	2,049.000	6,761,700
デジタル・インフォメーション	4,300	1,391.000	5,981,300
PCIホールディングス	5,900	1,140.000	6,726,000
PR TIMES	1,700	3,185.000	5,414,500
ラクス	24,700	3,070.000	75,829,000
ダブルスタンダード	2,400	3,745.000	8,988,000
オープンドア	4,700	1,827.000	8,586,900
アカツキ	3,500	2,738.000	9,583,000
UBICOMホールディングス	2,500	2,860.000	7,150,000
カナミックネットワーク	10,600	491.000	5,204,600
チェンジ	13,200	2,110.000	27,852,000
オークネット	4,500	1,686.000	7,587,000
マクロミル	17,500	919.000	16,082,500
オロ	2,600	3,400.000	8,840,000
ユーザーローカル	3,400	1,626.000	5,528,400
マネーフォワード	10,900	7,820.000	85,238,000
電算システムHD	3,300	2,255.000	7,441,500
プロトコーポレーション	8,600	1,271.000	10,930,600
野村総合研究所	138,100	4,880.000	673,928,000

インテージホールディングス	9,300	1,751.000	16,284,300
ソースネクスト	37,900	185.000	7,011,500
インフォコム	8,100	1,909.000	15,462,900
シンプレクスHD	7,400	2,790.000	20,646,000
HEROZ	2,400	1,440.000	3,456,000
ラクスル	7,900	6,260.000	49,454,000
I P S	2,700	2,022.000	5,459,400
イーソル	6,500	666.000	4,329,000
アルテリア・ネットワークス	9,800	1,539.000	15,082,200
ウイングアーク1ST	4,700	2,100.000	9,870,000
サーバーワークス	1,400	3,650.000	5,110,000
Sansan	25,600	3,130.000	80,128,000
ギフティ	6,500	2,592.000	16,848,000
ベース	1,500	4,175.000	6,262,500
フォーカスシステムズ	7,200	1,023.000	7,365,600
クレスコ	6,100	1,920.000	11,712,000
フジ・メディア・HD	69,200	1,128.000	78,057,600
オービック	22,500	20,990.000	472,275,000
ジャストシステム	10,200	5,190.000	52,938,000
TDCソフト	7,400	1,193.000	8,828,200
Zホールディングス	1,040,900	752.000	782,756,800
トレンドマイクロ	38,300	6,550.000	250,865,000
日本オラクル	14,600	11,160.000	162,936,000
アルファシステムズ	2,100	3,810.000	8,001,000
フューチャー	7,400	4,055.000	30,007,000
CAC HOLDINGS	5,300	1,497.000	7,934,100
S Bテクノロジー	3,600	2,696.000	9,705,600
オービックビジネスC	6,800	5,100.000	34,680,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,500	3,695.000	120,087,500
アイティフォー	10,400	792.000	8,236,800
大塚商会	38,600	5,190.000	200,334,000
サイボウズ	9,800	2,163.000	21,197,400
電通国際情報S	10,200	3,680.000	37,536,000
ACCESS	10,500	763.000	8,011,500
デジタルガレージ	11,900	4,980.000	59,262,000
イーエムシステムズ	14,800	695.000	10,286,000
ウェザーニューズ	2,200	9,620.000	21,164,000
C I J	7,300	805.000	5,876,500
WOWOW	4,000	2,034.000	8,136,000
スカラ	10,300	608.000	6,262,400
IMAGICA GROUP	7,300	787.000	5,745,100
ネットワンシステムズ	27,300	3,410.000	93,093,000
アルゴグラフィックス	5,700	2,841.000	16,193,700
マーベラス	14,300	716.000	10,238,800
エイベックス	13,000	1,695.000	22,035,000
日本ユニシス	22,500	3,280.000	73,800,000
兼松エレクトロニクス	3,900	3,600.000	14,040,000
都築電気	4,400	1,722.000	7,576,800

TBSホールディングス	43,700	1,715.000	74,945,500
日本テレビHLD S	59,800	1,150.000	68,770,000
朝日放送グループHD	10,900	682.000	7,433,800
テレビ朝日HD	17,600	1,492.000	26,259,200
スカパーJ S A T H D	60,700	405.000	24,583,500
テレビ東京HD	5,800	2,027.000	11,756,600
ビジョン	12,700	1,319.000	16,751,300
USEN - NEXT HLDGS	7,000	3,235.000	22,645,000
コネクシオ	5,700	1,407.000	8,019,900
日本電信電話	836,500	3,125.000	2,614,062,500
KDDI	521,600	3,300.000	1,721,280,000
ソフトバンク	1,083,900	1,562.500	1,693,593,750
光通信	8,400	16,460.000	138,264,000
エムティーアイ	10,400	584.000	6,073,600
GMOインターネット	25,700	2,858.000	73,450,600
ファイバーゲート	3,400	1,079.000	3,668,600
KADOKAWA	21,000	6,020.000	126,420,000
学研ホールディングス	11,100	978.000	10,855,800
ゼンリン	13,600	935.000	12,716,000
アイネット	5,800	1,300.000	7,540,000
松竹	4,900	10,960.000	53,704,000
東宝	42,200	5,050.000	213,110,000
東映	2,300	18,600.000	42,780,000
NTTデータ	190,000	2,394.000	454,860,000
ピー・シー・エー	4,900	1,463.000	7,168,700
ビジネスB太田昭和	3,300	1,964.000	6,481,200
DTS	13,100	2,367.000	31,007,700
スクウェア・エニックス・HD	33,300	5,930.000	197,469,000
シーイーシー	8,800	1,242.000	10,929,600
カプコン	67,400	2,829.000	190,674,600
アイ・エス・ビー	4,700	1,013.000	4,761,100
ジャステック	5,900	1,018.000	6,006,200
SCSK	49,600	2,155.000	106,888,000
日本システムウエア	3,300	2,152.000	7,101,600
アイネス	7,600	1,390.000	10,564,000
TKC	11,900	3,290.000	39,151,000
富士ソフト	7,600	5,280.000	40,128,000
NSD	22,800	2,117.000	48,267,600
コナミホールディングス	26,100	5,810.000	151,641,000
福井コンピュータHLD S	3,700	3,820.000	14,134,000
JBC Cホールディングス	5,900	1,763.000	10,401,700
ミロク情報サービス	7,600	1,464.000	11,126,400
ソフトバンクグループ	429,100	6,030.000	2,587,473,000
伊藤忠食品	2,000	4,905.000	9,810,000
エレマテック	7,000	1,009.000	7,063,000
あらた	5,600	3,850.000	21,560,000
トーメンデバイス	1,200	6,720.000	8,064,000
東京エレクトロンデバイス	2,100	6,770.000	14,217,000

フィールズ	10,000	532.000	5,320,000
双日	78,900	1,606.000	126,713,400
アルフレッサホールディングス	79,700	1,538.000	122,578,600
横浜冷凍	21,500	803.000	17,264,500
アルコニックス	7,900	1,175.000	9,282,500
神戸物産	55,700	4,280.000	238,396,000
あい ホールディングス	10,600	1,938.000	20,542,800
ダイワボウHD	34,800	1,809.000	62,953,200
マクニカ・富士エレHLDGS	16,900	2,558.000	43,230,200
ラクト・ジャパン	2,800	2,336.000	6,540,800
グリムス	3,300	2,525.000	8,332,500
バイタルKSKHD	14,700	765.000	11,245,500
八洲電機	8,400	900.000	7,560,000
レスターホールディングス	6,600	1,852.000	12,223,200
ジューテックHD	3,100	1,033.000	3,202,300
TOKAIホールディングス	33,600	826.000	27,753,600
三洋貿易	8,900	969.000	8,624,100
ビューティガレージ	1,500	3,735.000	5,602,500
ウイン・パートナーズ	5,600	940.000	5,264,000
シップヘルスケアHD	22,900	2,530.000	57,937,000
コメダホールディングス	16,300	1,944.000	31,687,200
アセンテック	3,700	1,167.000	4,317,900
フルサト・マルカHD	7,100	1,999.000	14,192,900
ヤマエグループHD	6,200	1,003.000	6,218,600
小野建	7,300	1,572.000	11,475,600
佐島電機	6,200	931.000	5,772,200
伯東	4,800	2,225.000	10,680,000
コンドーテック	7,600	960.000	7,296,000
ナガイレーベン	9,800	2,342.000	22,951,600
三菱食品	6,400	2,690.000	17,216,000
松田産業	5,300	2,701.000	14,315,300
第一興商	13,900	3,580.000	49,762,000
メディパルHD	77,100	2,040.000	157,284,000
SPK	5,300	1,300.000	6,890,000
萩原電気HLDGS	3,500	1,992.000	6,972,000
アズワン	5,100	14,050.000	71,655,000
尾家産業	5,000	1,046.000	5,230,000
シモジマ	6,300	1,079.000	6,797,700
ドウシシャ	7,500	1,468.000	11,010,000
高速	5,200	1,473.000	7,659,600
丸文	8,600	856.000	7,361,600
ハピネット	6,900	1,429.000	9,860,100
日本ライフライン	21,900	1,058.000	23,170,200
タカショー	7,400	715.000	5,291,000
IDOM	22,500	689.000	15,502,500
進和	5,000	1,940.000	9,700,000
ダイترون	3,600	2,014.000	7,250,400
シークス	11,100	1,331.000	14,774,100

オーハシテクニカ	5,400	1,469.000	7,932,600
白銅	2,800	2,355.000	6,594,000
伊藤忠	501,700	3,260.000	1,635,542,000
丸紅	706,900	1,017.500	719,270,750
長瀬産業	39,200	1,683.000	65,973,600
蝶理	4,800	1,712.000	8,217,600
豊田通商	71,900	4,955.000	356,264,500
三共生興	12,800	547.000	7,001,600
兼松	25,500	1,231.000	31,390,500
三井物産	557,000	2,557.000	1,424,249,000
日本紙パルプ	3,900	3,575.000	13,942,500
カメイ	8,800	992.000	8,729,600
スターゼン	5,900	1,844.000	10,879,600
山善	28,600	972.000	27,799,200
椿本興業	1,800	3,880.000	6,984,000
住友商事	452,500	1,546.000	699,565,000
内田洋行	3,200	4,635.000	14,832,000
三菱商事	537,700	3,391.000	1,823,340,700
第一実業	3,300	4,890.000	16,137,000
キヤノンマーケティングJPN	17,700	2,200.000	38,940,000
西華産業	5,200	1,507.000	7,836,400
佐藤商事	6,900	1,063.000	7,334,700
菱洋エレクトロ	5,400	2,249.000	12,144,600
東京産業	8,500	739.000	6,281,500
ユアサ商事	6,600	2,797.000	18,460,200
神鋼商事	2,000	3,145.000	6,290,000
阪和興業	14,100	3,070.000	43,287,000
正栄食品	4,600	3,775.000	17,365,000
カナデン	7,700	986.000	7,592,200
菱電商事	6,500	1,677.000	10,900,500
岩谷産業	17,100	5,730.000	97,983,000
ナイス	3,000	1,612.000	4,836,000
極東貿易	2,700	2,332.000	6,296,400
アステナホールディングス	12,100	486.000	5,880,600
三愛石油	17,700	1,184.000	20,956,800
稲畑産業	14,700	1,529.000	22,476,300
G S Iクレオス	5,400	1,021.000	5,513,400
明和産業	7,000	819.000	5,733,000
ワキタ	15,600	1,026.000	16,005,600
東邦ホールディングス	23,000	1,692.000	38,916,000
サンゲツ	20,200	1,519.000	30,683,800
ミツウロコグループ	10,900	1,165.000	12,698,500
シナネンホールディングス	3,000	3,420.000	10,260,000
伊藤忠エネクス	14,900	951.000	14,169,900
サンリオ	22,600	2,479.000	56,025,400
サンワテクノス	5,100	1,675.000	8,542,500
リョーサン	8,100	2,108.000	17,074,800
新光商事	12,700	873.000	11,087,100

トーホー	5,200	1,375.000	7,150,000
三信電気	4,400	1,395.000	6,138,000
東陽テクニカ	8,700	1,077.000	9,369,900
モスフード サービス	9,400	3,055.000	28,717,000
加賀電子	6,500	2,932.000	19,058,000
ソーダニツカ	10,900	676.000	7,368,400
立花エレテック	6,200	1,519.000	9,417,800
PALTAC	10,100	4,405.000	44,490,500
太平洋興発	7,700	591.000	4,550,700
西本WISMETTAC HD	2,000	3,220.000	6,440,000
コア商事HLDGS	7,700	593.000	4,566,100
国際紙パルプ商事	17,800	311.000	5,535,800
ヤマタネ	4,700	1,516.000	7,125,200
日鉄物産	4,900	4,605.000	22,564,500
泉州電業	2,200	4,590.000	10,098,000
トラスコ中山	14,500	2,631.000	38,149,500
オートボックスセブン	24,800	1,309.000	32,463,200
モリト	9,500	641.000	6,089,500
加藤産業	9,700	3,170.000	30,749,000
イノテック	5,500	1,354.000	7,447,000
イエローハット	12,200	1,550.000	18,910,000
JKホールディングス	6,800	1,030.000	7,004,000
日伝	6,000	2,180.000	13,080,000
杉本商事	4,200	2,090.000	8,778,000
因幡電機産業	18,600	2,459.000	45,737,400
東テク	3,000	2,325.000	6,975,000
ミスミグループ本社	90,000	4,785.000	430,650,000
タキヒヨー	3,800	1,690.000	6,422,000
スズケン	28,200	3,085.000	86,997,000
ジェコス	7,500	768.000	5,760,000
ローソン	15,900	5,540.000	88,086,000
サンエー	5,000	3,990.000	19,950,000
カワチ薬品	5,900	2,159.000	12,738,100
エービーシー・マート	11,100	5,340.000	59,274,000
アスクル	11,900	1,419.000	16,886,100
ゲオホールディングス	10,200	1,189.000	12,127,800
アダストリア	7,900	1,863.000	14,717,700
くら寿司	7,500	3,740.000	28,050,000
キャンドゥ	3,900	2,315.000	9,028,500
パルグループHLDGS	7,000	1,546.000	10,822,000
エディオン	30,800	999.000	30,769,200
サーラコーポレーション	16,500	569.000	9,388,500
ハローズ	3,400	2,647.000	8,999,800
フジオフードG本社	7,900	1,344.000	10,617,600
あみやき亭	2,700	2,870.000	7,749,000
大黒天物産	2,400	6,120.000	14,688,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,000.000	7,100,000
アルペン	5,700	2,174.000	12,391,800

クオールホールディングス	9,300	1,381.000	12,843,300
ジーンズホールディングス	5,000	6,450.000	32,250,000
ビックカメラ	41,500	937.000	38,885,500
DCMホールディングス	43,300	1,051.000	45,508,300
MonotaRO	90,900	2,256.000	205,070,400
アークランドサービスHD	6,100	2,254.000	13,749,400
J. フロント リテイリング	86,300	932.000	80,431,600
ドトール・日レスHD	12,200	1,517.000	18,507,400
マツキヨココカラ&カンパニー	44,000	4,450.000	195,800,000
ブロンコビリー	5,100	2,278.000	11,617,800
ZOZO	49,600	3,615.000	179,304,000
物語コーポレーション	3,800	7,250.000	27,550,000
三越伊勢丹HD	125,500	776.000	97,388,000
ウエルシアHD	37,900	4,025.000	152,547,500
クリエイイトSDH	10,200	3,120.000	31,824,000
チムニー	4,800	1,229.000	5,899,200
シュッピン	7,100	973.000	6,908,300
オイシックス・ラ・大地	10,300	3,340.000	34,402,000
ネクステージ	14,400	2,290.000	32,976,000
ジョイフル本田	20,100	1,560.000	31,356,000
鳥貴族ホールディングス	3,600	1,655.000	5,958,000
ホットランド	7,600	1,300.000	9,880,000
すかいらくHD	93,100	1,469.000	136,763,900
SFPホールディングス	5,100	1,301.000	6,635,100
綿半ホールディングス	7,000	1,215.000	8,505,000
ユナイテッド・スーパーマーケット	19,400	1,000.000	19,400,000
ゴルフダイジェスト・オン	5,000	1,009.000	5,045,000
BEENOS	4,000	2,732.000	10,928,000
あさひ	6,300	1,284.000	8,089,200
日本調剤	5,200	1,267.000	6,588,400
コスモス薬品	7,200	17,610.000	126,792,000
セブン&アイ・HLDS	280,900	4,554.000	1,279,218,600
クリエイイト・レストランツ・ホール	38,800	680.000	26,384,000
ツルハホールディングス	15,600	12,800.000	199,680,000
サンマルクホールディングス	7,700	1,408.000	10,841,600
トリドールホールディングス	17,700	2,421.000	42,851,700
TOKYO BASE	8,300	669.000	5,552,700
JMホールディングス	5,600	1,722.000	9,643,200
アレンザホールディングス	6,400	1,021.000	6,534,400
串カツ田中HLDS	2,500	1,933.000	4,832,500
パロックジャパン	7,700	824.000	6,344,800
クスリのアオキHLDS	7,200	7,190.000	51,768,000
FOOD&LIFE COMPAN	42,000	4,825.000	202,650,000
メディカルシステムネットワーク	8,600	620.000	5,332,000
ノジマ	11,500	2,225.000	25,587,500
カップ・クリエイト	11,300	1,327.000	14,995,100
良品計画	82,700	1,835.000	151,754,500
アドヴァングループ	9,400	883.000	8,300,200

アルビス	3,300	2,114.000	6,976,200
G - 7ホールディングス	8,100	1,654.000	13,397,400
イオン北海道	13,200	1,334.000	17,608,800
コジマ	13,400	556.000	7,450,400
コーナン商事	10,300	3,320.000	34,196,000
エコス	3,300	1,748.000	5,768,400
ワタミ	10,400	850.000	8,840,000
パンパシフィックHD	143,500	1,936.000	277,816,000
西松屋チェーン	15,700	1,497.000	23,502,900
ゼンショーホールディングス	35,400	2,581.000	91,367,400
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,413.000	9,608,400
サイゼリヤ	10,900	2,926.000	31,893,400
V Tホールディングス	27,900	421.000	11,745,900
フジ・コーポレーション	5,600	1,164.000	6,518,400
ユナイテッドアローズ	7,800	1,903.000	14,843,400
ハイデイ日高	10,300	1,571.000	16,181,300
コロワイド	30,200	1,522.000	45,964,400
壱番屋	5,200	4,435.000	23,062,000
スギホールディングス	14,400	7,140.000	102,816,000
薬王堂ホールディングス	3,900	2,138.000	8,338,200
スクロール	11,900	767.000	9,127,300
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,595.000	12,122,000
木曽路	10,000	2,088.000	20,880,000
S R Sホールディングス	14,600	742.000	10,833,200
千趣会	17,900	388.000	6,945,200
リテールパートナーズ	9,600	1,212.000	11,635,200
ケーヨー	15,200	803.000	12,205,600
上新電機	7,800	2,048.000	15,974,400
日本瓦斯	34,900	1,417.000	49,453,300
ロイヤルホールディングス	12,700	1,819.000	23,101,300
いなげや	9,300	1,301.000	12,099,300
チヨダ	12,100	702.000	8,494,200
ライフコーポレーション	6,700	3,355.000	22,478,500
リンガーハット	9,700	2,136.000	20,719,200
MrMaxHD	11,600	529.000	6,136,400
AOKIホールディングス	15,600	614.000	9,578,400
オークワ	12,500	955.000	11,937,500
コメリ	10,700	2,444.000	26,150,800
青山商事	17,100	719.000	12,294,900
しまむら	8,300	9,700.000	80,510,000
高島屋	52,700	995.000	52,436,500
松屋	15,400	838.000	12,905,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	33,200	790.000	26,228,000
近鉄百貨店	3,400	2,428.000	8,255,200
丸井グループ	61,000	2,086.000	127,246,000
アクシアルリテイリング	5,500	3,260.000	17,930,000
イオン	276,100	2,644.500	730,146,450
イズミ	13,100	3,145.000	41,199,500

平和堂	12,500	1,853.000	23,162,500
フジ	8,700	1,920.000	16,704,000
ヤオコー	8,200	6,690.000	54,858,000
ゼビオホールディングス	10,600	879.000	9,317,400
ケーズホールディングス	65,700	1,149.000	75,489,300
日産東京販売HD	21,500	225.000	4,837,500
GENKY DRUGSTORES	3,200	5,120.000	16,384,000
ブックオフGHD	5,600	970.000	5,432,000
ギフト	1,600	2,636.000	4,217,600
アインホールディングス	10,600	6,110.000	64,766,000
元気寿司	2,800	2,446.000	6,848,800
ヤマダホールディングス	263,400	396.000	104,306,400
アークランドサカモト	11,500	1,659.000	19,078,500
ニトリホールディングス	28,600	18,030.000	515,658,000
グルメ杵屋	10,800	982.000	10,605,600
吉野家ホールディングス	25,600	2,225.000	56,960,000
松屋フーズHLDGS	3,600	3,430.000	12,348,000
サガミホールディングス	13,700	991.000	13,576,700
関西スーパーマーケット	5,900	1,834.000	10,820,600
王将フードサービス	4,700	5,780.000	27,166,000
プレナス	8,300	1,935.000	16,060,500
ミニストップ	6,600	1,361.000	8,982,600
アークス	13,100	2,067.000	27,077,700
バローホールディングス	15,400	2,116.000	32,586,400
ベルク	3,200	5,260.000	16,832,000
ファーストリテイリング	9,600	67,400.000	647,040,000
サンドラッグ	27,000	2,989.000	80,703,000
ベルーナ	16,700	667.000	11,138,900
めぶきフィナンシャルG	369,600	224.000	82,790,400
東京きらぼしFG	9,700	1,393.000	13,512,100
九州フィナンシャルG	141,400	380.000	53,732,000
ゆうちょ銀行	168,200	928.000	156,089,600
富山第一銀行	16,800	266.000	4,468,800
コンコルディア・フィナンシャル	406,800	413.000	168,008,400
西日本フィナンシャルHD	47,000	682.000	32,054,000
33FG	8,700	1,355.000	11,788,500
第四北越フィナンシャルG	11,700	2,300.000	26,910,000
ひろぎんHLDGS	106,200	622.000	66,056,400
おきなわFG	7,000	2,066.000	14,462,000
十六FG	10,100	1,976.000	19,957,600
北国FHD	7,400	2,114.000	15,643,600
新生銀行	46,700	1,916.000	89,477,200
あおぞら銀行	39,400	2,472.000	97,396,800
三菱UFJフィナンシャルG	4,609,100	601.400	2,771,912,740
りそなホールディングス	822,500	415.600	341,831,000
三井住友トラストHD	135,100	3,560.000	480,956,000
三井住友フィナンシャルG	497,600	3,703.000	1,842,612,800
千葉銀行	240,400	661.000	158,904,400

群馬銀行	133,900	331.000	44,320,900
武蔵野銀行	11,200	1,558.000	17,449,600
七十七銀行	22,900	1,156.000	26,472,400
青森銀行	5,600	1,593.000	8,920,800
秋田銀行	4,300	1,430.000	6,149,000
山形銀行	10,600	811.000	8,596,600
岩手銀行	6,000	1,610.000	9,660,000
東邦銀行	73,100	194.000	14,181,400
東北銀行	4,000	964.000	3,856,000
みちのく銀行	4,500	731.000	3,289,500
ふくおかフィナンシャルG	59,800	1,838.000	109,912,400
静岡銀行	173,800	800.000	139,040,000
スルガ銀行	63,400	471.000	29,861,400
八十二銀行	155,600	356.000	55,393,600
山梨中央銀行	10,800	788.000	8,510,400
大垣共立銀行	14,200	1,771.000	25,148,200
福井銀行	8,000	1,332.000	10,656,000
清水銀行	4,400	1,516.000	6,670,400
富山銀行	2,400	1,696.000	4,070,400
滋賀銀行	13,500	1,751.000	23,638,500
南都銀行	11,600	1,790.000	20,764,000
百五銀行	69,900	318.000	22,228,200
京都銀行	25,500	4,825.000	123,037,500
紀陽銀行	25,100	1,359.000	34,110,900
ほくほくフィナンシャルG	44,600	770.000	34,342,000
山陰合同銀行	43,900	564.000	24,759,600
中国銀行	55,900	836.000	46,732,400
伊予銀行	91,900	524.000	48,155,600
百十四銀行	9,200	1,350.000	12,420,000
四国銀行	13,400	704.000	9,433,600
阿波銀行	11,300	2,035.000	22,995,500
大分銀行	5,500	1,680.000	9,240,000
宮崎銀行	5,400	1,952.000	10,540,800
佐賀銀行	4,500	1,408.000	6,336,000
琉球銀行	18,200	712.000	12,958,400
セブン銀行	210,500	228.000	47,994,000
みずほフィナンシャルG	919,400	1,402.000	1,288,998,800
山口フィナンシャルG	83,100	621.000	51,605,100
名古屋銀行	5,800	2,193.000	12,719,400
北洋銀行	109,800	231.000	25,363,800
愛知銀行	2,900	3,505.000	10,164,500
中京銀行	4,700	1,185.000	5,569,500
愛媛銀行	13,100	720.000	9,432,000
京葉銀行	33,500	422.000	14,137,000
栃木銀行	46,000	174.000	8,004,000
東和銀行	17,400	480.000	8,352,000
トモニホールディングス	60,300	291.000	17,547,300
フィデアホール	8,500	1,197.000	10,174,500

池田泉州HD	94,200	149.000	14,035,800
F P G	26,400	551.000	14,546,400
ジャパンインベストメントA	6,700	1,143.000	7,658,100
S B Iホールディングス	88,200	2,924.000	257,896,800
ジャフコ グループ	9,200	7,120.000	65,504,000
大和証券G本社	538,100	630.900	339,487,290
野村ホールディングス	1,098,600	477.400	524,471,640
岡三証券グループ	56,700	369.000	20,922,300
丸三証券	24,300	499.000	12,125,700
東海東京HD	79,200	372.000	29,462,400
水戸証券	24,700	269.000	6,644,300
いちよし証券	16,300	619.000	10,089,700
松井証券	35,300	781.000	27,569,300
マネックスG	58,600	931.000	54,556,600
極東証券	9,700	732.000	7,100,400
岩井コスモホールディング	8,100	1,292.000	10,465,200
アイザワ証券グループ	12,500	986.000	12,325,000
スパークス・グループ	38,700	312.000	12,074,400
かんぼ生命保険	72,500	1,758.000	127,455,000
S O M P Oホールディングス	126,800	4,674.000	592,663,200
アニコム ホールディングス	22,200	777.000	17,249,400
M S & A D	161,000	3,316.000	533,876,000
第一生命H L D G S	353,900	2,287.000	809,369,300
東京海上HD	236,700	5,708.000	1,351,083,600
T & Dホールディングス	186,200	1,342.000	249,880,400
アドバンスクリエイイト	4,000	981.000	3,924,000
全国保証	17,300	4,960.000	85,808,000
ジェイリース	2,800	2,055.000	5,754,000
イントラスト	5,100	725.000	3,697,500
日本モーゲージサービス	4,100	1,038.000	4,255,800
アルヒ	12,200	1,001.000	12,212,200
プレミアグループ	4,200	3,500.000	14,700,000
クレディセゾン	45,800	1,124.000	51,479,200
芙蓉総合リース	7,400	7,180.000	53,132,000
みずほリース	11,100	2,964.000	32,900,400
東京センチュリー	13,700	5,420.000	74,254,000
日本証券金融	29,400	814.000	23,931,600
アイフル	121,500	352.000	42,768,000
リコーリース	6,800	3,615.000	24,582,000
イオンフィナンシャルサービス	38,500	1,227.000	47,239,500
ア コ ム	141,900	337.000	47,820,300
ジャックス	8,200	2,753.000	22,574,600
オ リ コ	196,900	124.000	24,415,600
オリックス	436,700	2,245.000	980,391,500
三菱H C キャピタル	261,000	534.000	139,374,000
日本取引所グループ	181,900	2,459.000	447,292,100
イー・ギャランティ	11,200	2,457.000	27,518,400
N E C キャピタルソリューション	3,400	1,914.000	6,507,600

いちご	83,300	284.000	23,657,200
日本駐車場開発	93,100	136.000	12,661,600
スター・マイカ・HLDGS	5,200	1,239.000	6,442,800
SREホールディングス	1,900	9,050.000	17,195,000
ヒューリック	170,800	1,076.000	183,780,800
三栄建築設計	3,900	1,621.000	6,321,900
野村不動産HLDGS	38,100	2,465.000	93,916,500
三重交通グループHD	18,400	456.000	8,390,400
サムティ	10,100	2,286.000	23,088,600
ディア・ライフ	12,800	526.000	6,732,800
日本商業開発	7,000	1,691.000	11,837,000
プレサンスコーポレーション	10,800	1,714.000	18,511,200
日本管理センター	5,600	1,022.000	5,723,200
フージャースHD	13,300	630.000	8,379,000
オープンハウス	22,800	6,440.000	146,832,000
東急不動産HD	210,200	586.000	123,177,200
飯田GHD	60,200	2,348.000	141,349,600
シーアールイー	3,100	1,673.000	5,186,300
ケイアイスター不動産	3,400	8,530.000	29,002,000
グッドコムアセット	4,400	1,209.000	5,319,600
ジェイ・エス・ビー	2,100	2,734.000	5,741,400
パーク24	38,900	1,610.000	62,629,000
パラカ	4,400	1,506.000	6,626,400
宮越ホールディングス	4,300	1,203.000	5,172,900
三井不動産	327,600	2,336.000	765,273,600
三菱地所	471,900	1,565.000	738,523,500
平和不動産	13,000	3,400.000	44,200,000
東京建物	71,000	1,608.000	114,168,000
ダイビル	18,900	1,464.000	27,669,600
京阪神ビルディング	12,900	1,377.000	17,763,300
住友不動産	150,800	3,539.000	533,681,200
テーオーシー	16,200	556.000	9,007,200
東京楽天地	2,100	3,980.000	8,358,000
スターツコーポレーション	10,400	2,429.000	25,261,600
フジ住宅	11,600	664.000	7,702,400
空港施設	13,200	525.000	6,930,000
ゴールドクレスト	6,900	1,492.000	10,294,800
日神グループHLDGS	15,400	465.000	7,161,000
日本エスコン	16,100	750.000	12,075,000
タカラレーベン	37,400	266.000	9,948,400
AVANTIA	7,800	828.000	6,458,400
イオンモール	35,800	1,607.000	57,530,600
カチタス	18,200	4,190.000	76,258,000
トーセイ	11,500	963.000	11,074,500
サンフロンティア不動産	11,700	958.000	11,208,600
FJネクストホールディングス	8,800	973.000	8,562,400
日本空港ビルデング	27,500	5,000.000	137,500,000
日本工営	4,300	3,170.000	13,631,000

LIFULL	27,100	258.000	6,991,800
ミクシィ	16,000	2,021.000	32,336,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	1,988.000	12,126,800
日本M&Aセンターホールディングス	114,500	3,335.000	381,857,500
メンバーズ	2,600	2,333.000	6,065,800
UTグループ	10,100	4,050.000	40,905,000
アイティメディア	3,900	2,006.000	7,823,400
E・Jホールディングス	4,800	1,179.000	5,659,200
夢真ビーネックスグループ	18,800	1,666.000	31,320,800
コシダカホールディングス	19,200	598.000	11,481,600
パソナグループ	7,500	3,545.000	26,587,500
リンクアンドモチベーション	16,600	707.000	11,736,200
エス・エム・エス	23,900	4,235.000	101,216,500
パーソルホールディングス	69,700	3,280.000	228,616,000
リニカル	6,800	851.000	5,786,800
クックパッド	29,600	256.000	7,577,600
スタジオアリス	4,000	2,022.000	8,088,000
シミックホールディングス	5,400	1,546.000	8,348,400
総合警備保障	27,600	4,840.000	133,584,000
カカクコム	51,700	3,175.000	164,147,500
アイロムグループ	3,200	1,709.000	5,468,800
ルネサンス	6,700	1,129.000	7,564,300
ディップ	12,300	3,980.000	48,954,000
デジタルホールディングス	5,400	1,390.000	7,506,000
新日本科学	9,200	1,615.000	14,858,000
ベネフィット・ワン	25,300	5,320.000	134,596,000
エムスリー	123,000	6,119.000	752,637,000
アウトソーシング	40,400	1,504.000	60,761,600
ウェルネット	15,200	449.000	6,824,800
ワールドホールディングス	3,200	2,529.000	8,092,800
ディー・エヌ・エー	27,000	1,680.000	45,360,000
博報堂DYHLDGS	96,800	1,693.000	163,882,400
ぐるなび	14,700	469.000	6,894,300
タカミヤ	14,900	430.000	6,407,000
ジャパンベストレスキューS	5,700	955.000	5,443,500
ファンコミュニケーションズ	23,300	404.000	9,413,200
エスプール	19,800	1,275.000	25,245,000
WDBホールディングス	3,500	3,125.000	10,937,500
手間いらず	1,100	5,160.000	5,676,000
アドウェイズ	11,500	763.000	8,774,500
バリューコマース	5,500	4,520.000	24,860,000
インフォマート	77,100	1,026.000	79,104,600
J Pホールディングス	26,300	245.000	6,443,500
プレステージ・インター	26,800	690.000	18,492,000
アミューズ	4,700	1,895.000	8,906,500
クイック	6,100	1,403.000	8,558,300
電通グループ	71,900	3,610.000	259,559,000
ぴあ	2,800	3,770.000	10,556,000

イオンファンタジー	3,700	1,738.000	6,430,600
シーティーエス	9,800	779.000	7,634,200
H UグループHD	18,600	2,862.000	53,233,200
アルプス技研	6,800	1,870.000	12,716,000
日本空調サービス	10,000	779.000	7,790,000
オリエンタルランド	82,300	17,840.000	1,468,232,000
ダスキン	16,500	2,617.000	43,180,500
明光ネットワークジャパン	12,300	541.000	6,654,300
ファルコホールディングス	4,500	1,693.000	7,618,500
ラウンドワン	19,800	1,309.000	25,918,200
リゾートトラスト	32,500	1,860.000	60,450,000
ピー・エム・エル	9,000	3,530.000	31,770,000
りらいあコミュニケーション	11,500	1,009.000	11,603,500
リソー教育	33,800	405.000	13,689,000
ユー・エス・エス	78,200	1,666.000	130,281,200
東京個別指導学院	8,500	624.000	5,304,000
サイバーエージェント	172,000	2,093.000	359,996,000
楽天グループ	358,300	1,161.000	415,986,300
クリーク・アンド・リバー社	4,200	1,999.000	8,395,800
モーニングスター	16,600	604.000	10,026,400
山田コンサルティングG P	5,000	1,113.000	5,565,000
セントラルスポーツ	3,900	2,343.000	9,137,700
フルキャストホールディングス	6,100	2,648.000	16,152,800
エン・ジャパン	11,300	3,540.000	40,002,000
テクノプロ・ホールディング	41,900	3,120.000	130,728,000
アイ・アールジャパンHD	3,300	7,090.000	23,397,000
K e e P e r 技研	4,600	2,574.000	11,840,400
イー・ガーディアン	3,300	3,485.000	11,500,500
ジャパンマテリアル	21,500	1,552.000	33,368,000
ベクトル	10,500	1,249.000	13,114,500
チャームケアコーポレーション	6,000	1,482.000	8,892,000
キャリアリンク	3,400	1,264.000	4,297,600
I B J	7,400	1,020.000	7,548,000
アサンテ	5,200	1,689.000	8,782,800
バリューHR	4,000	2,506.000	10,024,000
M & Aキャピタルパートナー	5,700	5,500.000	31,350,000
ライドオンエクスプレスHD	4,000	1,713.000	6,852,000
E R Iホールディングス	2,600	1,386.000	3,603,600
シグマクシス・ホールディング	4,500	2,801.000	12,604,500
ウィルグループ	6,100	1,360.000	8,296,000
メドピア	5,400	3,575.000	19,305,000
リクルートホールディングス	537,400	6,901.000	3,708,597,400
エラン	9,700	1,239.000	12,018,300
日本郵政	910,100	856.000	779,045,600
ベルシステム24H L D G S	10,300	1,255.000	12,926,500
鎌倉新書	9,200	775.000	7,130,000
エアトリ	4,700	3,155.000	14,828,500
アトラエ	5,600	2,481.000	13,893,600

ストライク	2,900	5,660.000	16,414,000
ソラスト	17,300	1,234.000	21,348,200
セラク	2,800	1,758.000	4,922,400
インソース	7,000	2,453.000	17,171,000
ベйкаレントコンサルティング	4,900	47,300.000	231,770,000
ORCHESTRA HLDGS	1,800	3,970.000	7,146,000
アイモバイル	2,800	1,281.000	3,586,800
グレイステクノロジー	11,900	422.000	5,021,800
ジャパンエレベーターSHD	21,900	2,125.000	46,537,500
ウェルビー	5,600	1,389.000	7,778,400
エル・ティー・エス	1,300	2,736.000	3,556,800
ミダックホールディングス	3,100	4,965.000	15,391,500
日総工産	7,700	808.000	6,221,600
キュービーネットHLDGS	4,400	1,653.000	7,273,200
RPAホールディングス	12,100	372.000	4,501,200
マネジメントソリューションズ	3,600	3,260.000	11,736,000
カーブスホールディングス	19,700	774.000	15,247,800
ダイレクトマーケティングミクス	4,000	3,840.000	15,360,000
ポピンズホールディング	2,100	3,105.000	6,520,500
LITALICO	5,900	4,190.000	24,721,000
アドバンテッジリスクマネ	5,700	657.000	3,744,900
リロググループ	38,600	2,093.000	80,789,800
東祥	6,000	1,674.000	10,044,000
TREホールディングス	9,800	1,775.000	17,395,000
人・夢・技術グループ	3,500	1,813.000	6,345,500
エイチ・アイ・エス	15,600	1,941.000	30,279,600
ラックランド	3,700	2,908.000	10,759,600
共立メンテナンス	12,500	3,995.000	49,937,500
イチネンホールディングス	8,200	1,300.000	10,660,000
建設技術研究所	4,600	2,364.000	10,874,400
燦ホールディングス	4,400	1,386.000	6,098,400
東京テアトル	6,100	1,209.000	7,374,900
ナガワ	2,200	11,420.000	25,124,000
東京都競馬	5,300	3,990.000	21,147,000
カナモト	12,200	2,154.000	26,278,800
西尾レントオール	6,500	2,519.000	16,373,500
トランス・コスモス	9,000	3,150.000	28,350,000
乃村工藝社	30,100	1,003.000	30,190,300
日本管財	7,200	2,736.000	19,699,200
トーカイ	6,100	1,949.000	11,888,900
セコム	68,700	7,664.000	526,516,800
セントラル警備保障	3,900	2,407.000	9,387,300
丹青社	15,500	810.000	12,555,000
メイテック	8,600	6,660.000	57,276,000
応用地質	7,600	1,963.000	14,918,800
船井総研ホールディン	14,400	2,559.000	36,849,600
オオバ	8,100	760.000	6,156,000
ベネッセホールディングス	23,800	2,199.000	52,336,200

イオンディライト	8,500	3,545.000	30,132,500	
ダイセキ	12,800	5,160.000	66,048,000	
合 計	78,890,900		192,569,963,990	

(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。

2.2.5 マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

資産の部		
流動資産		
金銭信託		137,347,416
コール・ローン		4,050,827,173
株式		97,883,970,640
未収配当金		527,630,760
前払金		128,810,000
差入委託証拠金		47,138,000
流動資産合計		102,775,723,989
資産合計		102,775,723,989
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		255,324,100
未払解約金		6,001,902
その他未払費用		9,485
流動負債合計		261,335,487
負債合計		261,335,487
純資産の部		
元本等		
元本		28,339,379,860
剰余金		
剰余金又は欠損金()		74,175,008,642
元本等合計		102,514,388,502
純資産合計		102,514,388,502
負債純資産合計		102,775,723,989

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: right;">株式 674,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	28,339,379,860口
3. 1単位あたり純資産の額	<p>1口あたり純資産額 3.6174円 (1万口当たりの純資産額36,174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 2021年8月23日 至 2021年11月30日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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、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おります。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	(2021年11月30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)

(2021年11月30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				
	NK225 先物 0312 月	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
	小計	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
合計		4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	29,682,506,040円
同期中における追加設定元本額	3,707,289,842円
同期中における一部解約元本額	5,050,416,022円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	25,535,238,425円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,411,662,592円
S M B C ・ D C インデックスファンド(日経225)	281,684,884円
三井住友D S ・ 日経225インデックス・ファンド	19,228,634円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	91,565,325円
合 計	28,339,379,860円

(3) 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	
日本水産	124,000	573.000	71,052,000	
マル八ニチロ	12,400	2,277.000	28,234,800	
I N P E X	49,600	937.000	46,475,200	
コムシスホールディングス	124,000	2,476.000	307,024,000	
大成建設	24,800	3,310.000	82,088,000	
大林組	124,000	836.000	103,664,000	
清水建設	124,000	717.000	88,908,000	
長谷工コーポレーション	24,800	1,354.000	33,579,200	
鹿島建設	62,000	1,251.000	77,562,000	
大和ハウス	124,000	3,316.000	411,184,000	
積水ハウス	124,000	2,210.000	274,040,000	
日揮ホールディングス	124,000	957.000	118,668,000	
日清製粉G本社	124,000	1,636.000	202,864,000	
明治ホールディングス	24,800	6,660.000	165,168,000	
日本ハム	62,000	3,870.000	239,940,000	
サッポロホールディングス	24,800	2,180.000	54,064,000	
アサヒグループホールディン	124,000	4,194.000	520,056,000	

キリンHD	124,000	1,817.000	225,308,000
宝ホールディングス	124,000	1,220.000	151,280,000
キッコーマン	124,000	8,660.000	1,073,840,000
味の素	124,000	3,407.000	422,468,000
ニチレイ	62,000	2,601.000	161,262,000
日本たばこ産業	124,000	2,273.500	281,914,000
東洋紡	12,400	1,195.000	14,818,000
ユニチカ	12,400	289.000	3,583,600
帝人	24,800	1,301.000	32,264,800
東レ	124,000	660.800	81,939,200
王子ホールディングス	124,000	525.000	65,100,000
日本製紙	12,400	1,066.000	13,218,400
クラレ	124,000	944.000	117,056,000
旭化成	124,000	1,071.500	132,866,000
昭和電工	12,400	2,502.000	31,024,800
住友化学	124,000	524.000	64,976,000
日産化学	124,000	6,540.000	810,960,000
東ソー	62,000	1,631.000	101,122,000
トクヤマ	24,800	1,784.000	44,243,200
デンカ	24,800	3,345.000	82,956,000
信越化学	124,000	19,000.000	2,356,000,000
三井化学	24,800	3,045.000	75,516,000
三菱ケミカルHLDGS	62,000	892.200	55,316,400
宇部興産	12,400	1,900.000	23,560,000
花王	124,000	5,787.000	717,588,000
DIC	12,400	2,845.000	35,278,000
富士フイルムHLDGS	124,000	8,931.000	1,107,444,000
資生堂	124,000	6,503.000	806,372,000
日東電工	124,000	7,900.000	979,600,000
協和キリン	124,000	3,170.000	393,080,000
武田薬品	124,000	3,031.000	375,844,000
アステラス製薬	620,000	1,779.500	1,103,290,000
大日本住友製薬	124,000	1,382.000	171,368,000
塩野義製薬	124,000	7,923.000	982,452,000
中外製薬	372,000	3,680.000	1,368,960,000
エーザイ	124,000	6,873.000	852,252,000
第一三共	372,000	2,824.500	1,050,714,000
大塚ホールディングス	124,000	4,146.000	514,104,000
出光興産	49,600	2,931.000	145,377,600
E N E O Sホールディングス	124,000	423.400	52,501,600
横浜ゴム	62,000	1,766.000	109,492,000
ブリヂストン	124,000	4,605.000	571,020,000
AGC	24,800	5,550.000	137,640,000
日本板硝子	12,400	502.000	6,224,800
日本電気硝子	37,200	2,939.000	109,330,800
住友大阪セメント	12,400	3,450.000	42,780,000
太平洋セメント	12,400	2,199.000	27,267,600
東海カーボン	124,000	1,177.000	145,948,000

TOTO	62,000	5,030.000	311,860,000
日本碍子	124,000	1,797.000	222,828,000
日本製鉄	12,400	1,699.500	21,073,800
神戸製鋼所	12,400	549.000	6,807,600
JFEホールディングス	12,400	1,316.000	16,318,400
大平洋金属	12,400	2,030.000	25,172,000
日本軽金属HD	12,400	1,669.000	20,695,600
三井金属	12,400	2,930.000	36,332,000
東邦亜鉛	12,400	2,122.000	26,312,800
三菱マテリアル	12,400	1,954.000	24,229,600
住友鉱山	62,000	4,233.000	262,446,000
DOWAホールディングス	24,800	4,220.000	104,656,000
古河電工	12,400	2,255.000	27,962,000
住友電工	124,000	1,489.500	184,698,000
フジクラ	124,000	573.000	71,052,000
SUMCO	12,400	2,488.000	30,851,200
日本製鋼所	24,800	3,425.000	84,940,000
オクマ	24,800	4,745.000	117,676,000
アマダ	124,000	1,063.000	131,812,000
小松製作所	124,000	2,592.000	321,408,000
住友重機械	24,800	2,521.000	62,520,800
日立建機	124,000	3,300.000	409,200,000
クボタ	124,000	2,369.000	293,756,000
荏原製作所	24,800	6,100.000	151,280,000
ダイキン工業	124,000	23,150.000	2,870,600,000
日本精工	124,000	771.000	95,604,000
NTN	124,000	210.000	26,040,000
ジェイテクト	124,000	992.000	123,008,000
三井E&SHD	12,400	379.000	4,699,600
日立造船	24,800	841.000	20,856,800
三菱重工業	12,400	2,561.000	31,756,400
IHI	12,400	2,141.000	26,548,400
コニカミノルタ	124,000	469.000	58,156,000
ミネベアミツミ	124,000	3,000.000	372,000,000
日立	24,800	6,688.000	165,862,400
三菱電機	124,000	1,424.500	176,638,000
富士電機	24,800	5,940.000	147,312,000
安川電機	124,000	5,090.000	631,160,000
オムロン	124,000	10,965.000	1,359,660,000
ジーエス・ユアサコーポ	24,800	2,306.000	57,188,800
日本電気	12,400	5,120.000	63,488,000
富士通	12,400	18,795.000	233,058,000
沖電気	12,400	838.000	10,391,200
セイコーエプソン	248,000	1,830.000	453,840,000
パナソニック	124,000	1,242.500	154,070,000
シャープ	124,000	1,270.000	157,480,000
ソニーグループ	124,000	13,825.000	1,714,300,000
TDK	372,000	4,500.000	1,674,000,000

アルプスアルパイン	124,000	1,023.000	126,852,000
横河電機	124,000	2,135.000	264,740,000
アドバンテスト	248,000	9,990.000	2,477,520,000
キーエンス	12,400	70,330.000	872,092,000
カシオ	124,000	1,474.000	182,776,000
ファナック	124,000	22,245.000	2,758,380,000
京セラ	248,000	6,731.000	1,669,288,000
太陽誘電	124,000	6,260.000	776,240,000
村田製作所	99,200	8,380.000	831,296,000
S C R E E Nホールディングス	24,800	11,500.000	285,200,000
キヤノン	186,000	2,500.000	465,000,000
リコー	124,000	1,003.000	124,372,000
東京エレクトロン	124,000	59,840.000	7,420,160,000
デンソー	124,000	8,331.000	1,033,044,000
川崎重工業	12,400	1,908.000	23,659,200
日産自動車	124,000	562.900	69,799,600
いすゞ自動車	62,000	1,532.000	94,984,000
トヨタ自動車	620,000	2,001.000	1,240,620,000
日野自動車	124,000	944.000	117,056,000
三菱自動車工業	12,400	366.000	4,538,400
マツダ	24,800	918.000	22,766,400
本田技研	248,000	3,101.000	769,048,000
スズキ	124,000	4,585.000	568,540,000
S U B A R U	124,000	2,142.500	265,670,000
ヤマハ発動機	124,000	2,859.000	354,516,000
テルモ	496,000	4,628.000	2,295,488,000
ニコン	124,000	1,177.000	145,948,000
オリンパス	496,000	2,539.000	1,259,344,000
シチズン時計	124,000	519.000	64,356,000
バンダイナムコH L D G S	124,000	8,837.000	1,095,788,000
凸版印刷	62,000	1,723.000	106,826,000
大日本印刷	62,000	2,663.000	165,106,000
ヤマハ	124,000	5,820.000	721,680,000
任天堂	12,400	50,100.000	621,240,000
東京電力H D	12,400	303.000	3,757,200
中部電力	12,400	1,146.000	14,210,400
関西電力	12,400	1,027.000	12,734,800
東京瓦斯	24,800	1,945.000	48,236,000
大阪瓦斯	24,800	1,827.000	45,309,600
東武鉄道	24,800	2,565.000	63,612,000
東急	62,000	1,571.000	97,402,000
小田急電鉄	62,000	2,187.000	135,594,000
京王電鉄	24,800	5,110.000	126,728,000
京成電鉄	62,000	3,110.000	192,820,000
東日本旅客鉄道	12,400	6,986.000	86,626,400
西日本旅客鉄道	12,400	4,898.000	60,735,200
東海旅客鉄道	12,400	15,600.000	193,440,000
日本通運	12,400	6,470.000	80,228,000

ヤマトホールディングス	124,000	2,504.000	310,496,000	
日本郵船	12,400	7,400.000	91,760,000	
商船三井	12,400	6,500.000	80,600,000	
川崎汽船	12,400	4,870.000	60,388,000	
A N Aホールディングス	12,400	2,239.500	27,769,800	
三菱倉庫	62,000	2,774.000	171,988,000	
ネクソン	248,000	2,254.000	558,992,000	
Zホールディングス	49,600	752.000	37,299,200	
トレンドマイクロ	124,000	6,550.000	812,200,000	
日本電信電話	49,600	3,125.000	155,000,000	
K D D I	744,000	3,300.000	2,455,200,000	
ソフトバンク	124,000	1,562.500	193,750,000	
東 宝	12,400	5,050.000	62,620,000	
N T Tデータ	620,000	2,394.000	1,484,280,000	
コナミホールディングス	124,000	5,810.000	720,440,000	
ソフトバンクグループ	744,000	6,030.000	4,486,320,000	
双日	12,400	1,606.000	19,914,400	
伊 藤 忠	124,000	3,260.000	404,240,000	
丸 紅	124,000	1,017.500	126,170,000	
豊田通商	124,000	4,955.000	614,420,000	
三井物産	124,000	2,557.000	317,068,000	
住友商事	124,000	1,546.000	191,704,000	
三菱商事	124,000	3,391.000	420,484,000	
J . フロント リテイリング	62,000	932.000	57,784,000	
三越伊勢丹H D	124,000	776.000	96,224,000	
セブン&アイ・H L D G S	124,000	4,554.000	564,696,000	
高 島 屋	62,000	995.000	61,690,000	
丸井グループ	124,000	2,086.000	258,664,000	
イオン	124,000	2,644.500	327,918,000	
ファーストリテイリング	124,000	67,400.000	8,357,600,000	代用有価証券 10,000株
コンコルディア・フィナンシャル	124,000	413.000	51,212,000	
新生銀行	12,400	1,916.000	23,758,400	
あおぞら銀行	12,400	2,472.000	30,652,800	
三菱U F JフィナンシャルG	124,000	601.400	74,573,600	
りそなホールディングス	12,400	415.600	5,153,440	
三井住友トラストH D	12,400	3,560.000	44,144,000	
三井住友フィナンシャルG	12,400	3,703.000	45,917,200	
千葉銀行	124,000	661.000	81,964,000	
ふくおかフィナンシャルG	24,800	1,838.000	45,582,400	
静岡銀行	124,000	800.000	99,200,000	
みずほフィナンシャルG	12,400	1,402.000	17,384,800	
大和証券G本社	124,000	630.900	78,231,600	
野村ホールディングス	124,000	477.400	59,197,600	
松井証券	124,000	781.000	96,844,000	
S O M P Oホールディングス	24,800	4,674.000	115,915,200	
M S & A D	37,200	3,316.000	123,355,200	
第一生命H L D G S	12,400	2,287.000	28,358,800	

東京海上HD	62,000	5,708.000	353,896,000
T & Dホールディングス	24,800	1,342.000	33,281,600
クレディセゾン	124,000	1,124.000	139,376,000
日本取引所グループ	124,000	2,459.000	304,916,000
東急不動産HD	124,000	586.000	72,664,000
三井不動産	124,000	2,336.000	289,664,000
三菱地所	124,000	1,565.000	194,060,000
東京建物	62,000	1,608.000	99,696,000
住友不動産	124,000	3,539.000	438,836,000
エムスリー	297,600	6,119.000	1,821,014,400
ディー・エヌ・エー	37,200	1,680.000	62,496,000
電通グループ	124,000	3,610.000	447,640,000
サイバーエージェント	99,200	2,093.000	207,625,600
楽天グループ	124,000	1,161.000	143,964,000
リクルートホールディングス	372,000	6,901.000	2,567,172,000
日本郵政	124,000	856.000	106,144,000
セコム	124,000	7,664.000	950,336,000
合計	23,175,600		97,883,970,640

(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

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年11月30日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	3,811,427,167
金銭信託	42,505,540
コール・ローン	1,253,628,220
株式	338,023,942,089
投資証券	8,338,643,304
派生商品評価勘定	37,540,884
未収入金	12,431,617
未収配当金	378,251,525
差入委託証拠金	2,070,129,203
流動資産合計	353,968,499,549
資産合計	353,968,499,549
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	68,909,977

未払解約金	81,347,754
その他未払費用	5,026
流動負債合計	150,262,757
負債合計	150,262,757
純資産の部	
元本等	
元本	60,650,874,522
剰余金	
剰余金又は欠損金()	293,167,362,270
元本等合計	353,818,236,792
純資産合計	353,818,236,792
負債純資産合計	353,968,499,549

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30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	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。
----------------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,650,874,522口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.8337円 (1万口当たりの純資産額58,337円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30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41項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価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る場合、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	(2021年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30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				
	S&P 500 EMINI FUT DEC21	5,874,650,474	-	5,899,958,611	25,308,137
	SPI 200 FUTURES DEC21	254,521,022	-	249,231,076	5,289,946
	FTSE 100 IDX FUT DEC21	329,071,619	-	323,504,820	5,566,799
	EURO STOXX 50 DEC21	1,184,808,252	-	1,138,863,154	45,945,098
	小計	7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706
	合 計	7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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。

(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				
	アメリカ・ドル	952,169,526	-	952,205,922	36,396
	カナダ・ドル	41,953,946	-	41,950,840	3,106
	オーストラリア・ ドル	28,422,056	-	28,450,989	28,933
	香港・ドル	7,003,200	-	7,002,864	336
	シンガポール・ド ル	3,321,476	-	3,328,212	6,736
	ニュージーラン ド・ドル	775,611	-	775,253	358
	イギリス・ポンド	43,988,230	-	43,952,400	35,830
	スイス・フラン	30,751,765	-	30,813,540	61,775

デンマーク・ク ローネ	7,079,634	-	7,080,999	1,365
ノルウェー・ク ローネ	1,893,189	-	1,891,392	1,797
スウェーデン・ク ローナ	10,871,469	-	10,901,754	30,285
ユーロ	136,120,067	-	136,120,617	550
小計	1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613
合計	1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

- 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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,935,911,745円
同期中における追加設定元本額	3,825,327,501円
同期中における一部解約元本額	2,110,364,724円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	110,598,046円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	97,319,132円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	330,128,909円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	170,705,412円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	195,254,066円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,559,109円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,097,387円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	17,354,910円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	15,630,593円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,093,613円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	110,450,992円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	67,713,873円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	281,821,366円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	591,445,429円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,447,518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 >	32,980,346円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	704,179,317円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	824,854,056円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,604,698,411円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	12,109,077円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	64,600,386円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	508,707,107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 >	41,029,721円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	102,099,408円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	495,008,013円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	350,695,262円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	829,398,471円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	218,848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)	218,605,667円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	75,145,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	8,737,379円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	7,911,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	4,096,558円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	21,448,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	60,189,060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 >	139,958,110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 >	63,429,174円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	817,767,596円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	118,979,244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 >	1,028,620,924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 >	27,233,124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 >	37,994,675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 >	41,244,635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 >	222,731,531円
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,877,680,130円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,237,232円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,092,113,150円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	759,876,748円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	63,296,820円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,131,648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)	5,750,140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)	17,334,902円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,583,616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)	49,206,031円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,432,630円
外国株式指数ファンド	762,591,588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	12,154,970,474円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	136,154,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	161,478,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	106,177,098円
イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円
合計	60,650,874,522円

(3) 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	
アメリカ・ドル	BAKER HUGHES CO	37,418	23.530	880,445.54	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	106.600	1,467,135.80	
	CHEVRON CORP	104,157	114.850	11,962,431.45	
	CONOCOPHILLIPS	73,421	72.150	5,297,325.15	
	COTERRA ENERGY INC	40,261	20.840	839,039.24	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	43.920	1,589,728.32	
	EOG RESOURCES INC	30,830	88.390	2,725,063.70	
	EXXON MOBIL CORP	227,812	61.590	14,030,941.08	
	HALLIBURTON CO	44,317	22.250	986,053.25	
	HESS CORP	14,344	76.070	1,091,148.08	
	KINDER MORGAN INC	105,940	16.010	1,696,099.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	33,933	61.780	2,096,380.74	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	30.060	1,460,314.80	
	ONEOK INC	24,725	62.460	1,544,323.50	
	PHILLIPS 66	22,492	69.860	1,571,291.12	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,184	183.360	2,234,058.24	
	SCHLUMBERGER LTD	73,444	29.650	2,177,614.60	
	VALERO ENERGY CORP	21,447	68.170	1,462,041.99	
	WILLIAMS COS INC	64,802	28.010	1,815,104.02	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,818	291.350	3,443,174.30	
ALBEMARLE CORP	6,560	275.890	1,809,838.40		

AMCOR PLC	82,302	11.580	953,057.16	
AVERY DENNISON CORP	4,232	215.530	912,122.96	
BALL CORP	17,166	94.810	1,627,508.46	
CELANESE CORP	5,598	159.790	894,504.42	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	62.960	755,645.92	
CORTEVA INC	39,348	46.590	1,833,223.32	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	108.400	743,949.20	
DOW INC	41,516	56.860	2,360,599.76	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	77.040	2,152,805.76	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	110.180	774,234.86	
ECOLAB INC	14,157	227.150	3,215,762.55	
FMC CORP	6,676	103.540	691,233.04	
FREEPORT-MCMORAN INC	80,828	37.980	3,069,847.44	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	47.220	903,790.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,922	147.190	2,049,179.18	
LINDE PLC	28,091	320.740	9,009,907.34	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	89.170	1,242,227.27	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	418.340	1,488,872.06	
MOSAIC CO/THE	18,584	36.030	669,581.52	
NEWMONT CORP	41,882	55.400	2,320,262.80	
NUCOR CORP	15,455	112.070	1,732,041.85	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	133.700	625,983.40	
PPG INDUSTRIES INC	12,256	157.360	1,928,604.16	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	93.020	715,881.92	
SEALED AIR CORP	7,895	64.200	506,859.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,616	334.280	4,551,556.48	
STEEL DYNAMICS INC	10,191	61.400	625,727.40	
VULCAN MATERIALS CO	7,555	199.350	1,506,089.25	
WESTROCK CO	13,034	46.120	601,128.08	
3M CO	30,604	176.230	5,393,342.92	
ALLEGION PLC	4,764	128.680	613,031.52	
AMETEK INC	12,171	140.010	1,704,061.71	
BOEING CO/THE	30,130	198.500	5,980,805.00	
CARRIER GLOBAL CORP	43,253	55.980	2,421,302.94	
CATERPILLAR INC	29,738	195.920	5,826,268.96	
CUMMINS INC	8,207	217.270	1,783,134.89	
DEERE & CO	15,722	348.090	5,472,670.98	
DOVER CORP	8,225	171.800	1,413,055.00	
EATON CORP PLC	21,326	167.380	3,569,545.88	
EMERSON ELECTRIC CO	31,178	90.860	2,832,833.08	
FASTENAL CO	29,892	60.940	1,821,618.48	
FORTIVE CORP	18,373	76.230	1,400,573.79	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	102.960	737,811.36	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	424.580	1,401,114.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	194.440	2,458,110.48	
GENERAL ELECTRIC CO	58,947	98.400	5,800,384.80	
HEICO CORP	1,888	140.180	264,659.84	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	127.000	580,390.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,549	207.660	7,797,425.34	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	28.500	542,184.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	181.720	382,884.04	
IDEX CORP	3,839	234.420	899,938.38	
ILLINOIS TOOL WORKS	16,869	238.110	4,016,677.59	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	59.800	1,256,577.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	58.370	671,255.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,803	78.360	3,040,603.08	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	214.680	2,378,439.72	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,527	322.120	491,877.24	
LOCKHEED MARTIN CORP	13,359	341.230	4,558,491.57	
MASCO CORP	14,885	67.340	1,002,355.90	
NORDSON CORP	2,884	262.150	756,040.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,215	356.390	2,927,743.85	
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	83.580	1,764,457.38	
OWENS CORNING	5,205	87.130	453,511.65	
PACCAR INC	18,041	86.120	1,553,690.92	
PARKER HANNIFIN CORP	6,691	309.140	2,068,455.74	
PENTAIR PLC	8,220	76.800	631,296.00	
PLUG POWER INC	28,584	41.620	1,189,666.08	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	82,039	82.940	6,804,314.66	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	340.580	2,118,067.02	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,657	481.480	2,723,732.36	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	57.900	440,040.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	80.860	578,715.02	
SNAP-ON INC	3,106	212.820	661,018.92	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	184.150	1,681,105.35	
SUNRUN INC	10,669	47.860	510,618.34	
TEXTRON INC	11,803	72.790	859,140.37	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	192.930	2,461,593.87	
TRANSDIGM GROUP INC	2,681	584.220	1,566,293.82	

UNITED RENTALS INC	4,113	357.020	1,468,423.26	
WABTEC CORP	9,231	92.470	853,590.57	
WW GRAINGER INC	2,390	495.580	1,184,436.20	
XYLEM INC	9,124	123.800	1,129,551.20	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	86.080	691,136.32	
CINTAS CORP	5,169	434.730	2,247,119.37	
CLARIVATE PLC	19,939	22.830	455,207.37	
COPART INC	10,977	148.010	1,624,705.77	
COSTAR GROUP INC	20,540	79.990	1,642,994.60	
EQUIFAX INC	6,841	284.060	1,943,254.46	
IHS MARKIT LTD	19,584	130.130	2,548,465.92	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	146.090	1,011,965.43	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	90.550	629,050.85	
REPUBLIC SERVICES INC	11,415	138.230	1,577,895.45	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	114.760	637,491.80	
ROLLINS INC	11,493	35.330	406,047.69	
TRANSUNION	9,497	114.130	1,083,892.61	
VERISK ANALYTICS INC	7,929	229.160	1,817,009.64	
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	137.190	1,859,747.64	
WASTE MANAGEMENT INC	22,023	166.830	3,674,097.09	
AMERCO	650	717.230	466,199.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	95.620	662,168.50	
CSX CORP	121,827	35.620	4,339,477.74	
DELTA AIR LINES INC	8,299	36.240	300,755.76	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	126.760	1,101,417.64	
FEDEX CORP	13,083	240.570	3,147,377.31	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,411	195.870	863,982.57	
KANSAS CITY SOUTHERN	4,866	296.190	1,441,260.54	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	57.830	459,170.20	
LYFT INC-A	13,145	41.820	549,723.90	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,709	268.740	3,684,156.66	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	357.220	1,978,641.58	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	44.540	315,165.04	
UBER TECHNOLOGIES INC	67,187	39.700	2,667,323.90	
UNION PACIFIC CORP	35,904	239.460	8,597,571.84	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39,113	204.640	8,004,084.32	
APTIV PLC	14,147	165.490	2,341,187.03	
AUTOLIV INC	4,001	95.930	383,815.93	
BORGWARNER INC	12,075	44.810	541,080.75	

FORD MOTOR CO	209,141	19.670	4,113,803.47	
GENERAL MOTORS CO	68,943	59.860	4,126,927.98	
LEAR CORP	3,736	169.000	631,384.00	
TESLA INC	43,870	1,136.990	49,879,751.30	
DR HORTON INC	18,162	98.760	1,793,679.12	
GARMIN LTD	8,444	139.240	1,175,742.56	
HASBRO INC	7,491	99.130	742,582.83	
LENNAR CORP-A	14,494	107.250	1,554,481.50	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	463.260	3,002,388.06	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	174.380	499,249.94	
NEWELL BRANDS INC	17,587	22.350	393,069.45	
NIKE INC -CL B	68,723	169.870	11,673,976.01	
NVR INC	173	5,281.730	913,739.29	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	12,599	44.390	559,269.61	
PULTEGROUP INC	13,075	51.510	673,493.25	
VF CORP	17,117	73.730	1,262,036.41	
WHIRLPOOL CORP	3,212	222.780	715,569.36	
AIRBNB INC-CLASS A	6,554	180.080	1,180,244.32	
ARAMARK	13,242	34.380	455,259.96	
BOOKING HOLDINGS INC	2,231	2,182.010	4,868,064.31	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,690	93.480	999,301.20	
CARNIVAL CORP	48,156	18.160	874,512.96	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,469	1,678.100	2,465,128.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	141.750	1,078,150.50	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	533.950	1,132,507.95	
DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	35.200	589,318.40	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	166.500	1,342,156.50	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,617	138.070	2,018,169.19	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	37.260	657,042.84	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	14,715	150.770	2,218,580.55	
MCDONALD'S CORP	40,264	250.300	10,078,079.20	
MELCO RESORTS & ENTERT- ADR	17,945	10.120	181,603.40	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	41.130	913,003.74	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	69.890	830,992.10	
STARBUCKS CORP	63,821	110.730	7,066,899.33	
VAIL RESORTS INC	2,038	333.450	679,571.10	
WYNN RESORTS LTD	4,913	83.000	407,779.00	
YUM! BRANDS INC	15,549	125.250	1,947,512.25	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	227.270	778,627.02	

AMAZON.COM INC	24,297	3,561.570	86,535,466.29	
AUTOZONE INC	1,137	1,838.690	2,090,590.53	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	75.870	1,168,398.00	
BEST BUY CO INC	12,132	110.950	1,346,045.40	
BURLINGTON STORES INC	3,391	293.370	994,817.67	
CARMAX INC	8,427	146.480	1,234,386.96	
CARVANA CO	3,803	291.970	1,110,361.91	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	68.660	272,511.54	
DOLLAR GENERAL CORP	12,746	225.070	2,868,742.22	
DOLLAR TREE INC	12,047	141.350	1,702,843.45	
DOORDASH INC - A	3,844	183.010	703,490.44	
EBAY INC	35,551	70.550	2,508,123.05	
ETSY INC	7,168	281.480	2,017,648.64	
GENUINE PARTS CO	7,406	132.910	984,331.46	
HOME DEPOT INC	57,104	406.820	23,231,049.28	
LKQ CORP	15,922	57.600	917,107.20	
LOWE'S COS INC	37,798	248.580	9,395,826.84	
MERCADOLIBRE INC	2,457	1,234.100	3,032,183.70	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,641	644.150	2,345,350.15	
POOL CORP	2,107	560.100	1,180,130.70	
ROSS STORES INC	18,792	111.660	2,098,314.72	
TARGET CORP	26,817	249.160	6,681,723.72	
TJX COMPANIES INC	63,882	70.670	4,514,540.94	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	226.700	1,386,723.90	
ULTA BEAUTY INC	2,765	401.420	1,109,926.30	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	267.510	1,004,767.56	
COSTCO WHOLESALE CORP	23,846	554.880	13,231,668.48	
KROGER CO	38,955	42.350	1,649,744.25	
SYSCO CORP	26,862	73.200	1,966,298.40	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	37,873	46.080	1,745,187.84	
WALMART INC	83,365	142.630	11,890,349.95	
ALTRIA GROUP INC	98,956	43.480	4,302,606.88	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,341	64.810	1,966,400.21	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	467	442.370	206,586.79	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,130	74.190	1,196,684.70	
BUNGE LTD	7,174	90.580	649,820.92	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	41.200	438,285.60	
COCA-COLA CO/THE	220,653	54.580	12,043,240.74	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,253	51.820	634,950.46	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	31.510	776,374.89	
CONSTELLATION BRANDS INC- A	8,881	226.970	2,015,720.57	

GENERAL MILLS INC	31,489	63.520	2,000,181.28	
HERSHEY CO/THE	7,514	179.160	1,346,208.24	
HORMEL FOODS CORP	14,939	42.490	634,758.11	
JM SMUCKER CO/THE	5,768	129.370	746,206.16	
KELLOGG CO	12,949	63.870	827,052.63	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	35.170	1,345,041.48	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,438	34.780	1,336,873.64	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,417	53.290	395,251.93	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	86.990	1,138,177.16	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	45.330	436,482.57	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	75,111	60.640	4,554,731.04	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,202	86.850	1,928,243.70	
PEPSICO INC	74,441	164.140	12,218,745.74	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	84,316	87.350	7,365,002.60	
TYSON FOODS INC-CL A	14,949	81.880	1,224,024.12	
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,485	93.750	1,170,468.75	
CLOROX COMPANY	6,542	169.160	1,106,644.72	
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,041	77.710	3,344,716.11	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,400	340.050	4,216,620.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	135.040	2,403,712.00	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	131,539	149.020	19,601,941.78	
ABBOTT LABORATORIES	95,732	128.030	12,256,567.96	
ABIOMED INC	2,288	319.120	730,146.56	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	634.470	2,635,588.38	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	120.230	960,998.39	
ANTHEM INC	13,309	416.220	5,539,471.98	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	76.030	2,009,777.02	
BECTON DICKINSON AND CO	15,140	243.610	3,688,255.40	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	74,556	38.590	2,877,116.04	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	47.470	717,461.58	
CENTENE CORP	30,528	73.770	2,252,050.56	
CERNER CORP	15,537	72.860	1,132,025.82	
CIGNA CORP	18,324	199.610	3,657,653.64	
COOPER COS INC/THE	2,771	381.190	1,056,277.49	
CVS HEALTH CORP	69,353	92.020	6,381,863.06	
DAVITA INC	4,138	96.910	401,013.58	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	48.690	577,658.16	
DEXCOM INC	5,047	571.010	2,881,887.47	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,018	110.710	3,766,132.78	

HCA HEALTHCARE INC	14,312	229.920	3,290,615.04	
HENRY SCHEIN INC	7,559	73.770	557,627.43	
HOLOGIC INC	13,592	75.970	1,032,584.24	
HUMANA INC	6,744	428.070	2,886,904.08	
IDEXX LABORATORIES INC	4,601	631.300	2,904,611.30	
INSULET CORP	3,400	295.870	1,005,958.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	19,252	334.740	6,444,414.48	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,995	291.920	1,458,140.40	
MASIMO CORP	2,941	288.290	847,860.89	
MCKESSON CORP	8,411	223.270	1,877,923.97	
MEDTRONIC PLC	72,698	110.280	8,017,135.44	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	297.530	1,019,932.84	
NOVOCURE LTD	4,517	93.350	421,661.95	
OAK STREET HEALTH INC	6,212	30.670	190,522.04	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	156.700	1,067,753.80	
RESMED INC	7,595	256.920	1,951,307.40	
STERIS PLC	5,282	226.690	1,197,376.58	
STRYKER CORP	17,983	243.500	4,378,860.50	
TELADOC HEALTH INC	7,496	106.410	797,649.36	
TELEFLEX INC	2,340	308.950	722,943.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	50,662	452.000	22,899,224.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	121.270	509,697.81	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,675	294.090	2,257,140.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	123.500	1,340,716.00	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	144.450	550,932.30	
ABBVIE INC	95,234	116.890	11,131,902.26	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,873	153.420	2,588,655.66	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	180.740	1,230,839.40	
AMGEN INC	31,156	203.470	6,339,311.32	
AVANTOR INC	30,428	39.780	1,210,425.84	
BIOGEN INC	7,987	236.110	1,885,810.57	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	87.400	793,592.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	749.560	914,463.20	
BIO-TECHNE CORP	1,991	479.690	955,062.79	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,007	54.640	6,611,822.48	
CATALENT INC	8,935	133.960	1,196,932.60	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	375.310	967,173.87	
DANAHER CORP	34,632	326.520	11,308,040.64	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	30.190	628,284.09	

ELI LILLY & CO	43,937	254.830	11,196,465.71	
EXACT SCIENCES CORP	8,428	86.570	729,611.96	
GILEAD SCIENCES INC	65,673	70.650	4,639,797.45	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	102.080	1,182,290.56	
ILLUMINA INC	7,655	370.810	2,838,550.55	
INCYTE CORP	9,243	70.370	650,429.91	
IQVIA HOLDINGS INC	9,921	266.690	2,645,831.49	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	122.410	318,755.64	
JOHNSON & JOHNSON	141,374	159.750	22,584,496.50	
MERCK & CO. INC.	136,493	74.890	10,221,960.77	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,258	1,536.220	1,932,564.76	
MODERNA INC	17,813	368.510	6,564,268.63	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	84.740	354,721.64	
NOVAVAX INC	3,601	193.960	698,449.96	
PERKINELMER INC	5,624	185.220	1,041,677.28	
PFIZER INC	301,201	52.400	15,782,932.40	
PPD INC	6,413	47.200	302,693.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,495	654.400	3,595,928.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	7,431	41.340	307,197.54	
SEAGEN INC	7,790	165.310	1,287,764.90	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	63,719	8.590	547,346.21	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,163	648.770	13,729,919.51	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,530	190.110	2,572,188.30	
VIATRIS INC	63,072	12.520	789,661.44	
WATERS CORP	3,425	341.220	1,168,678.50	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,779	447.380	1,690,649.02	
ZOETIS INC	25,246	223.550	5,643,743.30	
BANK OF AMERICA CORP	414,347	45.590	18,890,079.73	
CITIGROUP INC	110,527	65.040	7,188,676.08	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,799	48.780	1,014,575.22	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	42.990	1,597,078.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,897	214.450	1,907,961.65	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	15.370	1,165,307.29	
JPMORGAN CHASE & CO	161,884	161.230	26,100,557.32	
KEYCORP	51,128	22.830	1,167,252.24	
M & T BANK CORP	7,237	152.160	1,101,181.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,168	200.880	4,653,987.84	
REGIONS FINANCIAL CORP	47,041	23.540	1,107,345.14	

SVB FINANCIAL GROUP	3,111	724.500	2,253,919.50	
TRUIST FINANCIAL CORP	70,316	61.060	4,293,494.96	
US BANCORP	74,623	57.400	4,283,360.20	
WELLS FARGO & CO	222,862	49.160	10,955,895.92	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	47.710	960,831.69	
AMERICAN EXPRESS CO	37,020	157.860	5,843,977.20	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,501	293.710	1,909,408.71	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	10,566	73.350	775,016.10	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	57.010	2,539,624.47	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	71,257	282.120	20,103,024.84	
BLACKROCK INC	8,252	928.000	7,657,856.00	
BLACKSTONE INC	37,250	148.880	5,545,780.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	147.020	3,477,611.08	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	56.800	573,339.20	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	129.700	734,231.70	
CME GROUP INC	18,712	225.330	4,216,374.96	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	113.320	1,861,281.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	32.240	735,716.80	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	469.430	910,224.77	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	33.750	482,557.50	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	50.490	159,497.91	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,167	386.540	7,022,272.18	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	30,781	131.900	4,060,013.90	
INVESCO LTD	18,328	23.240	425,942.72	
KKR & CO INC	28,569	76.310	2,180,100.39	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	352.960	674,859.52	
MOODY'S CORP	9,247	397.270	3,673,555.69	
MORGAN STANLEY	75,561	97.230	7,346,796.03	
MSCI INC	4,383	645.490	2,829,182.67	
NASDAQ INC	6,509	209.080	1,360,901.72	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	119.940	1,322,098.62	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,639	100.570	969,394.23	
S&P GLOBAL INC	12,767	464.930	5,935,761.31	
SCHWAB (CHARLES) CORP	77,300	80.100	6,191,730.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	61.520	337,191.12	
STATE STREET CORP	18,694	93.190	1,742,093.86	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	47.120	1,513,117.44	

T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	207.020	2,549,244.28	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	5,220	97.300	507,906.00	
VOYA FINANCIAL INC	7,308	62.250	454,923.00	
AFLAC INC	34,185	55.700	1,904,104.50	
ALLEGHANY CORP	689	664.730	457,998.97	
ALLSTATE CORP	16,419	113.140	1,857,645.66	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	138.140	488,877.46	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	54.950	2,458,737.75	
AON PLC-CLASS A	12,005	296.690	3,561,763.45	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	41.730	854,463.48	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,028	164.810	1,817,524.68	
ASSURANT INC	3,114	156.040	485,908.56	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,195	84.250	690,428.75	
BROWN & BROWN INC	14,273	65.410	933,596.93	
CHUBB LTD	24,524	185.040	4,537,920.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	118.460	930,858.68	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	204.190	262,996.72	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	264.370	545,924.05	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	49.950	696,153.15	
GLOBE LIFE INC	4,333	88.470	383,340.51	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	68.610	1,257,689.91	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	68.340	592,986.18	
LOEWS CORP	12,727	55.110	701,384.97	
MARKEL CORP	702	1,243.740	873,105.48	
MARSH & MCLENNAN COS	26,625	167.030	4,447,173.75	
METLIFE INC	39,703	59.890	2,377,812.67	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	70.920	1,001,674.08	
PROGRESSIVE CORP	30,543	94.970	2,900,668.71	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	105.030	2,177,061.84	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,052	155.100	473,365.20	
TRAVELERS COS INC/THE	13,126	152.400	2,000,402.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	230.390	1,571,950.97	
WR BERKLEY CORP	7,428	79.470	590,303.16	
CBRE GROUP INC - A	18,244	97.960	1,787,182.24	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	5.560	290,788.00	
ZILLOW GROUP INC - A	3,154	54.160	170,820.64	

ZILLOW GROUP INC - C	7,906	54.260	428,979.56	
ACCENTURE PLC-CL A	33,989	365.820	12,433,855.98	
ADOBE INC	25,702	687.490	17,669,867.98	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,321	114.260	950,757.46	
ANSYS INC	4,470	397.720	1,777,808.40	
AUTODESK INC	11,506	261.150	3,004,791.90	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	22,387	235.900	5,281,093.30	
AVALARA INC	4,319	142.700	616,321.30	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	50.060	440,928.48	
BLACK KNIGHT INC	7,623	73.140	557,546.22	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,889	175.510	1,033,578.39	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,400	186.690	2,875,026.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	112.970	788,417.63	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,400	111.110	711,104.00	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	82.370	534,581.30	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,673	191.090	2,421,683.57	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS- A	29,348	79.710	2,339,329.08	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	202.660	707,283.40	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,874	224.570	2,217,404.18	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	176.960	363,652.80	
DATADOG INC - CLASS A	10,423	182.990	1,907,304.77	
DOCUSIGN INC	10,078	251.500	2,534,617.00	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	24.950	413,770.80	
DYNATRACE INC	9,587	64.470	618,073.89	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	634.170	1,962,756.15	
FAIR ISAAC CORP	1,494	350.660	523,886.04	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,940	105.390	3,576,936.60	
FISERV INC	31,564	97.470	3,076,543.08	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	212.980	930,935.58	
FORTINET INC	7,360	343.300	2,526,688.00	
GARTNER INC	4,568	325.000	1,484,600.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,331	120.260	1,843,706.06	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	69.090	615,246.45	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	118.470	560,481.57	
HUBSPOT INC	2,275	851.910	1,938,095.25	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	47,143	118.500	5,586,445.50	
INTUIT INC	14,765	694.660	10,256,654.90	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	152.310	596,293.65	
MASTERCARD INC - A	47,560	323.010	15,362,355.60	
MICROSOFT CORP	382,865	336.630	128,883,844.95	
MONGODB INC	3,155	525.980	1,659,466.90	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	25.310	793,392.57	
OKTA INC	6,306	223.610	1,410,084.66	
ORACLE CORP	101,206	92.940	9,406,085.64	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	82,071	21.070	1,729,235.97	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,393	551.180	2,972,513.74	
PAYCHEX INC	17,729	123.730	2,193,609.17	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,522	447.430	1,128,418.46	
PAYPAL HOLDINGS INC	60,125	187.240	11,257,805.00	
PTC INC	5,462	110.320	602,567.84	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	222.080	886,543.36	
SALESFORCE.COM INC	52,257	296.740	15,506,742.18	
SERVICENOW INC	10,696	672.820	7,196,482.72	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,046	364.780	3,664,579.88	
SPLUNK INC	8,252	125.000	1,031,500.00	
SQUARE INC - A	20,789	212.870	4,425,354.43	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	78.480	906,130.08	
SYNOPSYS INC	7,869	355.870	2,800,341.03	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	107.060	2,580,146.00	
TWILIO INC - A	8,993	293.230	2,637,017.39	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,016	521.280	1,050,900.48	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	170.330	485,951.49	
VERISIGN INC	5,227	244.460	1,277,792.42	
VISA INC-CLASS A SHARES	90,892	196.290	17,841,190.68	
VMWARE INC-CLASS A	10,605	120.380	1,276,629.90	
WESTERN UNION CO	21,840	16.160	352,934.40	
WIX.COM LTD	3,194	159.370	509,027.78	
WORKDAY INC-CLASS A	9,864	281.590	2,777,603.76	
ZENDESK INC	6,067	95.110	577,032.37	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,098	218.980	2,430,240.04	
ZSCALER INC	4,551	355.920	1,619,791.92	
AMPHENOL CORP-CL A	31,396	82.930	2,603,670.28	
APPLE INC	892,929	160.240	143,082,942.96	
ARISTA NETWORKS INC	12,952	126.600	1,639,723.20	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	124.420	513,854.60	
CDW CORP/DE	7,404	194.800	1,442,299.20	

CISCO SYSTEMS INC	226,938	55.760	12,654,062.88	
COGNEX CORP	8,698	78.660	684,184.68	
CORNING INC	45,688	38.460	1,757,160.48	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,550	57.570	837,643.50	
F5 INC	2,909	231.070	672,182.63	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	63,881	14.610	933,301.41	
HP INC	65,388	35.930	2,349,390.84	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	163.180	289,807.68	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	31.840	555,926.40	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,542	197.740	1,886,835.08	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	259.500	2,390,514.00	
NETAPP INC	10,919	91.520	999,306.88	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	104.060	1,227,908.00	
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	159.390	2,777,370.75	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,371	431.880	1,023,987.48	
TRIMBLE INC	12,759	86.530	1,104,036.27	
WESTERN DIGITAL CORP	14,857	58.990	876,414.43	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	2,737	607.200	1,661,906.40	
ADVANCED MICRO DEVICES	65,629	161.910	10,625,991.39	
ANALOG DEVICES INC	29,273	183.200	5,362,813.60	
APPLIED MATERIALS INC	49,683	151.220	7,513,063.26	
BROADCOM INC	22,001	564.340	12,416,044.34	
ENPHASE ENERGY INC	7,293	256.710	1,872,186.03	
INTEL CORP	217,738	50.000	10,886,900.00	
KLA CORP	8,157	413.840	3,375,692.88	
LAM RESEARCH CORP	7,779	680.540	5,293,920.66	
MARVELL TECHNOLOGY INC	45,111	75.020	3,384,227.22	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,704	84.400	2,422,617.60	
MICRON TECHNOLOGY INC	61,223	86.140	5,273,749.22	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	564.320	1,265,769.76	
NVIDIA CORP	133,564	333.760	44,578,320.64	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	223.940	3,237,500.58	
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,912	63.020	1,317,874.24	
QORVO INC	6,042	150.840	911,375.28	
QUALCOMM INC	60,894	183.740	11,188,663.56	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	154.920	1,356,634.44	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	347.210	914,551.14	
TERADYNE INC	8,542	154.450	1,319,311.90	
TEXAS INSTRUMENTS INC	49,876	194.380	9,694,896.88	

XILINX INC	12,876	233.080	3,001,138.08	
AT&T INC	385,489	23.890	9,209,332.21	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	27.920	588,525.68	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	27.640	233,060.48	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	12.950	644,366.10	
T-MOBILE US INC	33,335	113.400	3,780,189.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	223,132	51.660	11,526,999.12	
AES CORP	33,656	23.620	794,954.72	
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	57.280	693,145.28	
AMEREN CORPORATION	14,760	85.090	1,255,928.40	
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,727	83.310	2,143,316.37	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	173.320	1,774,970.12	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	93.800	653,317.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	32,003	26.590	850,959.77	
CMS ENERGY CORP	16,996	61.130	1,038,965.48	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,399	80.350	1,478,359.65	
DOMINION ENERGY INC	44,347	74.420	3,300,303.74	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	111.490	1,174,658.64	
DUKE ENERGY CORP	42,041	100.220	4,213,349.02	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	66.070	1,433,785.07	
ENERGY CORP	10,866	105.070	1,141,690.62	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	48.440	673,751.96	
EVERGY INC	11,273	65.260	735,675.98	
EVERSOURCE ENERGY	17,557	85.270	1,497,085.39	
EXELON CORP	50,837	54.170	2,753,840.29	
FIRSTENERGY CORP	26,948	39.050	1,052,319.40	
NEXTERA ENERGY INC	105,966	88.660	9,394,945.56	
NISOURCE INC	18,919	25.250	477,704.75	
NRG ENERGY INC	13,547	36.630	496,226.61	
P G & E CORP	76,538	12.380	947,540.44	
PINNACLE WEST CAPITAL	5,996	66.290	397,474.84	
PPL CORP	39,561	28.440	1,125,114.84	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	64.250	1,749,591.75	
SEMPRA ENERGY	16,353	124.200	2,031,042.60	
SOUTHERN CO/THE	55,686	62.820	3,498,194.52	
UGI CORP	10,588	43.400	459,519.20	
VISTRA CORP	25,777	20.090	517,859.93	
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	90.490	1,487,474.62	
XCEL ENERGY INC	29,237	65.590	1,917,654.83	
ACTIVISION BLIZZARD INC	40,092	60.310	2,417,948.52	
ALPHABET INC-CL A	16,111	2,910.610	46,892,837.71	

ALPHABET INC-CL C	15,603	2,922.280	45,596,334.84	
ALTICE USA INC- A	9,667	15.990	154,575.33	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	36.840	1,018,920.72	
CABLE ONE INC	246	1,825.970	449,188.62	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,002	668.190	4,678,666.38	
COMCAST CORP-CLASS A	246,863	51.530	12,720,850.39	
DISCOVERY INC - A	7,075	24.590	173,974.25	
DISCOVERY INC-C	17,417	24.050	418,878.85	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	33.130	428,602.81	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	124.880	1,917,157.76	
FOX CORP - CLASS A	16,962	36.920	626,237.04	
FOX CORP - CLASS B	8,773	34.490	302,580.77	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	130.810	519,838.94	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	34.020	667,676.52	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	156.340	205,118.08	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	159.940	1,310,868.24	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	10,288	60.050	617,794.40	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	4,141	49.890	206,594.49	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	7,648	49.730	380,335.04	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,770	107.850	945,844.50	
MATCH GROUP INC	13,729	134.080	1,840,784.32	
META PLATFORMS INC-CLASS A	128,402	338.030	43,403,728.06	
NETFLIX INC	23,852	663.840	15,833,911.68	
NEWS CORP - CLASS A	23,102	21.820	504,085.64	
OMNICOM GROUP	10,417	67.470	702,834.99	
PINTEREST INC- CLASS A	28,563	40.540	1,157,944.02	
ROKU INC	6,012	231.280	1,390,455.36	
SEA LTD-ADR	3,725	297.960	1,109,901.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.270	424,203.12	
SNAP INC - A	49,643	48.850	2,425,060.55	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,707	169.600	967,907.20	
TWITTER INC	40,795	45.780	1,867,595.10	
VIACOMCBS INC - CLASS B	32,381	32.280	1,045,258.68	
WALT DISNEY CO/THE	97,683	147.810	14,438,524.23	
アメリカ・ドル小計	16,814,891		2,202,902,668.93 (250,624,236,644)	

カナダ・ ドル	CAMECO CORP	18,890	31.830	601,268.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,374	53.430	3,439,502.82	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	15.860	1,190,451.60	
	ENBRIDGE INC	107,703	48.740	5,249,444.22	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	42.850	557,007.15	
	KEYERA CORP	11,374	28.790	327,457.46	
	PARKLAND CORP	7,666	34.170	261,947.22	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	38.550	1,240,230.60	
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	31.950	2,512,611.90	
	TC ENERGY CORP	53,918	61.020	3,290,076.36	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	13,447	64.600	868,676.20	
	B2GOLD CORP	42,963	5.120	219,970.56	
	BARRICK GOLD CORP	93,098	24.430	2,274,384.14	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	63.460	552,419.30	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	28.070	889,033.04	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,165	179.960	1,829,293.40	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	10.330	337,770.34	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	7.700	488,957.70	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	13,385	50.920	681,564.20	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	10.420	483,967.32	
	NUTRIEN LTD	29,898	87.260	2,608,899.48	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	32.620	383,709.06	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,814	33.890	840,946.46	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	106.730	473,667.74	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	53.950	1,312,873.25	
	YAMANA GOLD INC	53,588	5.160	276,514.08	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	19.570	332,846.56	
	CAE INC	12,891	31.540	406,582.14	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	110.940	426,342.42	
	WSP GLOBAL INC	6,141	181.840	1,116,679.44	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	51.180	507,347.34	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	88.660	502,436.22	
	THOMSON REUTERS CORP	9,710	156.000	1,514,760.00	
	AIR CANADA	12,083	21.300	257,367.90	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	38,687	163.760	6,335,383.12		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34,738	91.440	3,176,442.72		
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	100.370	1,639,142.47		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	53.280	483,036.48		
RESTAURANT BRANDS INTERN	14,510	72.960	1,058,649.60		

CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	174.050	522,324.05	
DOLLARAMA INC	17,025	56.410	960,380.25	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	44,270	47.510	2,103,267.70	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	37.110	339,482.28	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	96.860	841,035.38	
METRO INC/CN	13,109	62.150	814,724.35	
WESTON (GEORGE) LTD	3,578	136.480	488,325.44	
SAPUTO INC	13,425	28.980	389,056.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	31.790	522,850.13	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	14.090	158,526.59	
BANK OF MONTREAL	35,424	137.010	4,853,442.24	
BANK OF NOVA SCOTIA	63,307	81.430	5,155,089.01	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	145.590	3,423,257.67	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,993	101.870	1,731,076.91	
ROYAL BANK OF CANADA	77,035	129.730	9,993,750.55	
TORONTO-DOMINION BANK	98,488	93.590	9,217,491.92	
BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A	69,448	73.870	5,130,123.76	
IGM FINANCIAL INC	4,949	48.870	241,857.63	
ONEX CORPORATION	4,217	95.610	403,187.37	
TMX GROUP LTD	3,142	128.610	404,092.62	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	566.740	789,468.82	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	37.450	531,790.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	69.880	338,987.88	
INTACT FINANCIAL CORP	10,095	161.360	1,628,929.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	99,810	23.920	2,387,455.20	
POWER CORP OF CANADA	31,768	41.830	1,328,855.44	
SUN LIFE FINANCIAL INC	30,550	68.670	2,097,868.50	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	253.080	636,749.28	
BLACKBERRY LTD	25,993	12.560	326,472.08	
CGI INC	11,493	107.430	1,234,692.99	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,026	2,205.320	2,262,658.32	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	68.160	433,702.08	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	3,084	122.830	378,807.72	
OPEN TEXT CORP	13,665	62.040	847,776.60	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,082	2,000.000	12,164,000.00	
BCE INC	5,509	64.860	357,313.74	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	18,236	57.720	1,052,581.92	

	TELUS CORP	15,222	29.490	448,896.78	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	17.540	550,036.86	
	ALTAGAS LTD	17,347	24.940	432,634.18	
	ATCO LTD -CLASS I	3,030	42.540	128,896.20	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	47.720	302,353.92	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	35.300	259,243.20	
	EMERA INC	14,279	59.350	847,458.65	
	FORTIS INC	24,171	55.960	1,352,609.16	
	HYDRO ONE LTD	18,821	31.120	585,709.52	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	38.840	422,190.80	
	QUEBECOR INC -CL B	9,953	29.000	288,637.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	37.240	1,014,119.68	
	カナダ・ドル小計	2,167,353		134,073,898.78 (11,967,436,205)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	10,927	28.930	316,118.11	
	OIL SEARCH LTD	105,618	3.910	412,966.38	
	SANTOS LTD	100,376	6.390	641,402.64	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,025	31.110	436,317.75	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	21.240	1,069,518.96	
	BHP GROUP LTD	157,518	38.570	6,075,469.26	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	20.330	517,642.46	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.120	347,810.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,448	17.600	1,556,684.80	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	54.930	1,434,112.44	
	NEWCREST MINING LTD	42,131	24.180	1,018,727.58	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	9.660	636,053.04	
	ORICA LTD	17,981	14.380	258,566.78	
	RIO TINTO LTD	19,336	95.390	1,844,461.04	
	SOUTH32 LTD	276,348	3.570	986,562.36	
	REECE LTD	19,309	23.460	452,989.14	
	BRAMBLES LTD	74,638	10.100	753,843.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.410	322,040.40	
	QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	4.900	224,571.90	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	44.590	1,371,097.91	
CROWN RESORTS LTD	21,863	11.100	242,679.30		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	130.170	493,864.98		
TABCORP HOLDINGS LTD	112,817	4.990	562,956.83		
WESFARMERS LTD	60,628	58.210	3,529,155.88		

	COLES GROUP LTD	73,552	18.030	1,326,142.56	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	65,607	6.850	449,407.95	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,607	40.100	2,630,840.70	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.920	434,650.88	
	COCHLEAR LTD	3,368	226.670	763,424.56	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	66.200	625,325.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	42.700	1,035,816.60	
	CSL LTD	24,747	307.000	7,597,329.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	148,002	26.620	3,939,813.24	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	96,041	93.780	9,006,724.98	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	173,185	27.200	4,710,632.00	
	WESTPAC BANKING CORP	201,731	20.920	4,220,212.52	
	ASX LTD	11,180	91.020	1,017,603.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	18,953	194.010	3,677,071.53	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	32.630	188,699.29	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117,187	4.370	512,107.19	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.360	432,512.64	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	11.600	938,010.80	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	10.650	680,886.45	
	AFTERPAY LTD	11,491	110.550	1,270,330.05	
	COMPUTERSHARE LTD	33,563	19.140	642,395.82	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	51.810	409,765.29	
	XERO LTD	7,459	141.210	1,053,285.39	
	TELSTRA CORP LTD	216,943	4.000	867,772.00	
	AGL ENERGY LTD	32,492	5.330	173,182.36	
	AUSNET SERVICES	137,772	2.520	347,185.44	
	ORIGIN ENERGY LTD	88,060	4.920	433,255.20	
	REA GROUP LTD	2,833	161.000	456,113.00	
	SEEK LTD	17,266	34.300	592,223.80	
	オーストラリア・ドル小計	3,453,384		75,938,334.18	(6,173,027,184)
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	153,924	50.500	7,773,162.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	70,500	164.700	11,611,350.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	19.380	1,821,720.00	
	MTR CORP	84,500	42.000	3,549,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	28.800	2,016,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	43.650	5,150,700.00	

	SANDS CHINA LTD	116,000	18.680	2,166,880.00	
	SJM HOLDINGS LTD	80,000	5.580	446,400.00	
	WYNN MACAU LTD	70,800	7.190	509,052.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	14.560	1,703,520.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	20.200	1,809,920.00	
	WH GROUP LTD	581,500	5.100	2,965,650.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	24.000	4,500,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	140.900	5,466,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	62,900	445.000	27,990,500.00	
	AIA GROUP LTD	654,000	83.900	54,870,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,924	45.300	4,662,457.20	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	25.850	2,636,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.000	1,568,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	33.050	2,755,841.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	31.600	2,680,722.80	
	SINO LAND CO	248,200	9.650	2,395,130.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	96.750	6,579,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	44.050	1,189,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	19.400	1,028,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	40.250	3,662,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	46.500	1,395,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	85,100	76.800	6,535,680.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	11.840	7,179,645.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	71,500	47.800	3,417,700.00	
	香港・ドル小計	4,340,354		182,037,550.96 (2,655,927,869)	
シンガ ポール・ ドル	KEPPEL CORP LTD	54,700	5.210	284,987.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.840	417,024.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	4.910	382,813.06	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.790	258,725.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.190	432,408.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	96,600	30.790	2,974,314.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	181,200	11.340	2,054,808.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	26.530	1,716,491.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.230	395,044.00	

	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	136,600	3.370	460,342.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.000	180,600.00	
	UOL GROUP LTD	17,200	6.870	118,164.00	
	VENTURE CORP LTD	8,700	18.810	163,647.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,815	2.410	1,059,954.15	
	シンガポール・ドル小計	1,685,381		10,899,321.21 (906,932,518)	
ニュー ジーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.785	550,485.13	
	A2 MILK CO LTD	34,717	6.200	215,245.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	33.000	1,031,250.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	24,028	12.100	290,738.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	111,459	4.355	485,403.94	
	MERCURY NZ LTD	26,913	5.850	157,441.05	
	MERIDIAN ENERGY LTD	88,445	4.490	397,118.05	
	ニュージーランド・ドル小計	387,523		3,127,682.37 (242,489,214)	
イギリ ス・ボン ド	BP PLC	1,079,142	3.277	3,536,348.33	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	219,298	15.948	3,497,364.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	199,191	15.940	3,175,104.54	
	ANGLO AMERICAN PLC	66,935	26.835	1,796,200.72	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	13.980	271,757.22	
	BHP GROUP PLC	116,484	20.190	2,351,811.96	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	100.650	788,894.70	
	EVRAZ PLC	28,275	5.720	161,733.00	
	GLENCORE PLC	539,565	3.571	1,926,786.61	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	21.330	214,878.42	
	MONDI PLC	25,128	17.480	439,237.44	
	RIO TINTO PLC	61,130	46.215	2,825,122.95	
	ASHTAD GROUP PLC	23,686	61.300	1,451,951.80	
	BAE SYSTEMS PLC	165,753	5.498	911,309.99	
	BUNZL PLC	17,064	28.670	489,224.88	
	DCC PLC	5,954	56.340	335,448.36	
	FERGUSON PLC	12,017	115.550	1,388,564.35	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.460	323,702.44	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	1.225	605,326.40	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	14.560	354,812.64	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,685	158.400	583,704.00		
EXPERIAN PLC	48,895	33.830	1,654,117.85		

INTERTEK GROUP PLC	8,184	54.800	448,483.20	
RELX PLC	106,284	23.430	2,490,234.12	
RENTOKIL INITIAL PLC	90,552	6.186	560,154.67	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	6.928	448,698.84	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	43.250	287,050.25	
BURBERRY GROUP PLC	19,012	17.950	341,265.40	
PERSIMMON PLC	16,916	27.590	466,712.44	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.555	350,789.34	
COMPASS GROUP PLC	93,018	15.220	1,415,733.96	
ENTAIN PLC	28,865	17.460	503,982.90	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,587	46.000	441,002.00	
WHITBREAD PLC	11,282	28.750	324,357.50	
JD SPORTS FASHION PLC	28,860	11.415	329,436.90	
KINGFISHER PLC	109,678	3.260	357,550.28	
NEXT PLC	6,860	79.620	546,193.20	
OCADO GROUP PLC	27,379	18.340	502,130.86	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.897	328,751.56	
TESCO PLC	399,930	2.790	1,115,804.70	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	19.070	319,822.97	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	114,393	25.560	2,923,885.08	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	23.530	204,805.12	
DIAGEO PLC	126,868	38.235	4,850,797.98	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	15.630	781,546.89	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	37,385	61.640	2,304,411.40	
UNILEVER PLC	141,843	39.210	5,561,664.03	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	12.400	550,002.00	
ASTRAZENECA PLC	83,563	83.670	6,991,716.21	
GLAXOSMITHKLINE PLC	266,528	15.250	4,064,552.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	22.300	169,056.30	
BARCLAYS PLC	904,741	1.832	1,657,485.51	
HSBC HOLDINGS PLC	1,107,975	4.164	4,613,607.90	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,817,021	0.468	1,786,365.82	
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.104	665,467.84	
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.142	607,055.66	
3I GROUP PLC	49,338	13.880	684,811.44	
ABRDN PLC	123,263	2.358	290,654.15	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	13.415	262,558.38	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,716	68.700	1,217,089.20	

	M&G PLC	133,064	1.903	253,220.79	
	SCHRODERS PLC	6,213	35.170	218,511.21	
	ST JAMES'S PLACE PLC	26,157	15.625	408,703.12	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	30.130	347,549.55	
	AVIVA PLC	198,601	3.782	751,108.98	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	2.672	169,108.20	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.849	893,551.81	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.440	237,320.44	
	PRUDENTIAL PLC	143,405	12.945	1,856,377.72	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	32.200	194,391.40	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.770	435,018.99	
	HALMA PLC	19,839	30.290	600,923.31	
	BT GROUP PLC	469,907	1.634	767,828.03	
	VODAFONE GROUP PLC	1,546,057	1.101	1,702,208.75	
	NATIONAL GRID PLC	191,851	10.012	1,920,812.21	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	29.070	360,991.26	
	SSE PLC	55,879	15.580	870,594.82	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,207	10.885	361,458.19	
	AUTO TRADER GROUP PLC	43,954	7.324	321,919.09	
	INFORMA PLC	78,152	4.740	370,440.48	
	PEARSON PLC	39,623	6.146	243,522.95	
	WPP PLC	63,987	10.605	678,582.13	
	イギリス・ポンド小計	15,710,716		94,813,273.93 (14,369,899,797)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	28,711	28.520	818,837.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	471.000	654,219.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	30.740	2,041,228.22	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	31.040	2,177,456.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	19.750	1,079,811.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	117.100	1,083,057.90	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	290.900	622,526.00	
	NICE LTD	3,251	884.700	2,876,159.70	
	イスラエル・シュケル小計	235,967		11,353,296.04 (408,845,814)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.110	182,929.11	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	890.000	316,840.00	
	GIVAUDAN-REG	484	4,524.000	2,189,616.00	
	HOLCIM LTD	27,239	45.480	1,238,829.72	
	SIKA AG-REG	7,800	363.700	2,836,860.00	
	ABB LTD-REG	90,836	31.940	2,901,301.84	
	GEBERIT AG-REG	1,986	698.000	1,386,228.00	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	234.000	220,194.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	240.300	512,319.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	43.740	398,821.32	
	SGS SA-REG	308	2,846.000	876,568.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG- REG	2,981	266.100	793,244.10	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	28,358	138.900	3,938,926.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	273.200	468,811.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	53.050	133,473.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	183	2,210.000	404,430.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	59	11,330.000	668,470.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	5	112,300.000	561,500.00	
	NESTLE SA-REG	154,736	120.100	18,583,793.60	
	ALCON INC	26,585	73.080	1,942,831.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,660	344.200	915,572.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,945.000	1,032,795.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,984	730.400	2,909,913.60	
	NOVARTIS AG-REG	119,588	74.240	8,878,213.12	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,921	383.000	735,743.00	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	37,796	357.500	13,512,070.00	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	105.200	277,517.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,570	70.800	111,156.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG- REG	145,488	8.866	1,289,896.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	57.180	717,609.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,575.000	1,894,725.00	
	UBS GROUP AG-REG	191,189	15.755	3,012,182.69	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	138.300	342,292.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	524.600	962,116.40	
	SWISS RE AG	15,168	86.660	1,314,458.88	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,094	381.800	3,090,289.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	88.600	346,071.60	
	TEMENOS AG - REG	3,743	121.300	454,025.90	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	8,150	75.440	614,836.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	513.400	718,246.60	
	スイス・フラン小計	934,327		83,685,718.98 (10,314,264,864)	
デンマーク	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	492.100	2,710,978.90	

ク・ク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	488.600	5,624,763.20	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	513	2,743.000	1,407,159.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,440	221.500	11,615,460.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	168	18,520.000	3,111,360.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	19,660.000	6,114,260.00	
	DSV A/S	10,950	1,427.500	15,631,125.00	
	PANDORA A/S	4,763	843.000	4,015,209.00	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,063.000	5,936,855.00	
	AMBU A/S-B	8,356	191.000	1,595,996.00	
	COLOPLAST-B	6,399	1,074.500	6,875,725.50	
	DEMANT A/S	4,455	314.600	1,401,543.00	
	GN STORE NORD A/S	6,484	385.600	2,500,230.40	
	GENMAB A/S	3,688	2,550.000	9,404,400.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	90,861	715.700	65,029,217.70	
	DANSKE BANK A/S	39,103	109.700	4,289,599.10	
	TRYG A/S	16,989	158.250	2,688,509.25	
ORSTED A/S	9,555	846.200	8,085,441.00		
デンマーク・クローネ小計		277,641		158,037,832.05	
				(2,729,313,360)	
ノル ウェー・ クローネ	EQUINOR ASA	51,871	227.150	11,782,497.65	
	NORSK HYDRO ASA	83,294	60.500	5,039,287.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	445.400	4,010,827.00	
	MOWI ASA	23,318	210.400	4,906,107.20	
	ORKLA ASA	46,955	84.100	3,948,915.50	
	DNB BANK ASA	45,957	201.800	9,274,122.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	207.300	2,365,707.60	
	TELENOR ASA	34,937	137.900	4,817,812.30	
	ADEVINTA ASA	15,540	131.950	2,050,503.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	358.000	1,961,840.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,338	410.400	1,369,915.20	
ノルウェー・クローネ小計		331,107		51,527,535.05	
				(649,762,217)	
スウェー デン・ク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	338.700	2,906,384.70	
	BOLIDEN AB	13,086	306.400	4,009,550.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	150.700	5,179,559.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	361.600	6,760,835.20	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	259.000	13,498,821.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,342	557.600	20,821,899.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,787	475.300	9,404,761.10	
	EPIROC AB-A	34,230	218.200	7,468,986.00	
	EPIROC AB-B	19,836	180.500	3,580,398.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	131.450	2,444,049.85	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	341.900	2,811,443.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	73,764	127.100	9,375,404.40	
	SANDVIK AB	61,070	229.400	14,009,458.00	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	210.300	3,613,584.90	
	SKF AB-B SHARES	20,607	210.300	4,333,652.10	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	202.000	2,683,166.00	
	VOLVO AB-B SHS	80,338	198.320	15,932,632.16	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	132.950	2,143,552.85	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	203.700	2,353,753.50	
	EVOLUTION AB	9,021	1,003.400	9,051,671.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	162.620	6,528,867.76	
	ICA GRUPPEN AB	5,614	534.200	2,998,998.80	
	SWEDISH MATCH AB	84,640	66.980	5,669,187.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,942	292.400	8,755,040.80	
	NORDEA BANK ABP	167,942	107.240	18,010,100.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	88,317	131.500	11,613,685.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	96.340	7,482,535.12	
	SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	183.560	8,429,258.76	
	EQT AB	15,443	531.400	8,206,410.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	9,851	275.000	2,709,025.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	271.500	2,889,303.00	
	INVESTOR AB-B SHS	101,275	211.850	21,455,108.75	
	KINNEVIK AB - B	12,465	328.550	4,095,375.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	507.800	1,710,270.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	684.800	3,645,190.40	
	SINCH AB	27,690	123.550	3,421,099.50	
	ERICSSON LM-B SHS	159,685	93.820	14,981,646.70	
	HEXAGON AB-B SHS	103,110	133.500	13,765,185.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	131.150	3,349,177.55	
	TELIA CO AB	143,404	35.375	5,072,916.50	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	95.080	2,853,540.96	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,755,805		300,025,487.19 (3,759,319,354)	
ユーロ	ENI SPA	136,972	11.800	1,616,269.60	
	GALP ENERGIA SGPS SA	29,687	8.390	249,073.93	
	NESTE OYJ	21,427	42.980	920,932.46	
	OMV AG	8,389	47.250	396,380.25	
	REPSOL SA	79,358	9.912	786,596.49	
	TENARIS SA	25,963	8.922	231,641.88	

TOTALENERGIES SE	135,430	41.200	5,579,716.00	
VOPAK	3,130	33.180	103,853.40	
AIR LIQUIDE SA	25,183	147.360	3,710,966.88	
AKZO NOBEL N.V.	9,886	94.460	933,831.56	
ARCELORMITTAL	36,689	24.440	896,679.16	
ARKEMA	3,250	116.000	377,000.00	
BASF SE	49,439	57.980	2,866,473.22	
COVESTRO AG	11,797	50.680	597,871.96	
CRH PLC	43,426	43.400	1,884,688.40	
EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	26.700	292,418.40	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	39.800	134,126.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	59.620	517,322.74	
KONINKLIJKE DSM NV	9,422	191.800	1,807,139.60	
LANXESS AG	4,409	51.240	225,917.16	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	45.870	592,686.27	
SOLVAY SA	3,758	99.220	372,868.76	
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	15.440	466,812.96	
SYMRISE AG	6,524	125.900	821,371.60	
UMICORE	10,288	43.070	443,104.16	
UPM-KYMMENE OYJ	28,055	32.700	917,398.50	
VOESTALPINE AG	6,056	29.480	178,530.88	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,931	21.540	278,533.74	
AIRBUS SE	32,094	99.690	3,199,450.86	
ALSTOM	17,665	32.370	571,816.05	
BOUYGUES SA	11,049	29.910	330,475.59	
BRENTAG SE	7,392	76.340	564,305.28	
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	14.945	818,612.37	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	26,413	57.240	1,511,880.12	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	84.450	145,254.00	
EIFFAGE	4,989	82.320	410,694.48	
FERROVIAL SA	24,693	25.100	619,794.30	
GEA GROUP AG	8,178	44.570	364,493.46	
KINGSPAN GROUP PLC	8,084	99.980	808,238.32	
KION GROUP AG	3,179	93.900	298,508.10	
KNORR-BREMSE AG	3,881	90.440	350,997.64	
KONE OYJ-B	17,618	59.160	1,042,280.88	
LEGRAND SA	13,323	95.780	1,276,076.94	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	167.650	495,741.05	
PRYSMIAN SPA	12,526	33.290	416,990.54	
RATIONAL AG	350	811.600	284,060.00	
SAFRAN SA	18,212	101.600	1,850,339.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,330	151.240	4,435,869.20	
SIEMENS AG-REG	40,905	144.560	5,913,226.80	

SIEMENS ENERGY AG	19,855	24.090	478,306.95	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	23.480	269,597.36	
THALES SA	5,403	73.880	399,173.64	
VINCI SA	29,309	84.160	2,466,645.44	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	12.335	329,998.25	
BUREAU VERITAS SA	17,817	28.310	504,399.27	
RANDSTAD NV	6,241	56.100	350,120.10	
TELEPERFORMANCE	2,970	357.400	1,061,478.00	
WOLTERS KLUWER	14,578	100.300	1,462,173.40	
ADP	1,346	104.400	140,522.40	
AENA SME SA	4,377	129.350	566,164.95	
ATLANTIA SPA	26,501	16.160	428,256.16	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	5.501	182,347.14	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,453	53.580	2,917,591.74	
GETLINK SE	22,311	12.895	287,700.34	
INPOST SA	10,902	10.312	112,421.42	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	85.780	1,533,145.94	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,564	70.500	180,762.00	
CONTINENTAL AG	5,578	93.250	520,148.50	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	46,680	82.800	3,865,104.00	
FAURECIA	6,090	37.140	226,182.60	
FERRARI NV	6,949	235.800	1,638,574.20	
MICHELIN (CGDE)	8,746	128.350	1,122,549.10	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PRF	7,765	75.000	582,375.00	
RENAULT SA	8,830	29.145	257,350.35	
STELLANTIS NV	105,516	15.568	1,642,673.08	
VALEO	14,444	24.570	354,889.08	
VOLKSWAGEN AG	1,960	255.400	500,584.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	9,776	164.520	1,608,347.52	
ADIDAS AG	10,146	254.300	2,580,127.80	
ESSILORLUXOTTICA	15,704	180.380	2,832,687.52	
HERMES INTERNATIONAL	1,676	1,640.000	2,748,640.00	
KERING	3,906	683.800	2,670,922.80	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	14,867	697.200	10,365,272.40	
MONCLER SPA	12,209	64.600	788,701.40	
PUMA SE	5,052	106.350	537,280.20	
SEB SA	1,127	133.300	150,229.10	
ACCOR SA	10,451	26.670	278,728.17	

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	8,869	122.050	1,082,461.45	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	41.830	241,986.55	
SODEXO SA	3,900	75.140	293,046.00	
DELIVERY HERO SE	8,061	119.300	961,677.30	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	58,328	29.670	1,730,591.76	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	58.150	541,202.05	
PROSUS NV	51,018	70.680	3,605,952.24	
ZALANDO SE	12,367	81.500	1,007,910.50	
CARREFOUR SA	35,990	15.170	545,968.30	
COLRUYT SA	2,164	41.350	89,481.40	
HELLOFRESH SE	9,790	94.500	925,155.00	
JERONIMO MARTINS	16,397	19.500	319,741.50	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	27.970	374,853.94	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,657	30.255	1,683,902.53	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,943	50.840	2,081,542.12	
DANONE	34,300	54.330	1,863,519.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	13.085	366,654.78	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	77.300	476,786.40	
HEINEKEN NV	13,143	93.440	1,228,081.92	
JDE PEET'S NV	2,166	25.050	54,258.30	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	108.350	887,711.55	
PERNOD RICARD SA	11,108	206.600	2,294,912.80	
REMY COINTREAU	1,273	213.400	271,658.20	
BEIERSDORF AG	5,138	89.260	458,617.88	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	66.800	399,063.20	
HENKEL AG & CO KGAA VOR- PREF	9,043	71.100	642,957.30	
L'OREAL	13,629	401.800	5,476,132.20	
AMPLIFON SPA	7,567	42.760	323,564.92	
BIOMERIEUX	1,570	127.350	199,939.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,924	177.500	341,510.00	
DIASORIN SPA	1,313	185.100	243,036.30	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,118	53.520	595,035.36	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	33.780	721,642.14	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,760	31.745	1,516,141.20	
ORPEA	2,695	83.600	225,302.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	580.000	758,640.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	64.460	1,058,819.96	

ARGENX SE	2,644	250.900	663,379.60	
BAYER AG-REG	51,733	45.320	2,344,539.56	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	112.980	791,989.80	
GRIFOLS SA	15,169	16.730	253,777.37	
IPSEN	1,498	86.780	129,996.44	
MERCK KGAA	6,832	219.600	1,500,307.20	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	36.930	231,218.73	
QIAGEN N.V.	12,543	49.230	617,491.89	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,578	54.960	251,606.88	
SANOFI	61,568	85.610	5,270,836.48	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	513.200	798,026.00	
UCB SA	6,623	97.040	642,695.92	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	12.672	364,788.86	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	4.802	1,694,572.97	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	927,220	2.783	2,580,453.26	
BNP PARIBAS	61,293	55.380	3,394,406.34	
CAIXABANK SA	218,103	2.287	498,801.56	
COMMERZBANK AG	46,644	6.235	290,825.34	
CREDIT AGRICOLE SA	58,140	12.132	705,354.48	
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	38.760	751,285.08	
FINECOBANK SPA	32,034	15.555	498,288.87	
ING GROEP NV	205,237	12.158	2,495,271.44	
INTESA SANPAOLO	905,032	2.143	1,939,483.57	
KBC GROUP NV	13,092	72.580	950,217.36	
MEDIOBANCA SPA	31,303	9.724	304,390.37	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,066	25.540	180,465.64	
SOCIETE GENERALE SA	41,025	27.485	1,127,572.12	
UNICREDIT SPA	112,845	10.570	1,192,771.65	
AMUNDI SA	3,955	75.050	296,822.75	
DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED	113,478	10.678	1,211,718.08	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,701	142.200	1,521,682.20	
EURAZEO SE	1,792	73.450	131,622.40	
EXOR NV	6,204	78.880	489,371.52	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	96.820	572,593.48	
SOFINA	804	406.800	327,067.20	
WENDEL	1,082	103.500	111,987.00	
AEGON NV	91,609	3.939	360,847.85	
AGEAS	11,247	46.310	520,848.57	
ALLIANZ SE-REG	21,783	192.080	4,184,078.64	

ASSICURAZIONI GENERALI	57,303	17.800	1,019,993.40	
AXA SA	100,473	24.235	2,434,963.15	
CNP ASSURANCES	8,978	21.580	193,745.24	
HANNOVER RUECK SE	3,058	155.500	475,519.00	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	7,364	239.100	1,760,732.40	
NN GROUP NV	14,069	43.890	617,488.41	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	11.195	297,361.59	
SAMPO OYJ-A SHS	28,454	43.060	1,225,229.24	
SCOR SE	10,907	26.700	291,216.90	
AROUNDTOWN SA	52,560	5.520	290,131.20	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	124.150	456,872.00	
VONOVIA SE	39,500	49.170	1,942,215.00	
VONOVIA SE-RTS	29,304	3.090	90,549.36	
ADYEN NV	1,069	2,460.500	2,630,274.50	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	58.080	1,427,025.60	
ATOS SE	4,592	37.360	171,557.12	
BECHTLE AG	4,305	63.240	272,248.20	
CAPGEMINI SE	8,961	201.900	1,809,225.90	
DASSAULT SYSTEMES SE	35,115	53.430	1,876,194.45	
EDENRED	12,139	40.500	491,629.50	
NEMETSCHKE SE	3,011	107.550	323,833.05	
NEXI SPA	20,612	13.795	284,342.54	
SAP SE	55,037	116.800	6,428,321.60	
TEAMVIEWER AG	9,059	12.350	111,878.65	
WORLDLINE SA	12,774	47.470	606,381.78	
NOKIA OYJ	280,161	5.019	1,406,128.05	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	396.400	973,162.00	
ASML HOLDING NV	22,544	704.800	15,889,011.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,533	40.220	2,877,057.26	
STMICROELECTRONICS NV	37,804	43.025	1,626,517.10	
CELLNEX TELECOM SA	27,081	53.240	1,441,792.44	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	183,030	16.040	2,935,801.20	
ELISA OYJ	8,681	53.280	462,523.68	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.275	162,386.10	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	2.619	454,666.25	
ORANGE	106,132	9.604	1,019,291.72	
PROXIMUS	4,617	16.030	74,010.51	
TELECOM ITALIA SPA	390,536	0.471	183,942.45	
TELECOM ITALIA-RSP	378,308	0.445	168,347.06	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.357	110,531.51	
TELEFONICA SA	274,278	3.961	1,086,415.15	

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	33.020	173,982.38	
E.ON SE	126,998	10.992	1,395,962.01	
EDF	20,779	12.345	256,516.75	
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	22.460	332,205.86	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.866	709,998.06	
ELIA GROUP SA/NV	2,063	109.100	225,073.30	
ENAGAS SA	14,471	20.120	291,156.52	
ENDESA SA	14,104	20.150	284,195.60	
ENEL SPA	431,652	6.789	2,930,485.42	
ENGIE	94,886	12.894	1,223,460.08	
FORTUM OYJ	24,312	25.560	621,414.72	
IBERDROLA SA	312,716	9.916	3,100,891.85	
NATURGY ENERGY GROUP SA	15,439	24.630	380,262.57	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	18.520	437,664.64	
RWE AG	34,673	35.020	1,214,248.46	
SNAM SPA	106,707	4.997	533,214.87	
SUEZ	18,986	19.770	375,353.22	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	87,142	6.496	566,074.43	
UNIPER SE	4,697	38.680	181,679.96	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,122	28.240	1,020,085.28	
VERBUND AG	3,190	89.750	286,302.50	
BOLLORE	39,433	4.766	187,937.67	
PUBLICIS GROUPE	13,301	57.960	770,925.96	
SCOUT24 SE	4,671	59.760	279,138.96	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	44.890	213,003.05	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	38,496	25.010	962,784.96	
VIVENDI SE	38,496	11.200	431,155.20	
ユーロ小計	10,264,670		258,721,961.28 (33,222,487,048)	
合計	58,359,119		338,023,942,089 (338,023,942,089)	

(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
アメリカ・ドル	株式	598銘柄	70.8%	74.1%
カナダ・ドル	株式	88銘柄	3.4%	3.5%
オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	1.7%	1.8%
香港・ドル	株式	30銘柄	0.8%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.3%	0.3%

ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	83銘柄	4.1%	4.3%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	40銘柄	2.9%	3.1%
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.8%	0.8%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	41銘柄	1.1%	1.1%
ユーロ	株式	232銘柄	9.4%	9.8%

(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	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,432.00	402,588.56	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,662.00	1,572,702.12	
		AMERICAN TOWER CORP	24,648.00	6,579,537.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	64,936.00	542,215.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344.00	1,768,288.32	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835.00	864,513.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,902.00	827,702.70	
		CROWN CASTLE INTL CORP	22,634.00	4,206,076.22	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,126.00	2,553,117.54	
		DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,288,103.15	
		EQUINIX INC	4,908.00	4,024,560.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664.00	734,880.48	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,773.00	1,618,608.06	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332.00	1,154,538.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376.00	1,497,696.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	979,429.36	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569.00	616,882.98	
		INVITATION HOMES INC	32,632.00	1,346,722.64	
		IRON MOUNTAIN INC	14,204.00	665,599.44	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	684,628.42	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,780.00	1,213,800.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,364.00	287,704.64	
		PROLOGIS INC	40,178.00	6,158,483.84	
PUBLIC STORAGE	8,249.00	2,737,760.61			
REALTY INCOME CORP	28,298.00	1,975,200.40			
REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	586,529.64			
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916.00	2,103,552.12			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	17,345.00	2,774,159.30	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088.00	1,197,814.00	
	UDR INC	16,633.00	955,898.51	
	VENTAS INC	19,379.00	951,896.48	
	VICI PROPERTIES INC	36,025.00	1,013,383.25	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	361,995.48	
	WELLTOWER INC	23,388.00	1,918,751.52	
	WEYERHAEUSER CO	38,940.00	1,508,925.00	
	WP CAREY INC	8,640.00	680,400.00	
	アメリカ・ドル小計	672,476.00	60,354,646.20 (6,866,548,098)	
カナ ダ・ド ル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	232,144.66	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	164,594.92	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	396,739.58 (35,412,975)	
オース トラリ ア・ド ル	APA GROUP	55,644.00	539,746.80	
	DEXUS/AU	54,256.00	588,677.60	
	GOODMAN GROUP	86,301.00	2,118,689.55	
	GPT GROUP	121,221.00	629,136.99	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	384,387.80	
	MIRVAC GROUP	200,053.00	580,153.70	
	SCENTRE GROUP	275,200.00	836,608.00	
	STOCKLAND	127,393.00	554,159.55	
	SYDNEY AIRPORT	62,186.00	512,412.64	
	TRANSURBAN GROUP	161,485.00	2,210,729.65	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	408,903.49	
	オーストラリア・ドル小計	1,421,243.00	9,363,605.77 (761,167,513)	
香港・ ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS	193,500.00	1,480,275.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,092,140.00	
	LINK REIT	110,100.00	7,563,870.00	
	香港・ドル小計	500,600.00	11,136,285.00 (162,478,398)	
シンガ ポー ル・ド ル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	509,795.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616.00	555,578.24	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	234,916.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	397,471.00	
	シンガポール・ドル小計	750,616.00	1,697,760.24 (141,270,630)	
イギリ	BRITISH LAND CO PLC	44,962.00	234,431.86	

ス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	299,356.11	
	SEGRO PLC	68,623.00	972,731.02	
イギリス・ポンド小計		153,446.00	1,506,518.99 (228,328,018)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	175,183.68	
	GECINA SA	2,189.00	261,257.15	
	KLEPIERRE	13,600.00	259,148.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	421,440.00	
ユーロ小計		25,201.00	1,117,028.83 (143,437,672)	
投資証券合計			8,338,643,304 (8,338,643,304)	
合 計			8,338,643,304 (8,338,643,304)	

(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
アメリカ・ドル	投資証券	36銘柄	1.9%	82.3%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	11銘柄	0.2%	9.1%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	-	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	-	1.7%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.7%
ユーロ	投資証券	4銘柄	-	1.7%

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

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

資産の部

流動資産

預金	526,830,782
金銭信託	148,804,249
コール・ローン	4,388,726,863
株式	9,917,488,534
新株予約権証券	15,618
投資信託受益証券	609,236,472

投資証券	1,160,702,755
派生商品評価勘定	95,588,547
未収入金	81,341
未収配当金	6,023,917
差入委託証拠金	1,095,136,406
流動資産合計	17,948,635,484
資産合計	17,948,635,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	399,979,043
その他未払費用	19,220
流動負債合計	399,998,263
負債合計	399,998,263
純資産の部	
元本等	
元本	10,481,267,749
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,067,369,472
元本等合計	17,548,637,221
純資産合計	17,548,637,221
負債純資産合計	17,948,635,484

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,481,267,749口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6743円 (1万口当たりの純資産額16,743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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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	(2021年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	<p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30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				
	MSCIE 2112	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
	小計	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
合計		6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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。

(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				
	アメリカ・ドル	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	小計	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	売建				
	アメリカ・ドル	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
	小計	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
合計		11,312,376,975	-	11,401,079,609	87,366,828

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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おります。

- ・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おります。
- ・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おります。

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	8,871,955,436円
同期中における追加設定元本額	1,737,420,987円
同期中における一部解約元本額	128,108,674円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,579,019,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,537,014,239円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,123,454円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,001,173円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	231,807,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,823,557円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	75,281,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	55,223,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	223,853,475円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	174,716,658円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	286,040,332円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,850,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,488,528円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	188,448,982円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	358,795,181円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	1,807,891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>	46,971,665円
合 計	10,481,267,749円

(3) 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	
アメリカ・ドル	YPF S.A.-SPONSORED ADR	2,632	3.390	8,922.48	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,909	7.000	20,363.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,088	59.560	64,801.28	
	51JOB INC-ADR	358	55.000	19,690.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,100	7.810	32,021.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC- ADR	5,820	30.980	180,303.60	
	LI AUTO INC - ADR	7,234	34.480	249,428.32	
	NIO INC - ADR	18,231	40.460	737,626.26	
	XPENG INC - ADR	5,176	51.360	265,839.36	
	GAOTU TECHEDU INC	1,659	2.760	4,578.84	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,407	39.150	94,234.05	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	20,808	2.160	44,945.28	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	5,571	5.000	27,855.00	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	6,827	27.120	185,148.24	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,670	50.470	286,164.90	
	BAOZUN INC-SPN ADR	838	14.840	12,435.92	
	DADA NEXUS LTD-ADR	799	21.360	17,066.64	
	JD.COM INC-ADR	11,657	87.910	1,024,766.87	
	PINDUODUO INC-ADR	5,914	71.960	425,571.44	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	6,030	9.660	58,249.80	
	ADECOAGRO SA	1,698	7.770	13,193.46	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,287	5.070	42,015.09	
	BEIGENE LTD-ADR	617	343.200	211,754.40	
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	588	14.500	8,526.00	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,066	34.030	36,275.98	
	I-MAB-SPONSORED ADR	471	63.550	29,932.05	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,053	72.410	76,247.73	
	CREDICORP LTD	911	118.480	107,935.28	
	360 DIGITECH INC	1,160	23.830	27,642.80	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	2,325	6.340	14,740.50	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	377	37.250	14,043.25		

	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,071	6.070	6,500.97	
	KE HOLDINGS INC-ADR	4,909	21.240	104,267.16	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	14,880	0.900	13,392.00	
	AGORA INC-ADR	680	20.630	14,028.40	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,520	9.860	14,987.20	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,203	55.650	66,946.95	
	GLOBANT SA	530	271.950	144,133.50	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	608	17.650	10,731.20	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,578	2.520	3,976.56	
	VNET GROUP INC-ADR	1,166	10.480	12,219.68	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	787	58.010	45,653.87	
	AUTOHOME INC-ADR	927	35.050	32,491.35	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,680	150.290	553,067.20	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,178	67.570	147,167.46	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,159	11.900	25,692.10	
	HUYA INC-ADR	1,153	7.860	9,062.58	
	IQIYI INC-ADR	3,643	6.380	23,242.34	
	JOYY INC-ADR	758	52.800	40,022.40	
	NETEASE INC-ADR	5,421	110.120	596,960.52	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	9,009	6.970	62,792.73	
	WEIBO CORP-SPON ADR	841	39.610	33,312.01	
	アメリカ・ドル小計	192,982		6,302,967.00 (717,088,556)	
香港・ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	26,000	6.280	163,280.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	338,000	3.520	1,189,760.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	46,000	16.540	760,840.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	298,000	3.410	1,016,180.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	20,000	12.220	244,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	52,000	3.800	197,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	36.400	637,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	31,000	7.480	231,880.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	36,000	4.650	167,400.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	8.650	415,200.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	38,000	5.770	219,260.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	3,400	145.800	495,720.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	12,000	22.500	270,000.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	14,000	12.800	179,200.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	13,000	5.470	71,110.00	
MMG LTD	32,000	2.830	90,560.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	21,000	8.890	186,690.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	6,250	14.200	88,750.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	10,000	7.980	79,800.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	76,000	10.240	778,240.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	5.300	137,800.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	55.400	193,900.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	20,000	3.810	76,200.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	37.850	794,850.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	15,000	11.200	168,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD- H	45,000	3.740	168,300.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	34,000	7.800	265,200.00	
CITIC LTD	77,000	7.160	551,320.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	31,500	8.630	271,845.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	7,000	21.750	152,250.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.130	154,470.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	11.680	116,800.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	24,000	13.820	331,680.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	10,418	17.300	180,231.40	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	6,600	50.800	335,280.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	5.160	67,080.00	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	53,000	5.220	276,660.00	
AIR CHINA LTD-H	32,000	5.040	161,280.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	4.540	90,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	16,140	12.100	195,294.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.440	106,560.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	42,900	12.880	552,552.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	24,000	6.100	146,400.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	7.700	169,400.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	13,000	8.560	111,280.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	12,000	7.080	84,960.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	5.630	168,900.00	
BYD CO LTD-H	10,500	302.200	3,173,100.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	7.280	232,960.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,200	43.050	396,060.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	79,000	23.950	1,892,050.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	41,500	33.350	1,384,025.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	39,200	7.750	303,800.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	36.550	365,500.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	14,000	13.580	190,120.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	14,000	122.900	1,720,600.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	44,000	5.390	237,160.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	30,200	28.750	868,250.00	
LI NING CO LTD	30,000	86.100	2,583,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,200	152.000	1,702,400.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	10,000	8.130	81,300.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	12,000	14.620	175,440.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	26,000	3.910	101,660.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	14,000	17.600	246,400.00	

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9,000	16.400	147,600.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	15,200	16.700	253,840.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	203,300	130.000	26,429,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	37.450	299,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	198,000	0.670	132,660.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	36,000	3.170	114,120.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,700	68.700	322,890.00	
MEITUAN-CLASS B	54,000	245.000	13,230,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	21,000	9.120	191,520.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,500	65.000	552,500.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	3.110	76,195.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,500	107.010	160,515.00	
CHINA FEIHE LTD	50,000	10.620	531,000.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	43,000	45.700	1,965,100.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	20,000	65.500	1,310,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	19,500	4.060	79,170.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	4,400	46.400	204,160.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	24,000	49.600	1,190,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	15.800	410,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	66.000	528,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	13,000	7.610	98,930.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	67,000	6.500	435,500.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	43.100	258,600.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	8,000	38.550	308,400.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	21.600	86,400.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	7.410	385,320.00	

JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	11.380	227,600.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	32.700	294,300.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,100	29.800	181,780.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	36,000	11.000	396,000.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	7,700	14.420	111,034.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	18,800	18.340	344,792.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,000	37.800	113,400.00	
3SBIO INC	17,000	6.670	113,390.00	
AKESO INC	4,000	49.900	199,600.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	160.500	160,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	17,000	12.940	219,980.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	12,000	3.360	40,320.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	42,000	3.800	159,600.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	120,800	8.270	999,016.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	16,000	40.500	648,000.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,400	126.700	177,380.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	16.140	290,520.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	16,000	71.200	1,139,200.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,000	159.700	319,400.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	7,500	40.000	300,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	145,000	5.640	817,800.00	
SSY GROUP LTD	10,000	3.720	37,200.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	4,411	172.500	760,897.50	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,000	106.400	5,107,200.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	340,000	2.600	884,000.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,071,000	2.730	2,923,830.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	108,000	4.650	502,200.00	

CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	27,500	2.450	67,375.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	120,000	3.390	406,800.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,288,000	5.070	6,530,160.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	34,000	2.710	92,140.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	52,500	60.950	3,199,875.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	80,100	3.030	242,703.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	24,000	2.630	63,120.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	755,000	4.160	3,140,800.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	115,000	5.410	622,150.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	90,000	1.240	111,600.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	8.300	66,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	36,000	4.240	152,640.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	92,000	0.790	72,680.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	18,400	18.520	340,768.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	33,000	18.240	601,920.00	
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	6.910	193,480.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	13.820	234,940.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	42,800	6.570	281,196.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	24,600	11.380	279,948.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	100,000	13.080	1,308,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,000	23.150	787,100.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	22,200	11.000	244,200.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	11,400	21.300	242,820.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	127,000	2.320	294,640.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	92,000	6.800	625,600.00	

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	85,500	55.550	4,749,525.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6,700	27.500	184,250.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	12,000	5.150	61,800.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,000	18.400	128,800.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	18,000	2.030	36,540.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	27,000	2.280	61,560.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	62,000	2.340	145,080.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	49,000	18.300	896,700.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	7.500	112,500.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	34.300	1,509,200.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	8,600	38.800	333,680.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	18.160	401,336.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	10,000	13.420	134,200.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	4.350	182,700.00	
CIFI HOLDINGS GROUP C- RTS	2,100	0.552	1,159.20	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	99,000	6.990	692,010.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	21,000	47.550	998,550.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	12,500	11.260	140,750.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	18,000	7.310	131,580.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,800	4.120	110,416.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,000	19.080	209,880.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	50,000	1.030	51,500.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	12,500	6.070	75,875.00	
LOGAN GROUP CO LTD	16,000	7.900	126,400.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,500	38.600	984,300.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO-H	1,200	52.200	62,640.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	4.640	116,000.00	

SEAZEN GROUP LTD	32,000	5.630	180,160.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	42,000	1.830	76,860.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	9.150	169,275.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	9.770	97,700.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	33,000	14.040	463,320.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	12.820	128,200.00	
WHARF HOLDINGS LTD	17,000	27.800	472,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	17,600	7.280	128,128.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	14,000	4.450	62,300.00	
CHINA YOUZAN LTD	172,000	0.710	122,120.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	34,000	12.720	432,480.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	35,000	23.000	805,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	5,000	23.000	115,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	12,000	12.920	155,040.00	
WEIMOB INC	21,000	9.510	199,710.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,000	34.150	307,350.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	8,500	31.850	270,725.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	10,000	39.550	395,500.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	12,000	13.720	164,640.00	
LENOVO GROUP LTD	102,000	7.660	781,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,600	237.600	2,280,960.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	192,200	19.300	3,709,460.00	
ZTE CORP-H	10,200	21.800	222,360.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	5,000	33.300	166,500.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	6,000	49.450	296,700.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	66,000	13.640	900,240.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	578,000	1.000	578,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	27.100	162,600.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	60,000	2.850	171,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	167,000	2.140	357,380.00	

	CHINA GAS HOLDINGS LTD	43,200	17.560	758,592.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	45,000	16.400	738,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	37,000	4.000	148,000.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	41.650	499,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	20.500	533,000.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,600	150.000	1,590,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	40,000	10.840	433,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	44,000	3.450	151,800.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	58,000	7.350	426,300.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	110,000	0.810	89,100.00	
	CHINA LITERATURE LTD	5,400	55.150	297,810.00	
	KINGSOFT CORP LTD	13,000	34.950	454,350.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	3,700	85.500	316,350.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	77,100	462.400	35,651,040.00	
	香港・ドル小計	11,488,919		185,639,503.10 (2,708,480,350)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	97.200	1,360,800.00	
	ASIA CEMENT CORP	29,000	42.450	1,231,050.00	
	CHINA STEEL CORP	158,000	32.900	5,198,200.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	49,000	79.300	3,885,700.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	52,000	103.000	5,356,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	71,000	82.700	5,871,700.00	
	TAIWAN CEMENT	67,077	46.500	3,119,080.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	822.000	1,644,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	35,000	28.150	985,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,214	279.000	896,706.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	33,740	120.000	4,048,800.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	29,000	29.500	855,500.00	
	WAN HAI LINES LTD	7,700	153.000	1,178,100.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	21,000	110.000	2,310,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	21,000	34.000	714,000.00	

ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,000	589.000	1,767,000.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	5,640	201.000	1,133,640.00	
GIANT MANUFACTURING	4,000	317.500	1,270,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	392.500	785,000.00	
POU CHEN	26,000	32.750	851,500.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	612.000	2,448,000.00	
MOMO.COM INC	1,000	1,660.000	1,660,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	277.500	2,220,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	67.300	4,374,500.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	275.500	826,500.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	65,754	16.700	1,098,091.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	252,000	24.300	6,123,600.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	162,201	27.200	4,411,867.20	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	139,792	23.300	3,257,153.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	105,855	20.450	2,164,734.75	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	147,000	33.900	4,983,300.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	124,760	15.000	1,871,400.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	125,958	18.200	2,292,435.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	128,105	23.550	3,016,872.75	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	48,299	45.750	2,209,679.25	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,463	242.000	4,226,046.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	131,160	24.300	3,187,188.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	107,000	59.300	6,345,100.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	182,000	16.200	2,948,400.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	23,745	30.450	723,035.25	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	99,000	73.500	7,276,500.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	148,432	10.650	1,580,800.80	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	12,180	63.800	777,084.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	290.500	2,033,500.00	
ACER INC	34,000	27.800	945,200.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	376.000	1,992,424.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	10,000	355.500	3,555,000.00	
AU OPTRONICS CORP	107,000	20.650	2,209,550.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	149.000	1,341,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	53,000	23.350	1,237,550.00	
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	253.500	6,591,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	11,000	65.000	715,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	167,800	103.500	17,367,300.00	
INNOLUX CORP	118,000	17.850	2,106,300.00	
INVENTEC CORP	42,000	26.050	1,094,100.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,080	1,995.000	2,154,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	31,000	60.600	1,878,600.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	8,000	161.500	1,292,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	3,000	584.000	1,752,000.00	
PEGATRON CORP	27,000	67.000	1,809,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	86.600	3,204,200.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	16,000	57.900	926,400.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	16,000	213.000	3,408,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	4,000	176.000	704,000.00	
WISTRON CORP	35,293	29.300	1,034,084.90	
WIWYNN CORP	1,000	1,020.000	1,020,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	24,520	49.950	1,224,774.00	
YAGEO CORPORATION	5,198	459.500	2,388,481.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	7,000	98.400	688,800.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	45,000	101.000	4,545,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,855.000	927,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	826.000	2,478,000.00	
MEDIATEK INC	20,000	1,030.000	20,600,000.00	

	NANYA TECHNOLOGY CORP	14,000	73.300	1,026,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	8,000	470.000	3,760,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	417.500	835,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	97.200	972,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	536.000	3,216,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	4,470.000	4,470,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	330,000	593.000	195,690,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	159,000	62.400	9,921,600.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	149.500	1,794,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	364.500	1,458,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	45,000	30.900	1,390,500.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	112.500	5,737,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	22,000	62.500	1,375,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	22,000	98.200	2,160,400.00	
	台湾・ドル小計	4,295,765		441,513,879.40 (1,807,822,731)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	10.700	145,070.60	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	22,149	50.900	1,127,384.10	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	5,390	12.100	65,219.00	
	エジプト・ポンド小計	41,097		1,337,673.70 (9,685,694)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,504	155.400	233,721.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	19,752	22.840	451,135.68	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	22.740	192,198.48	
	KOC HOLDING AS	9,107	29.020	264,285.14	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	22,434	12.290	275,713.86	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	947	246.500	233,435.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,702	69.450	396,003.90	
	AKBANK T.A.S.	39,334	6.600	259,604.40	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	35,453	11.400	404,164.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	22,389	6.630	148,439.07	

	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	15,566	18.480	287,659.68	
	トルコ・リラ小計	180,640		3,146,361.51 (28,084,736)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	43,200	87.780	3,792,096.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,695	256.830	435,326.85	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	11,700	50.610	592,137.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,700	58.830	452,991.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,000	249.660	1,248,300.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,655	392.150	1,041,158.25	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	3,050	149.870	457,103.50	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	71,100	69.790	4,962,069.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,000	132.800	929,600.00	
	BECLE SAB DE CV	6,000	47.580	285,480.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,465	256.980	633,455.70	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	19,600	52.810	1,035,076.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	17,600	33.390	587,664.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	34,700	125.960	4,370,812.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	28,200	20.120	567,384.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	459,500	18.570	8,532,915.00	
TELESITES SAB DE CV	14,700	18.880	277,536.00		
	メキシコ・ペソ小計	735,865		30,201,104.30 (158,643,381)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	26,650	49.100	1,308,515.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	836.000	3,168,440.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	570.000	746,700.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,282	56.550	2,277,947.10	
	SM INVESTMENTS CORP	3,205	980.000	3,140,900.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,770	197.900	2,329,283.00	

	JOLLIBEE FOODS CORP	7,480	235.000	1,757,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,180	133.000	1,353,940.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	22,527	91.000	2,049,957.00	
	BDO UNIBANK INC	28,670	124.000	3,555,080.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	24,240	49.900	1,209,576.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	4.060	450,254.00	
	AYALA LAND INC	117,600	34.500	4,057,200.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	131,400	37.400	4,914,360.00	
	GLOBE TELECOM INC	335	3,282.000	1,099,470.00	
	PLDT INC	1,255	1,680.000	2,108,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,340	288.000	673,920.00	
	フィリピン・ペソ小計	543,934		36,201,742.10 (81,761,635)	
チリ・ ペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,818	6,450.000	37,526,100.00	
	EMPRESAS CMPC SA	13,085	1,405.300	18,388,350.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,830	53,920.000	98,673,600.00	
	FALABELLA SA	10,123	2,700.000	27,332,100.00	
	CENCOSUD SA	18,317	1,270.000	23,262,590.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	6,640.000	10,531,040.00	
	BANCO DE CHILE	608,640	80.000	48,691,200.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	671	28,000.000	18,788,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,002,990	37.550	37,662,274.50	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,523	889.000	4,909,947.00	
	COLBUN SA	124,112	52.160	6,473,681.92	
	ENEL AMERICAS SA	263,707	108.000	28,480,356.00	
	ENEL CHILE SA	364,877	37.690	13,752,214.13	
	チリ・ペソ小計	2,421,279		374,471,454.05 (50,572,370)	
コロン ビア・ ペソ	ECOPETROL SA	61,693	2,595.000	160,093,335.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,656	30,400.000	111,142,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,554	30,750.000	170,785,500.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	24,400.000	72,858,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,933	21,000.000	124,593,000.00	
	コロンビア・ペソ小計	79,822		639,472,635.00 (18,034,407)	
イン ド・ル	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	10,659	367.450	3,916,649.55	

ピー

COAL INDIA LTD	20,779	154.250	3,205,160.75	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,413	296.450	2,197,583.85	
INDIAN OIL CORP LTD	29,088	118.800	3,455,654.40	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	34,064	144.100	4,908,622.40	
PETRONET LNG LTD	8,894	219.950	1,956,235.30	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	38,050	2,441.500	92,899,075.00	
ACC LTD	1,019	2,289.600	2,333,102.40	
AMBUJA CEMENTS LTD	9,373	369.150	3,460,042.95	
ASIAN PAINTS LTD	5,175	3,144.300	16,271,752.50	
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,709	740.250	2,005,337.25	
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,391	1,683.950	5,710,274.45	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,210	420.150	8,911,381.50	
JSW STEEL LTD	11,353	625.600	7,102,436.80	
PI INDUSTRIES LTD	1,067	2,954.700	3,152,664.90	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,056	2,218.100	4,560,413.60	
SHREE CEMENT LTD	146	25,566.100	3,732,650.60	
TATA STEEL LTD	9,384	1,114.750	10,460,814.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,418	7,388.250	10,476,538.50	
UPL LTD	7,208	689.350	4,968,834.80	
VEDANTA LTD	14,989	346.800	5,198,185.20	
ADANI ENTERPRISES LTD	4,024	1,665.050	6,700,161.20	
BHARAT ELECTRONICS LTD	19,131	197.250	3,773,589.75	
HAVELLS INDIA LTD	3,011	1,330.100	4,004,931.10	
LARSEN & TOUBRO LTD	9,215	1,767.250	16,285,208.75	
SIEMENS LTD	1,167	2,133.400	2,489,677.80	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	7,391	702.600	5,192,916.60	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,801	598.250	2,273,948.25	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,271	1,894.500	2,407,909.50	
BAJAJ AUTO LTD	949	3,298.200	3,129,991.80	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	971	2,163.200	2,100,467.20	
BHARAT FORGE LTD	3,465	697.050	2,415,278.25	
EICHER MOTORS LTD	1,826	2,413.400	4,406,868.40	
HERO MOTOCORP LTD	1,617	2,490.800	4,027,623.60	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	11,737	850.800	9,985,839.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,833	7,149.500	13,105,033.50	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	17,036	214.050	3,646,555.80	
MRF LTD	21	73,818.250	1,550,183.25	
TATA MOTORS LTD	21,998	461.450	10,150,977.10	
PAGE INDUSTRIES LTD	82	38,031.050	3,118,546.10	

TITAN CO LTD	4,625	2,324.200	10,749,425.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,066	3,640.250	3,880,506.50	
TRENT LTD	2,023	1,026.700	2,077,014.10	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,184	4,673.350	10,206,596.40	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,462	3,528.600	5,158,813.20	
ITC LTD	41,784	221.500	9,255,156.00	
NESTLE INDIA LTD	452	19,000.400	8,588,180.80	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,079	766.000	6,188,514.00	
UNITED SPIRITS LTD	3,920	890.100	3,489,192.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,365	1,445.350	1,972,902.75	
DABUR INDIA LTD	8,343	598.000	4,989,114.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,827	913.200	4,408,016.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,978	2,329.400	25,572,153.20	
MARICO LTD	6,577	534.750	3,517,050.75	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,357	5,727.500	7,772,217.50	
AUROBINDO PHARMA LTD	3,611	654.900	2,364,843.90	
BIOCON LTD	4,686	364.400	1,707,578.40	
CIPLA LTD	6,526	965.000	6,297,590.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,790	4,921.350	8,809,216.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,514	4,697.600	7,112,166.40	
IPCA LABORATORIES LTD	918	2,120.350	1,946,481.30	
LUPIN LTD	3,151	893.000	2,813,843.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,932	751.050	8,210,478.60	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	556	3,037.300	1,688,738.80	
AXIS BANK LTD	30,568	651.100	19,902,824.80	
BANDHAN BANK LTD	10,002	268.850	2,689,037.70	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	23,102	2,713.800	62,694,207.60	
ICICI BANK LTD	68,018	718.400	48,864,131.20	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	7,481	2,019.600	15,108,627.60	
STATE BANK OF INDIA	22,850	465.100	10,627,535.00	
YES BANK LTD	111,806	12.150	1,358,442.90	
BAJAJ FINANCE LTD	3,647	6,905.750	25,185,270.25	
BAJAJ FINSERV LTD	487	16,890.400	8,225,624.80	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,281	542.200	3,405,558.20	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	718	2,508.500	1,801,103.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,343	1,427.100	1,916,595.30	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,440	2,384.700	3,433,968.00	

	REC LTD	9,915	128.900	1,278,043.50	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,787	937.000	2,611,419.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,560	1,403.250	3,592,320.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	10,903	683.650	7,453,835.95	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,989	1,434.250	4,286,973.25	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	4,842	587.250	2,843,464.50	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,070	1,136.250	6,897,037.50	
	DLF LTD	8,519	374.850	3,193,347.15	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	14,640	1,133.150	16,589,316.00	
	INFOSYS LTD	45,640	1,696.350	77,421,414.00	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	627	6,748.550	4,231,340.85	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	12,472	3,502.000	43,676,944.00	
	TECH MAHINDRA LTD	8,114	1,536.650	12,468,378.10	
	WIPRO LTD	18,340	630.600	11,565,204.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	33,090	739.350	24,465,091.50	
	INDUS TOWERS LTD	9,651	281.500	2,716,756.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,136	1,352.750	6,947,724.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	4,019	1,579.600	6,348,412.40	
	ADANI TRANSMISSION LTD	4,001	1,894.200	7,578,694.20	
	GAIL INDIA LTD	20,678	130.350	2,695,377.30	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,121	480.900	1,981,788.90	
	NTPC LTD	69,036	126.500	8,733,054.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	44,752	200.250	8,961,588.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,041	5,845.900	6,085,581.90	
	インド・ルピー小計	1,114,403		930,260,940.60 (1,423,299,239)	
インド ネシ ア・ル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	263,900	1,690.000	445,991,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	19,300	21,825.000	421,222,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	2,330.000	298,240,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	364,200	985.000	358,737,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	29,700	7,800.000	231,660,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,200	10,525.000	138,930,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	179,700	3,740.000	672,078,000.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	43,500	8,200.000	356,700,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	255,600	5,975.000	1,527,210,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	112,900	5,700.000	643,530,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,000	32,775.000	131,100,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	21,200	8,875.000	188,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	51,300	6,500.000	333,450,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	104,500	4,630.000	483,835,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	246,100	1,605.000	394,990,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	748,000	7,400.000	5,535,200,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	265,600	7,175.000	1,905,680,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	103,700	6,950.000	720,715,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	913,000	4,170.000	3,807,210,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	283,900	1,190.000	337,841,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	692,700	4,140.000	2,867,778,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	3,080.000	366,212,000.00	
	インドネシア・ルピア小 計	4,962,900		22,166,460,000.00 (177,331,680)	
ブラジ ル・レ アル	COSAN SA	12,688	21.480	272,538.24	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	49,800	30.160	1,501,968.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	63,800	29.470	1,880,186.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,600	14.190	150,414.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,275	49.200	161,130.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,600	52.200	135,720.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	8,500	22.540	191,590.00	
	GERDAU SA-PREF	16,400	25.800	423,120.00	
	SUZANO SA	10,615	55.670	590,937.05	
	VALE SA	53,100	69.500	3,690,450.00	
	WEG SA	22,460	32.410	727,928.60	

CCR SA	13,800	11.510	158,838.00	
LOCALIZA RENT A CAR	7,900	52.250	412,775.00	
RUMO SA	15,600	17.620	274,872.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,100	39.640	83,244.00	
AMERICANAS SA	5,275	31.450	165,898.75	
LOJAS RENNER S.A.	14,058	28.940	406,838.52	
MAGAZINE LUIZA SA	41,000	8.040	329,640.00	
VIA S/A	14,000	5.850	81,900.00	
VIBRA ENERGIA SA	15,680	21.660	339,628.80	
ATACADAO SA	8,100	15.540	125,874.00	
RAIA DROGASIL SA	14,300	22.610	323,323.00	
AMBEV SA	65,400	16.340	1,068,636.00	
BRF SA	9,900	20.400	201,960.00	
JBS SA	11,800	34.730	409,814.00	
NATURA &CO HOLDING SA	12,100	26.870	325,127.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,000	11.410	193,970.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,700	64.050	429,135.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,400	51.250	276,750.00	
HYPERA SA	6,000	27.350	164,100.00	
BANCO BRADESCO S.A.	17,938	17.440	312,838.72	
BANCO BRADESCO SA-PREF	65,806	20.270	1,333,887.62	
BANCO DO BRASIL S.A.	10,600	30.810	326,586.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,900	22.660	1,470,634.00	
ITAUSA SA	62,380	9.820	612,571.60	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	82,000	11.500	943,000.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	8,600	21.400	184,040.00	
TOTVS SA	6,600	32.140	212,124.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	6,900	50.320	347,208.00	
TIM SA	11,100	13.890	154,179.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,800	32.920	125,096.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,100	32.290	100,099.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	13,946	13.450	187,573.70	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	6.100	67,100.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,900	34.300	133,770.00	
CPFL ENERGIA SA	2,400	26.350	63,240.00	

	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	38.860	99,093.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,200	22.780	255,136.00	
	ブラジル・リアル小計	928,671		22,426,482.60 (454,999,692)	
チェ コ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	934	860.500	803,707.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	95.000	455,050.00	
	CEZ AS	2,068	730.500	1,510,674.00	
	チェコ・コルナ小計	7,792		2,769,431.00 (13,905,313)	
韓国・ ウォン	GS HOLDINGS	628	38,600.000	24,240,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	682	204,500.000	139,469,000.00	
	S-OIL CORP	553	83,500.000	46,175,500.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,476	33,550.000	49,519,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,044	38,400.000	40,089,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	97	503,000.000	48,791,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	227	157,000.000	35,639,000.00	
	LG CHEM LTD	614	712,000.000	437,168,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	89	340,000.000	30,260,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	207	200,500.000	41,503,500.00	
	POSCO	1,000	264,500.000	264,500,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	461	155,000.000	71,455,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	144	145,500.000	20,952,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	191	165,500.000	31,610,500.00	
	SKC CO LTD	281	199,000.000	55,919,000.00	
	CJ CORP	168	82,700.000	13,893,600.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	415	23,700.000	9,835,500.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	664	36,800.000	24,435,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,599	19,900.000	71,620,100.00	
	ECOPRO BM CO LTD	147	523,900.000	77,013,300.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	891	37,650.000	33,546,150.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	921	45,600.000	41,997,600.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	570	54,100.000	30,837,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,063	28,700.000	30,508,100.00		
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	478	91,000.000	43,498,000.00		
LG CORP	1,117	80,800.000	90,253,600.00		
SAMSUNG C&T CORP	1,079	107,500.000	115,992,500.00		

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,075	21,550.000	44,716,250.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,668	5,260.000	35,073,680.00	
SK INC	453	254,500.000	115,288,500.00	
S-1 CORPORATION	219	74,600.000	16,337,400.00	
CJ LOGISTICS	74	129,000.000	9,546,000.00	
HMM CO LTD	3,618	24,750.000	89,545,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	234	150,500.000	35,217,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,328	26,550.000	61,808,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	4,527	5,420.000	24,536,340.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	963	38,600.000	37,171,800.00	
HANON SYSTEMS	2,380	13,200.000	31,416,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	897	227,000.000	203,619,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,861	200,500.000	373,130,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	419	95,000.000	39,805,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	313	93,000.000	29,109,000.00	
KIA CORP	3,528	79,200.000	279,417,600.00	
COWAY CO LTD	746	71,400.000	53,264,400.00	
FILA HOLDINGS CORP	620	34,800.000	21,576,000.00	
HLB INC	1,314	37,250.000	48,946,500.00	
LG ELECTRONICS INC	1,477	119,500.000	176,501,500.00	
KANGWON LAND INC	1,392	22,900.000	31,876,800.00	
CJ ENM CO LTD	144	144,500.000	20,808,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	72,200.000	29,385,400.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	88,600.000	15,239,200.00	
SHINSEGAE INC	120	215,500.000	25,860,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	61	147,500.000	8,997,500.00	
E-MART INC	237	149,500.000	35,431,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	125	369,000.000	46,125,000.00	
KT&G CORP	1,574	83,100.000	130,799,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	373	103,000.000	38,419,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	419	166,500.000	69,763,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	43,250.000	20,457,250.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	130	1,113,000.000	144,690,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	17	618,000.000	10,506,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,127	83,300.000	93,879,100.00	
ALTEOGEN INC	312	68,000.000	21,216,000.00	
CELLTRION INC	1,293	212,500.000	274,762,500.00	
CELLTRION PHARM INC	173	122,300.000	21,157,900.00	

GREEN CROSS CORP	79	223,000.000	17,617,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	261,000.000	22,707,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	221	884,000.000	195,364,000.00	
SEEGENE INC	408	75,000.000	30,600,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	334	33,950.000	11,339,300.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	383	95,800.000	36,691,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	256	277,000.000	70,912,000.00	
YUHAN CORP	760	58,900.000	44,764,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	4,190	40,800.000	170,952,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,084	10,750.000	43,903,000.00	
KAKAObANK CORP	700	70,300.000	49,210,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,328	55,300.000	294,638,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,922	36,300.000	214,968,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,654	12,700.000	84,505,800.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	576	78,900.000	45,446,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	5,070.000	28,026,960.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,496	8,860.000	39,834,560.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	12,650.000	30,056,400.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	982	45,150.000	44,337,300.00	
SK SQUARE CO LTD	227	76,000.000	17,252,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	507	54,100.000	27,428,700.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	378	208,000.000	78,624,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,020	62,000.000	63,240,000.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	190	75,500.000	14,345,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	428	147,500.000	63,130,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	3,101	20,500.000	63,570,500.00	
LG INNOTEK CO LTD	158	292,500.000	46,215,000.00	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO	794	170,000.000	134,980,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	63,941	72,300.000	4,622,934,300.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	11,017	65,800.000	724,918,600.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	737	709,000.000	522,533,000.00	
SK HYNIX INC	7,310	116,000.000	847,960,000.00	
LG UPLUS CORP	3,103	13,750.000	42,666,250.00	

	SK TELECOM	352	57,900.000	20,380,800.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,402	21,550.000	73,313,100.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	22,250.000	26,544,250.00	
	HYBE CO LTD	182	369,000.000	67,158,000.00	
	KAKAO CORP	4,160	123,000.000	511,680,000.00	
	NAVER CORP	1,649	386,500.000	637,338,500.00	
	NCSOFT CORP	228	689,000.000	157,092,000.00	
	NETMARBLE CORP	337	120,000.000	40,440,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	399	133,200.000	53,146,800.00	
	韓国・ウォン小計	210,246		15,018,888,690.00 (1,438,809,537)	
マレー シア・ リン ギット	DIALOG GROUP BHD	48,600	2.570	124,902.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,000	19.700	59,100.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	34,800	8.210	285,708.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	39,200	5.230	205,016.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	7.650	61,965.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.200	103,620.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	5.800	85,260.00	
	MISC BHD	19,600	6.650	130,340.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	4.100	41,000.00	
	GENTING BHD	25,800	4.580	118,164.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	43,800	2.860	125,268.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	23.900	28,680.00	
	IOI CORP BHD	31,800	3.640	115,752.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	5,000	20.140	100,700.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	900	134.000	120,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	9,040	17.000	153,680.00	
	QL RESOURCES BHD	13,050	4.470	58,333.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	23,900	3.680	87,952.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,100	6.400	147,840.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	27,500	6.600	181,500.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	15,000	2.350	35,250.00	
	SUPERMAX CORP BHD	16,968	2.150	36,481.20	
	TOP GLOVE CORP BHD	76,500	3.190	244,035.00	
AMMB HOLDINGS BHD	17,000	3.080	52,360.00		
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	92,600	5.110	473,186.00		
HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.200	183,820.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	17.240	32,756.00		

	MALAYAN BANKING BHD	53,500	8.050	430,675.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	196,300	3.960	777,348.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.260	152,014.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,600	3.980	129,748.00	
	DIGI.COM BHD	38,800	4.130	160,244.00	
	MAXIS BHD	26,800	4.430	118,724.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	5.390	86,240.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,600	16.300	172,780.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	33,100	9.260	306,506.00	
	マレーシア・リンギット 小計	1,096,858		5,727,547.70 (153,794,393)	
南アフリカ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	3,530	152.430	538,077.90	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,503	199.720	300,179.16	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	762	1,621.660	1,235,704.92	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,848	322.460	1,885,746.08	
	GOLD FIELDS LTD	11,457	172.960	1,981,602.72	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	8,544	63.940	546,303.36	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,682	191.240	2,042,825.68	
	KUMBA IRON ORE LTD	836	436.930	365,273.48	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	4,813	218.960	1,053,854.48	
	SASOL LTD	7,312	258.780	1,892,199.36	
	SIBANYE STILLWATER LTD	39,150	48.380	1,894,077.00	
	BIDVEST GROUP LTD	3,606	184.390	664,910.34	
	MR PRICE GROUP LTD	3,242	198.930	644,931.06	
	NASPERS LTD-N SHS	2,934	2,461.490	7,222,011.66	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,822	51.160	655,973.52	
	BID CORP LTD	4,394	296.450	1,302,601.30	
	CLICKS GROUP LTD	3,408	287.270	979,016.16	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,730	195.300	1,314,369.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,598	166.690	433,060.62	
	TIGER BRANDS LTD	2,304	184.420	424,903.68	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,233	224.220	1,173,343.26	
	ABSA GROUP LTD	9,719	131.920	1,282,130.48	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,084	1,764.320	1,912,522.88	
NEDBANK GROUP LTD	7,081	162.060	1,147,546.86		
STANDARD BANK GROUP LTD	17,479	128.990	2,254,616.21		
FIRSTRAND LTD	67,593	55.250	3,734,513.25		

	REINET INVESTMENTS SCA	1,681	261.970	440,371.57	
	REMGRO LTD	6,563	126.600	830,875.80	
	DISCOVERY LTD	5,836	133.360	778,288.96	
	OLD MUTUAL LTD	63,504	12.460	791,259.84	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	9,457	41.480	392,276.36	
	SANLAM LTD	25,896	55.320	1,432,566.72	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,844	98.740	577,036.56	
	MTN GROUP LTD	22,704	159.410	3,619,244.64	
	VODACOM GROUP LTD	8,666	137.150	1,188,541.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	5,073	122.260	620,224.98	
	南アフリカ・ランド小計	399,888		49,552,981.75 (349,348,521)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL- NVDR	18,400	113.500	2,088,400.00	
	PTT PCL-NVDR	139,400	36.000	5,018,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	15,000	48.500	727,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL- NVDR	24,700	39.750	981,825.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	33,300	57.000	1,898,100.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	17,200	62.250	1,070,700.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,800	381.000	4,114,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC- NVDR	55,000	59.750	3,286,250.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	126,600	8.400	1,063,440.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL- NVDR	90,600	9.050	819,930.00	
	ASSET WORLD CORP PCL- NVDR	69,600	4.220	293,712.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	36,600	28.250	1,033,950.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL- NVDR	20,891	33.000	689,403.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	74,400	13.900	1,034,160.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE- NVDR	36,300	25.250	916,575.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO- NVDR	19,000	34.250	650,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	81,100	59.500	4,825,450.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	114.000	615,600.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS- NVDR	53,100	24.600	1,306,260.00		
OSOTSPA PCL-NVDR	16,200	32.750	530,550.00		

	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	31,900	19.800	631,620.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	127,700	22.700	2,898,790.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	5,400	146.500	791,100.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,000	32.500	422,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	29,200	11.500	335,800.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	12,700	123.500	1,568,450.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,000	20.200	363,600.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,300	54.250	775,775.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	57.000	433,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	61.500	725,700.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	25,200	53.250	1,341,900.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	108,900	8.500	925,650.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	4,500	442.000	1,989,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,000	211.000	3,376,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	14,400	75.000	1,080,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	150,000	4.620	693,000.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	6,800	40.250	273,700.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,800	169.500	644,100.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	20,800	79.000	1,643,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	9,600	74.500	715,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	40,800	40.000	1,632,000.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	7,900	43.750	345,625.00	
	タイ・パーツ小計	1,623,891		56,571,665.00 (191,212,228)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,209	71.620	301,448.58	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	21,226	5.506	116,870.35	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,813	134.550	243,939.15	
	LPP SA	15	12,330.000	184,950.00	
	ALLEGRO.EU SA	4,840	40.940	198,149.60	
	DINO POLSKA SA	651	335.600	218,475.60	

	BANK PEKAO SA	2,279	116.000	264,364.00	
	PKO BANK POLSKI SA	11,801	41.980	495,405.98	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	565	338.100	191,026.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,749	35.200	307,964.80	
	ORANGE POLSKA SA	6,710	8.355	56,062.05	
	PGE SA	10,070	8.066	81,224.62	
	CD PROJEKT SA	1,044	191.520	199,946.88	
	CYFROWY POLSAT SA	3,380	34.040	115,055.20	
	ポーランド・ズロチ小計	77,352		2,974,883.31 (81,706,955)	
ハンガ リー・ フォリ ント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,818	2,440.000	14,195,920.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,803	8,600.000	15,505,800.00	
	OTP BANK PLC	2,983	17,735.000	52,903,505.00	
	ハンガリー・フォリント 小計	10,604		82,605,225.00 (28,884,899)	
ユーロ	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	2,776	12.330	34,228.08	
	JUMBO SA	1,451	12.360	17,934.36	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	30,000	1.044	31,320.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	35,017	0.895	31,340.21	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,986	15.150	45,237.90	
	PUBLIC POWER CORP	2,811	9.400	26,423.40	
	ユーロ小計	75,164		187,074.35 (24,022,217)	
	合計	30,488,072		9,917,488,534 (9,917,488,534)	

(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
アメリカ・ドル	株式	52銘柄	4.1%	7.2%
香港・ドル	株式	213銘柄	15.4%	27.3%
台湾・ドル	株式	87銘柄	10.3%	18.2%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.2%	0.3%
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	0.9%	1.6%
フィリピン・ペソ	株式	17銘柄	0.5%	0.8%
チリ・ペソ	株式	13銘柄	0.3%	0.5%
コロンビア・ペソ	株式	5銘柄	0.1%	0.2%

インド・ルピー	株式	101銘柄	8.1%	14.4%
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.0%	1.8%
ブラジル・レアル	株式	48銘柄	2.6%	4.6%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	株式	107銘柄	8.2%	14.5%
マレーシア・リングギット	株式	36銘柄	0.9%	1.6%
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	2.0%	3.5%
タイ・バーツ	株式	42銘柄	1.1%	1.9%
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.5%	0.8%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	7銘柄	0.1%	0.2%

(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	
新株予約権証券	タイ・バーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR-CW24	9,060.00	4,620.60		
		タイ・バーツ小計	9,060.00	4,620.60 (15,618)		
新株予約権証券合計				15,618 (15,618)		
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	691,400.00	34,168,988.00		
		オフショア・人民元小計	691,400.00	34,168,988.00 (609,236,472)		
投資信託受益証券合計				609,236,472 (609,236,472)		
投資証券	アメリカ・ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	729.00	17,590.77		
		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	18,439.00	637,141.20		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	38,065.00	768,265.89		
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	86,125.00	3,836,868.75		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ET	83,970.00	3,320,173.80		
		ISHARES MSCI UAE ETF	58,146.00	945,744.69		
	アメリカ・ドル小計			285,474.00	9,525,785.10 (1,083,748,571)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	211,300.00	2,899,036.00		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,770.00	706,991.10		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,600.00	4,117,680.00		
		GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	34,100.00	1,356,157.00		
		MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184.00	245,977.36		
TRUST FIBRA UNO		36,300.00	703,131.00			

メキシコ・ペソ小計		319,254.00	10,028,972.46 (52,681,189)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,000.00	340,000.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	4,200.00	158,382.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,300.00	212,688.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,800.00	81,720.00	
	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	1,575.00	5,937.75	
	KLABIN SA - UNIT	8,800.00	209,000.00	
ブラジル・リアル小計		38,675.00	1,007,727.75 (20,445,283)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	42,751.00	542,937.70	
南アフリカ・ランド小計		42,751.00	542,937.70 (3,827,711)	
投資証券合計			1,160,702,755 (1,160,702,755)	
合 計			1,769,954,845 (1,769,954,845)	

(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
アメリカ・ドル	投資証券	6銘柄	-	6.2%	61.2%
メキシコ・ペソ	投資証券	6銘柄	-	0.3%	3.0%
ブラジル・リアル	投資証券	6銘柄	-	0.1%	1.2%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	3.5%	-	34.4%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	-	0.2%
タイ・バーツ	新株予約権証券	1銘柄	-	-	0.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

資産の部
流動資産

預金	396,577,581
金銭信託	32,775,079
コール・ローン	966,644,903
国債証券	158,467,947,570
未収入金	160,000,000
未収利息	923,046,863
前払費用	27,752,110
流動資産合計	160,974,744,106
資産合計	160,974,744,106
負債の部	
流動負債	
未払解約金	64,889,630
その他未払費用	4,621
流動負債合計	64,894,251
負債合計	64,894,251
純資産の部	
元本等	
元本	81,104,632,252
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,805,217,603
元本等合計	160,909,849,855
純資産合計	160,909,849,855
負債純資産合計	160,974,744,106

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30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	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. 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,104,632,252口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9840円 (1万口当たりの純資産額19,840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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価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る場合、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	(2021年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<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)

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	81,286,495,969円
同期中における追加設定元本額	2,319,084,008円
同期中における一部解約元本額	2,500,947,725円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,425,521,726円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	758,942,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,117,964,664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)	157,128,366円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,821,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,281,532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)	100,943,914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)	215,135,121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)	146,946,116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)	249,088,888円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,674,124円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	85,391,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,913,482円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	77,222,607円
イオン・バランス戦略ファンド	49,411,643円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	48,301,118円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	117,660,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,967,007円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	115,080,948円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	216,500,817円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,164,325円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	34,944,842円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	23,626,754円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,299,105円

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	127,761,903円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	3,423,237円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,393,064,796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>	44,105,389円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,457,552,993円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,630,256,069円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,737,712,617円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	726,204,731円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,446,325,136円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,571,810,158円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,949,497,571円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	632,409円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,245,225,547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)	334,892,322円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,241,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,472,321円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	97,489,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	106,160,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,054,447,345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>	661,340,146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>	960,695,213円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,204,599,718円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	418,833,625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>	12,768,298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>	141,011,485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>	245,134,628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>	265,817,919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>	836,545,356円
合計	81,104,632,252円

(3) 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	アメリカ・ドル	US TREASURY BOND	1,000,000.00	1,278,590.00	
		US TREASURY BOND	500,000.00	631,990.00	
		US TREASURY BOND	320,000.00	428,697.60	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,547,705.00	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,879,686.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,775,088.00	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,755,350.00	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,177,300.00	
		US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,384,548.00	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,791,488.00	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,120,168.00	
		US TREASURY N/B	700,000.00	927,773.00	
		US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,954,904.00	
		US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,343,219.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,785,610.00	
		US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,844,328.00	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,698,000.00	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	4,016,958.00	
		US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,314,149.00	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,623,865.00	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	4,186,875.00	
		US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,526,974.00	
		US TREASURY N/B	4,900,000.00	5,096,343.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,604,200.00	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,455,531.00	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,365,112.00	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,186,680.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,046,260.00	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,089,250.00	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,081,840.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,052,140.00	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	3,257,712.00	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,801,332.00			
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,220,798.00			
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,045,570.00			
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,047,670.00			
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,054,960.00			

US TREASURY N/B	14,950,000.00	15,273,518.00	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,000,212.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,056,580.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	507,910.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,042,630.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,541,200.00	
US TREASURY N/B	2,850,000.00	3,029,892.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,050,850.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,065,490.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,196,450.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,200,130.00	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,285,656.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,105,930.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,631,132.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,279,398.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,045,875.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,724,185.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,064,920.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,068,820.00	
US TREASURY N/B	4,900,000.00	5,189,786.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,689,654.00	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,407,877.00	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,236,284.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,629,185.00	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,422,138.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,454,588.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,915,596.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,151,680.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,557,820.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	833,528.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,759,215.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,638,216.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,869,876.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,232,215.00	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,229,664.00	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,575,304.00	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	5,200,464.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,811,760.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,117,320.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,120,300.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,430,088.00	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,998,890.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,344,188.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,832,500.00	

US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,023,232.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,850.00	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,172,699.00	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,888,190.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,078,340.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,927,140.00	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	6,656,742.00	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,234,022.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,953,178.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,297,480.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,045,580.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,333,461.00	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,230,542.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	4,089,551.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,094,140.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,982,004.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,679,100.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,674,296.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,869,155.00	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	5,085,541.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,709,302.00	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,846,964.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,992,065.00	
US TREASURY N/B	13,300,000.00	13,943,055.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,945,616.00	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,368,714.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,699,894.00	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,365,850.00	
US TREASURY N/B	850,000.00	873,273.00	
US TREASURY N/B	4,450,000.00	4,513,768.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,774,785.00	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,172,917.00	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,986,190.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,094,840.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,106,321.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,067,710.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,040,780.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,515,075.00	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,869,104.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,991,080.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,479,660.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,454,520.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,468,904.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,780.00	

US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,995,700.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,511,835.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,850.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,041,010.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,058,280.00	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	6,993,150.00	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,371,210.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,880,000.00	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,685,832.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,943,960.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,883,510.00	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,338,584.00	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,281,682.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,221,228.00	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,211,428.00	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,475,246.00	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,184,968.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	3,976,515.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,960,240.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,942,180.00	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,399,626.00	
US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,663,919.00	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,644,190.00	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,006,720.00	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,237,350.00	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,780,048.00	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,465,500.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,945,380.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,915,490.00	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,015,664.00	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,902,424.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,985,810.00	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,624,463.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,798,506.00	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,338,280.00	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,391,865.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,132,800.00	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,513,204.00	
US TREASURY N/B	5,900,000.00	5,748,783.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,381,256.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	879,464.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,203,820.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	628,825.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	251,640.00	

	US TREASURY N/B	300,000.00	412,218.00	
	US TREASURY N/B	300,000.00	424,662.00	
	US TREASURY N/B	700,000.00	976,934.00	
	US TREASURY N/B	600,000.00	863,202.00	
	US TREASURY N/B	900,000.00	1,261,755.00	
	US TREASURY N/B	500,000.00	660,195.00	
	US TREASURY N/B	600,000.00	829,218.00	
	US TREASURY N/B	900,000.00	1,322,820.00	
	US TREASURY N/B	300,000.00	422,976.00	
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,959,255.00	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,204,530.00	
	US TREASURY N/B	800,000.00	947,056.00	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,278,280.00	
	US TREASURY N/B	300,000.00	342,021.00	
	アメリカ・ドル小計	628,020,000.00	656,596,545.10 (74,700,988,936)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	500,000.00	602,245.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	325,630.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	707,915.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,450,000.00	2,070,092.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	2,014,965.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,693,406.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,019,860.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,173,542.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,449,084.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,640,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,917,748.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	586,230.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,113,376.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,222,632.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,756,882.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,005,602.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,027,190.00	
CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,020,800.00		
CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,286,546.00		
CANADIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,622,024.00		
	カナダ・ドル小計	32,900,000.00	35,256,289.50 (3,146,976,401)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,500,086.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,624,275.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,452,373.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,407,692.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,037,446.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,650,000.00	2,987,742.50	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,467,432.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	877,200.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,181,444.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,550,000.00	2,943,567.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,929,668.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,566,068.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	215,974.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,530,255.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	3,361,547.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,850,000.00	1,973,691.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,451,275.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	695,488.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	577,626.00	
	オーストラリア・ドル小計	31,250,000.00	33,780,849.50 (2,746,045,256)	
シンガ ポール・ ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,652,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	738,346.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	545,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	448,848.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,238,412.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	750,000.00	865,125.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	788,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,246,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	745,500.00	
	シンガポール・ドル小計	7,650,000.00	8,269,381.00 (688,095,193)	
イギリ ス・ボン ド	UK GILT	650,000.00	888,251.00	
	UK GILT	700,000.00	937,671.00	
	UK GILT	1,300,000.00	1,488,786.00	
	UK GILT	1,050,000.00	1,507,558.50	
	UK GILT	1,200,000.00	1,906,284.00	
	UK GILT	1,700,000.00	3,380,756.00	
	UK GILT	1,500,000.00	2,571,465.00	
	UK GILT	900,000.00	1,092,024.00	
	UK GILT	1,350,000.00	2,240,217.00	
	UK GILT	1,150,000.00	1,549,222.50	
	UK GILT	900,000.00	1,626,930.00	
	UK GILT	1,250,000.00	1,908,612.50	
	UK GILT	1,100,000.00	1,568,754.00	
	UK GILT	1,700,000.00	3,479,645.00	
	UK GILT	1,300,000.00	2,023,593.00	
	UK GILT	1,200,000.00	2,098,776.00	
	UK GILT	1,600,000.00	2,307,808.00	
UK GILT	2,700,000.00	2,786,076.00		

UK GILT		1,450,000.00	3,023,192.00	
UK GILT		600,000.00	637,500.00	
UK GILT		1,650,000.00	2,495,575.50	
UK GILT		1,100,000.00	1,160,412.00	
UK GILT		1,600,000.00	2,632,560.00	
UK GILT		1,300,000.00	1,356,290.00	
UK GILT		1,700,000.00	1,894,140.00	
UK GILT		900,000.00	994,311.00	
UK GILT		1,200,000.00	1,243,860.00	
UK GILT		2,650,000.00	2,665,714.50	
UK GILT		900,000.00	959,715.00	
UK GILT		800,000.00	810,984.00	
UK GILT		850,000.00	1,008,338.00	
UK GILT		500,000.00	599,030.00	
UK GILT		1,000,000.00	1,012,150.00	
UK GILT		800,000.00	804,528.00	
UK GILT		1,800,000.00	1,737,162.00	
UK GILT		500,000.00	498,820.00	
UK GILT		1,500,000.00	1,474,380.00	
UK GILT		600,000.00	569,670.00	
UK GILT		1,600,000.00	1,511,280.00	
イギリス・ポンド小計		48,250,000.00	64,452,041.50 (9,768,351,410)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	4,100,000.00	5,401,750.00	
	ISRAEL FIXED BOND	2,900,000.00	2,978,532.00	
	ISRAEL FIXED BOND	3,300,000.00	4,233,603.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,655,085.00	
	ISRAEL FIXED BOND	6,600,000.00	6,605,940.00	
イスラエル・シュケル小計		18,400,000.00	20,874,910.00 (751,730,559)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	9,800,000.00	17,724,868.00	
	KINGDOM OF DENMARK	6,000,000.00	6,256,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	6,000,000.00	6,540,960.00	
	KINGDOM OF DENMARK	10,100,000.00	10,614,090.00	
	KINGDOM OF DENMARK	4,000,000.00	4,227,280.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,300,000.00	1,306,942.00	
デンマーク・クローネ小計		37,200,000.00	46,670,460.00 (805,998,844)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,052,560.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	4,155,640.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,034,680.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,506,335.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,000,000.00	9,258,300.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	4,253,130.00	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,967,360.00	
	ノルウェー・クローネ小計	29,700,000.00	30,228,005.00 (381,175,143)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	4,600,000.00	6,923,230.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,000,000.00	7,245,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	5,000,000.00	5,458,650.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	5,900,000.00	6,193,938.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,172,680.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,289,620.00	
	スウェーデン・クローナ小計	32,500,000.00	36,283,118.00 (454,627,469)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DE DESARROLLO	25,000,000.00	25,059,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,000,000.00	24,234,640.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	41,375,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	1,006,190.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,000,000.00	18,029,340.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,114,550.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,909,300.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	34,000,000.00	34,714,340.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	32,000,000.00	34,319,680.00	
	メキシコ・ペソ小計	193,000,000.00	197,762,740.00 (1,038,827,897)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,003,330.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,992,360.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,008,300.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,009,780.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,109,140.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,027,220.00	
	オフショア・人民元小計	19,000,000.00	19,150,130.00 (341,448,733)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	5,300,000.00	5,502,831.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	6,400,000.00	6,737,536.00	
	MALAYSIA GOVT	2,500,000.00	2,547,975.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,793,016.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,321,800.00	
	マレーシア・リングgit小計	26,900,000.00	27,903,158.00 (749,247,228)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	7,154,934.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,841,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	4,901,666.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,461,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	2,594,340.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,539,972.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	2,308,440.00	

	ポーランド・ズロチ小計	28,500,000.00	28,801,952.00 (791,062,893)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,100,000.00	1,519,936.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,629,780.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	2,024,076.00	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	857,703.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	707,660.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,362,101.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,367,592.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	1,351,568.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	270,210.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	841,216.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,430,559.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,239,220.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,400,000.00	1,499,232.00	
	BELGIUM KINGDOM	850,000.00	1,029,239.50	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	730,520.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,069,820.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,035,630.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	716,805.00	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	464,204.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,075,930.00	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	453,900.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,413,100.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	621,975.00	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	714,063.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	293,181.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	526,728.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,200,000.00	3,145,758.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	519,305.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,336,115.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,650,000.00	2,477,508.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,548,845.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,356,430.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,525,370.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	2,137,086.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	645,685.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,250,000.00	2,408,827.50		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,031,810.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,847,190.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,549,660.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,303,637.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	1,820,071.00		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,400,000.00	2,640,336.00		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	1,949,254.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	2,860,104.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,196,120.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,947,568.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	2,040,818.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	2,908,764.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,309,872.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	602,090.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,600,000.00	2,837,874.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	505,590.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,200,000.00	2,399,672.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,250,000.00	1,695,875.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,750,064.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,900,000.00	3,190,928.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	3,102,948.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	714,091.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,023,300.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	420,328.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	283,176.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,014,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,255,420.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	365,632.00	
BUNDES OBLIGATION	1,900,000.00	1,921,736.00	
BUNDES OBLIGATION	1,600,000.00	1,625,072.00	
BUNDES OBLIGATION	1,300,000.00	1,324,622.00	
BUNDES OBLIGATION	1,100,000.00	1,124,596.00	
BUNDES OBLIGATION	3,500,000.00	3,588,095.00	
BUNDES OBLIGATION	1,800,000.00	1,850,562.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	1,380,768.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,410,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,391,620.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	2,178,608.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	781,440.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	1,401,669.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	994,266.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,800,000.00	2,983,050.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	950,000.00	1,717,039.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,650,000.00	3,211,114.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	1,205,274.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	3,545,498.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	2,159,871.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,098,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,344,889.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,600,000.00	3,805,488.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	2,325,862.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000.00	4,138,975.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000.00	2,602,150.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,363,375.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,050,000.00	2,182,717.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000.00	3,258,193.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	2,406,168.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	3,616,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,650,000.00	2,226,922.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	2,241,666.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	948,492.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,957,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000.00	3,630,795.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	3,718,093.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,348,698.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	2,151,576.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	6,017,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	354,207.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	538,952.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	2,309,025.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,563,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,464,542.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,353,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	3,231,272.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	2,550,272.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,070,000.00	3,000,775.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	3,543,254.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	2,785,266.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,719,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,166,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	2,670,156.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	2,139,444.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,110,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,108,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	2,541,792.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,549,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000.00	5,392,948.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	647,568.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,956,585.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	2,846,556.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,402,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,279,152.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,550,000.00	1,851,366.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,037,100.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	563,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	841,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,039,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	689,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,260,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,539,568.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,155,130.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,896,818.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,644,195.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,884,816.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,597,557.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,900,000.00	4,277,169.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,035,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,052,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,502,579.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,306,367.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	1,067,668.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,592,008.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,531,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,090,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,127,421.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	2,739,096.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,751,748.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,822,698.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	204,506.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,024,632.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,067,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	826,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,017,330.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,458,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,501,740.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	702,876.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	484,036.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,483,170.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,032,090.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,066,530.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	540,960.00	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	379,992.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	422,544.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	847,248.00	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	299,433.00	
FRANCE O.A.T.	3,000,000.00	3,784,050.00	
FRANCE O.A.T.	2,750,000.00	3,937,862.50	
FRANCE O.A.T.	400,000.00	649,860.00	

FRANCE OAT.	600,000.00	678,168.00	
FRANCE OAT.	2,200,000.00	3,527,370.00	
FRANCE OAT.	1,370,000.00	2,682,446.30	
FRANCE OAT.	2,000,000.00	3,208,600.00	
FRANCE OAT.	4,000,000.00	4,385,280.00	
FRANCE OAT.	2,300,000.00	4,033,211.00	
FRANCE OAT.	1,400,000.00	2,882,096.00	
FRANCE OAT.	2,500,000.00	2,947,450.00	
FRANCE OAT.	3,850,000.00	4,578,805.00	
FRANCE OAT.	1,700,000.00	2,707,097.00	
FRANCE OAT.	4,200,000.00	4,357,290.00	
FRANCE OAT.	3,400,000.00	3,651,940.00	
FRANCE OAT.	2,600,000.00	2,789,280.00	
FRANCE OAT.	3,500,000.00	4,295,865.00	
FRANCE OAT.	2,900,000.00	3,012,810.00	
FRANCE OAT.	2,050,000.00	2,178,904.00	
FRANCE OAT.	2,550,000.00	2,922,147.00	
FRANCE OAT.	3,500,000.00	3,659,775.00	
FRANCE OAT.	3,400,000.00	3,852,676.00	
FRANCE OAT.	800,000.00	1,060,528.00	
FRANCE OAT.	2,400,000.00	2,487,000.00	
FRANCE OAT.	1,800,000.00	2,228,904.00	
FRANCE OAT.	2,500,000.00	2,697,250.00	
FRANCE OAT.	2,200,000.00	2,925,714.00	
FRANCE OAT.	2,000,000.00	2,020,480.00	
FRANCE OAT.	3,300,000.00	3,531,924.00	
FRANCE OAT.	2,200,000.00	2,480,918.00	
FRANCE OAT.	2,000,000.00	2,144,560.00	
FRANCE OAT.	4,800,000.00	4,879,104.00	
FRANCE OAT.	2,400,000.00	2,893,752.00	
FRANCE OAT.	2,800,000.00	2,951,928.00	
FRANCE OAT.	1,900,000.00	1,939,349.00	
FRANCE OAT.	4,500,000.00	4,557,555.00	
FRANCE OAT.	3,300,000.00	3,299,043.00	
FRANCE OAT.	3,100,000.00	3,169,440.00	
FRANCE OAT.	3,900,000.00	3,923,907.00	
FRANCE OAT.	1,900,000.00	1,929,944.00	
FRANCE OAT.	900,000.00	747,684.00	
IRISH GOVT TREASURY	800,000.00	958,936.00	
IRISH GOVT TREASURY	500,000.00	529,875.00	
IRISH GOVT TREASURY	500,000.00	547,425.00	
IRISH GOVT TREASURY	600,000.00	724,158.00	
IRISH GOVT TREASURY	1,000,000.00	1,300,820.00	
IRISH GOVT TREASURY	1,000,000.00	1,066,490.00	

IRISH GOVT TREASURY	300,000.00	356,700.00	
IRISH GOVT TREASURY	700,000.00	749,504.00	
IRISH GOVT TREASURY	1,000,000.00	1,117,920.00	
IRISH GOVT TREASURY	500,000.00	559,970.00	
IRISH GOVT TREASURY	1,600,000.00	1,739,808.00	
IRISH GOVT TREASURY	500,000.00	588,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	960,239.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,800,000.00	2,900,880.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	526,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,300,000.00	2,273,271.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	775,614.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,600,000.00	1,667,840.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,073,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	2,341,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,700,000.00	1,756,355.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,700,000.00	1,787,941.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	428,792.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,016,140.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,619,055.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	522,385.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,700,000.00	1,851,487.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,942,484.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,387,120.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	801,635.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	618,410.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	624,018.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	1,497,643.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	600,000.00	970,920.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,048,330.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	1,158,840.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	855,352.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,071,470.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	956,538.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,008,448.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,113,783.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	841,920.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	748,867.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	550,000.00	580,063.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	910,710.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,175,262.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	271,154.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	140,982.00	
ユーロ小計	410,640,000.00	483,633,452.30	(62,103,371,610)

国債証券合計		158,467,947,570 (158,467,947,570)	
合計		158,467,947,570 (158,467,947,570)	

(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
アメリカ・ドル	国債証券	183銘柄	46.4%	47.1%
カナダ・ドル	国債証券	20銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	19銘柄	1.7%	1.7%
シンガポール・ドル	国債証券	9銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	国債証券	39銘柄	6.1%	6.2%
イスラエル・シケル	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.6%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
マレーシア・リンギット	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	260銘柄	38.6%	39.2%

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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	4,726,735
コール・ローン	139,406,953
投資証券	8,552,350,950
未収配当金	47,699,981
前払金	2,534,000
差入委託証拠金	1,930,000
流動資産合計	8,748,648,619

資産合計

8,748,648,619

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	2,918,400
未払金	69,676,777
未払解約金	9,270,489
その他未払費用	1,079
流動負債合計	81,866,745
負債合計	81,866,745
純資産の部	
元本等	
元本	3,284,744,165
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,382,037,709
元本等合計	8,666,781,874
純資産合計	8,666,781,874
負債純資産合計	8,748,648,619

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,284,744,165口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6385円 (1万口当たりの純資産額26,385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 2021年8月23日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価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	(2021年11月30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)

(2021年11月30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				
	TREIT 先物 0312 月	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
	小計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
	合 計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	2,771,760,223円
同期中における追加設定元本額	791,184,769円
同期中における一部解約元本額	278,200,827円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,899,827円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	246,919,552円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,217,084円
イオン・バランス戦略ファンド	19,849,872円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,775,302,683円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	12,694,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,810,703円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,714,617円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	116,382,487円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	62,651,196円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,724,686円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,933,583円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,714,624円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	49,584,329円
日興FWS・Jリートインデックス	96,669,288円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	812,567円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,569,920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>	23,646,493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>	59,278,592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>	79,044,868円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	85,607,210円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	184,715,695円
合計	3,284,744,165円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	154	20,928,600	
	サンケイリアルエステート	245	30,404,500	
	SOSILA物流リート投	326	52,160,000	
	SOSILA物流リート新	15	2,400,000	
	東海道リート投資法	56	5,919,200	
	日本アコモデーションF	269	166,780,000	
	森ヒルズリート	919	138,217,600	
	産業ファンド	1,107	224,499,600	
	アドバンス・レジデンス	780	271,830,000	
	ケネディクスレジデンシャル	534	110,057,400	
	API投資法人	416	179,712,000	
	GLP投資法人	2,525	455,257,500	
	コンフォリア・レジデンシャル	352	112,288,000	
	日本プロロジスリート	1,235	456,332,500	
	星野リゾート・リート	130	82,810,000	
	ONEリート投資法人	134	39,422,800	
	イオンリート投資	919	139,688,000	
	ヒューリックリート投資法	728	121,357,600	

日本リート投資法人	240	101,160,000	
積水ハウス・リート投資	2,370	195,525,000	
トーセイ・リート投資法人	161	20,366,500	
ケネディクス商業リート	312	87,391,200	
ヘルスケア&メディカル投資	165	25,492,500	
サムティ・レジデンシャル	166	19,720,800	
野村不動産マスターF	2,521	406,889,400	
いちごホテルリート投資	125	10,237,500	
ラサールロジポート投資	956	178,963,200	
スターアジア不動産投	809	49,753,500	
マリモ地方創生リート	71	9,549,500	
三井不ロジパーク	290	169,070,000	
大江戸温泉リート	122	9,150,000	
投資法人みらい	889	47,294,800	
森トラスト・ホテルリート投	182	23,059,400	
三菱地所物流REIT	198	93,654,000	
CREロジスティクスファンド	303	66,357,000	
ザイマックス・リート	111	12,321,000	
タカラレーベン不動産投	309	34,391,700	
伊藤忠アドバンスロジ	306	52,570,800	
日本ビルファンド	884	618,800,000	
ジャパンリアルエステイト	780	510,900,000	
日本都市ファンド	3,935	384,843,000	
オリックス不動産投資	1,554	280,497,000	
日本プライムリアルティ	512	207,104,000	
NTT都市開発リート投	748	112,349,600	
東急リアル・エステート	524	97,673,600	
グローバル・ワン不動産	543	64,725,600	
ユナイテッドアーバン投資	1,757	254,062,200	
森トラスト総合リート	560	79,296,000	
インヴィンシブル投資法	3,439	130,853,950	
フロンティア不動産投資	273	135,681,000	
平和不動産リート	506	76,254,200	
日本ロジスティクス F	509	159,826,000	
福岡リート	404	65,932,800	
ケネディクス・オフィス投資	241	166,049,000	
いちごオフィスリート投	639	54,698,400	
大和証券オフィス投資	164	117,096,000	
阪急阪神リート	354	56,002,800	
スターツプロシード投資	120	27,048,000	
大和ハウスリート	1,171	378,818,500	
ジャパン・ホテル・リート	2,393	140,229,800	
大和証券リビング投	1,044	114,213,600	
ジャパンエクセレント投資	726	96,412,800	
投資証券 小計		8,552,350,950	

合 計	8,552,350,950
-----	---------------

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年11月30日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	99,344,009
金銭信託	2,954,229
コール・ローン	87,129,944
投資証券	17,620,715,349
派生商品評価勘定	13,752
未収入金	865,289
未収配当金	22,724,956
流動資産合計	17,833,747,528
資産合計	17,833,747,528
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,782
その他未払費用	482
流動負債合計	4,264
負債合計	4,264
純資産の部	
元本等	
元本	6,336,539,299
剰余金	
剰余金又は欠損金()	11,497,203,965
元本等合計	17,833,743,264
純資産合計	17,833,743,264
負債純資産合計	17,833,747,528

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月23日 至 2021年11月30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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,336,539,299口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8144円 (1万口当たりの純資産額28,144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 2021年8月23日 至 2021年11月30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、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>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価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	(2021年11月30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)

(2021年11月30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				
	アメリカ・ドル	69,000,000	-	69,002,662	2,662
	カナダ・ドル	1,500,000	-	1,499,857	143
	オーストラリア・ドル	4,800,000	-	4,806,426	6,426
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,304,664	4,664
	イギリス・ポンド	4,300,000	-	4,296,374	3,626
	ユーロ	3,200,000	-	3,199,987	13
	小計	85,100,000	-	85,109,970	9,970
合計	85,100,000	-	85,109,970	9,970	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・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おります。

- ・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おります。

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 2021年8月23日 至 2021年11月30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)

(2021年11月30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	5,762,256,649円
同期中における追加設定元本額	741,440,225円
同期中における一部解約元本額	167,157,575円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,396,868円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,960,970円
イオン・バランス戦略ファンド	50,669,415円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,353,435,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,309,173円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	47,287,876円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	34,006,806円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	110,231,658円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,478,823円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,479,633円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,151,937円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	593,880円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	105,121,312円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	29,066,138円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	88,855,201円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	819,793円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	49,064,588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>	27,536,734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>	36,234,944円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	176,815,693円
合 計	6,336,539,299円

(3) 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	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	8,247.00	176,155.92	
		AGREE REALTY CORP	7,050.00	489,763.50	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758.00	150,906.14	
		ALEXANDER'S INC	300.00	77,844.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,440.00	2,758,694.40	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	38,970.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,414.00	190,681.08	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,952.00	679,980.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,155.00	82,153.95	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	25,996.00	1,056,737.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	25,713.00	833,101.20	
		APARTMENT INCOME REIT CO	14,784.00	766,846.08	
		APARTMENT INVT & MGMT CO - A	15,893.00	121,104.66	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	21,470.00	330,423.30	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,848.00	69,229.44	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	28,117.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,382.00	3,222,117.96	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,485.00	67,544.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,850.00	1,528,209.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	38,892.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	15,153.00	202,444.08	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28,428.00	664,930.92	
		BROADSTONE NET LEASE INC	16,254.00	413,176.68	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,430.00			
CAMDEN PROPERTY TRUST	9,640.00	1,627,714.00			
CARETRUST REIT INC	10,887.00	219,699.66			
CEDAR REALTY TRUST INC	2,376.00	52,438.32			

CENTERSPACE	1,542.00	158,980.20	
CHATHAM LODGING TRUST	4,019.00	49,514.08	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,658.00	18,818.64	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	77,744.67	
CLIPPER REALTY INC	800.00	7,168.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	10,778.00	206,183.14	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,838.00	79,971.38	
COREPOINT LODGING INC	3,610.00	55,846.70	
CORESITE REALTY CORP	4,277.00	732,949.49	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,896.00	305,370.32	
COUSINS PROPERTIES INC	14,256.00	549,711.36	
CTO REALTY GROWTH INC	310.00	17,270.10	
CUBESMART	20,638.00	1,134,058.10	
CYRUSONE INC	11,673.00	1,043,332.74	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	18,176.00	166,673.92	
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,474.00	4,637,336.46	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	51,126.00	422,300.76	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	67,591.72	
DOUGLAS EMMETT INC	16,389.00	549,031.50	
DUKE REALTY CORP	36,138.00	2,148,404.10	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	7,057.00	147,844.15	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,025.00	823,917.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST- A	12,815.00	121,486.20	
EPR PROPERTIES	6,966.00	330,049.08	
EQUINIX INC	8,642.00	7,086,440.00	
EQUITY COMMONWEALTH	12,245.00	313,104.65	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,873.00	1,431,167.86	
EQUITY RESIDENTIAL	32,661.00	2,816,031.42	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	10,453.00	286,098.61	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,234.00	2,160,081.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,843.00	2,607,771.15	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	55,012.14	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,763.00	852,070.37	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12,887.00	786,751.35	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,728.00	183,001.60	

FRANKLIN STREET PROPERTIES C	6,015.00	35,668.95	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,335.00	976,716.30	
GEO GROUP INC/THE	9,546.00	81,331.92	
GETTY REALTY CORP	3,220.00	99,433.60	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,102.00	68,244.00	
GLADSTONE LAND CORP	2,574.00	73,848.06	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	93,084.98	
GLOBAL NET LEASE INC	8,273.00	119,462.12	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,913.00	470,803.41	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	20,884.00	710,473.68	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51,620.00	1,758,177.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876.00	26,344.16	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,521.00	418,447.95	
HOST HOTELS & RESORTS INC	68,434.00	1,123,686.28	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,769.00	364,794.30	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	10,979.00	274,255.42	
INDUS REALTY TRUST INC	104.00	7,749.04	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	139,721.98	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,304.00	611,827.20	
INVITATION HOMES INC	55,256.00	2,280,415.12	
IRON MOUNTAIN INC	28,370.00	1,329,418.20	
JBG SMITH PROPERTIES	10,436.00	299,095.76	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	54,000.00	42,660.00	
KILROY REALTY CORP	10,179.00	662,143.95	
KIMCO REALTY CORP	60,030.00	1,397,498.40	
KITE REALTY GROUP TRUST	21,946.00	446,162.18	
LEXINGTON REALTY TRUST	25,258.00	380,132.90	
LIFE STORAGE INC	7,562.00	1,011,417.50	
LTC PROPERTIES INC	3,325.00	106,100.75	
MACERICH CO/THE	21,231.00	420,586.11	
MACK-CALI REALTY CORP	7,798.00	133,267.82	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	172,000.00	122,120.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	56,657.00	1,217,558.93	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,272.00	2,367,120.00	

MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	9,490.00	197,107.30	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16,708.00	758,877.36	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,169.00	506,232.93	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,815.00	251,776.35	
NETSTREIT CORP	4,793.00	104,918.77	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,355.00	181,358.55	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	3,872.00	93,199.04	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	22,638.00	628,430.88	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	78,109.92	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	96,701.40	
PARAMOUNT GROUP INC	14,599.00	120,879.72	
PARK HOTELS & RESORTS INC	23,530.00	422,834.10	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	13,005.00	279,737.55	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,400.00	6,588.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	19,886.00	360,135.46	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	11,314.00	201,502.34	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,586.00	78,821.28	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	25,076.64	
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	6,243.00	84,717.51	
PRIME US REIT	54,200.00	44,715.00	
PROLOGIS INC	71,376.00	10,940,513.28	
PS BUSINESS PARKS INC/MD	2,033.00	355,937.64	
PUBLIC STORAGE	14,681.00	4,872,477.09	
REALTY INCOME CORP	53,234.00	3,715,733.20	
REGENCY CENTERS CORP	15,072.00	1,066,494.72	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	12,609.00	224,188.02	
RETAIL VALUE INC	2,032.00	12,232.64	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	13,738.00	975,398.00	
RLJ LODGING TRUST	14,708.00	189,880.28	
RPT REALTY	6,346.00	83,196.06	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,378.00	436,801.16	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	20,302.00	264,535.06	
SAFEHOLD INC	1,242.00	87,995.70	
SAUL CENTERS INC	894.00	44,977.14	

	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468.00	50,910.24	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	15,023.00	134,305.62	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,898.00	5,101,766.12	
	SITE CENTERS CORP	18,028.00	281,597.36	
	SL GREEN REALTY CORP	6,241.00	439,678.45	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	12,066.00	552,622.80	
	STAG INDUSTRIAL INC	15,122.00	657,050.90	
	STORE CAPITAL CORP	23,112.00	779,798.88	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,721.00	88,947.15	
	SUN COMMUNITIES INC	11,109.00	2,185,695.75	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	20,906.00	236,237.80	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9,118.00	184,730.68	
	TERRENO REALTY CORP	6,811.00	519,883.63	
	UDR INC	26,971.00	1,550,023.37	
	UMH PROPERTIES INC	3,698.00	85,756.62	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	75,277.44	
	URBAN EDGE PROPERTIES	11,117.00	193,769.31	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	55,730.08	
	VENTAS INC	38,290.00	1,880,804.80	
	VICI PROPERTIES INC	60,235.00	1,694,410.55	
	VORNADO REALTY TRUST	16,062.00	667,857.96	
	WASHINGTON REIT	7,968.00	204,060.48	
	WELLTOWER INC	40,869.00	3,352,892.76	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	42,719.17	
	WP CAREY INC	17,737.00	1,396,788.75	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	11,870.00	190,276.10	
	アメリカ・ドル小計	2,449,175.00	118,394,570.98 (13,469,750,339)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,239.00	268,526.56	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,337.00	61,588.98	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715.00	23,152.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,000.00	110,260.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,233.00	481,301.18	
	CHOICE PROPERTIES REIT	14,769.00	215,036.64	

	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	7,925.00	91,771.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,710.00	65,407.30	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	78,777.81	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	10,154.00	170,282.58	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169.00	48,802.50	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	50,058.80	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,775.00	198,475.50	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,176.00	320,744.24	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,949.00	210,421.25	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	13,162.63	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178.00	105,273.12	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,163.00	118,542.48	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	32,079.99	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	27,901.44	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	2,002.00	24,484.46	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	11,364.00	155,118.60	
	PLAZA RETAIL REIT	8,509.00	39,396.67	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,551.00	321,868.12	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	42,634.64	
	SLATE OFFICE REIT	3,663.00	18,205.11	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,374.00	197,594.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,415.00	218,333.85	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	34,725.60	
	カナダ・ドル小計	184,655.00	3,743,928.05 (334,183,018)	
オースト	ABACUS PROPERTY GROUP	32,980.00	117,738.60	

ラリア・ ドル	ARENA REIT	28,622.00	126,795.46	
	AVENTUS GROUP	35,000.00	116,550.00	
	BWP TRUST	45,015.00	185,461.80	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	64,710.00	204,483.60	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	53,468.00	196,762.24	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	96,700.98	
	CHARTER HALL GROUP	45,229.00	857,994.13	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	63,362.00	305,404.84	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	42,995.00	177,139.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	140,053.95	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	135,703.89	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	99,177.36	
	DEXUS/AU	104,645.00	1,135,398.25	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	47,308.38	
	GOODMAN GROUP	162,179.00	3,981,494.45	
	GPT GROUP	181,648.00	942,753.12	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	124,191.12	
	HOME CONSORTIUM	16,399.00	124,140.43	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	40,492.00	57,093.72	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,921.00	54,131.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	245,784.75	
	IRONGATE GROUP	42,404.00	66,786.30	
	MIRVAC GROUP	377,034.00	1,093,398.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	109,680.00	269,812.80	
	RURAL FUNDS GROUP	25,701.00	76,074.96	
	SCENTRE GROUP	510,096.00	1,550,691.84	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	92,804.00	259,851.20		
STOCKLAND	233,425.00	1,015,398.75		
VICINITY CENTRES	354,212.00	600,389.34		
WAYPOINT REIT	76,045.00	199,998.35		
	オーストラリア・ドル小計	3,138,143.00	14,604,664.01 (1,187,213,137)	
香港・ド ル	CHAMPION REIT	177,000.00	725,700.00	
	FORTUNE REIT	130,000.00	1,047,800.00	
	LINK REIT	198,400.00	13,630,080.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	551,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	499,400.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	176,000.00	591,360.00	

	香港・ドル小計	969,400.00	17,046,140.00 (248,703,183)	
シンガ ポール・ ドル	AIMS APAC REIT	38,300.00	53,620.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	117,300.00	104,983.50	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	313,000.00	935,870.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	205,555.00	205,555.00	
	CAPITALAND CHINA TRUST	83,000.00	98,770.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	469,008.00	1,003,677.12	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	87,250.00	98,592.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	43,296.00	
	ESR-REIT	217,952.00	104,616.96	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600.00	58,266.00	
	FIRST REAL ESTATE INV TRUST	176,400.00	52,038.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	103,400.00	238,854.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	276,038.00	408,536.24	
	IREIT GLOBAL	57,600.00	36,576.00	
	KEPPEL DC REIT	109,500.00	259,515.00	
	KEPPEL REIT	202,900.00	225,219.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	57,600.00	50,112.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	222,800.00	465,652.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	193,500.00	518,580.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	263,150.00	502,616.50	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	235,000.00	237,350.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	243,200.00	108,224.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,600.00	198,000.00	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	59,363.00		
SPH REIT	74,600.00	75,346.00		
STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	89,139.00		
SUNTEC REIT	234,800.00	354,548.00		
	シンガポール・ドル小計	4,378,753.00	6,586,915.82 (548,097,264)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	83,275.00	117,834.12	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	104,844.00	254,246.70	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	147,107.00	167,701.98	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	110,983.00	170,913.82	

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	36,063.00	102,959.86	
	ニュージーランド・ドル小計	482,272.00	813,656.48 (63,082,787)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	9,000.00	10,116.00	
	ASSURA PLC	287,670.00	196,478.61	
	BIG YELLOW GROUP PLC	17,172.00	278,186.40	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	63,210.00	64,853.46	
	BRITISH LAND CO PLC	90,638.00	472,586.53	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	95,185.00	158,387.84	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238.00	48,058.96	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	38,799.03	
	DERWENT LONDON PLC	10,887.00	372,879.75	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037.00	48,690.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	43,019.00	90,554.99	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	23,477.00	169,269.17	
	HAMMERSON PLC	380,846.00	117,681.41	
	HOME REIT PLC	17,550.00	20,621.25	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	49,677.40	
	INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	70,660.00	530,656.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	81,335.00	221,231.20	
	LXI REIT PLC	62,738.00	93,730.57	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	40,682.56	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	56,798.15	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	117,823.00	176,852.32	
	PRS REIT PLC/THE	41,845.00	43,100.35	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	41,051.93	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	21,672.00	290,404.80	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	37,045.75	
SEGRO PLC	114,661.00	1,625,319.67		
SHAFTESBURY PLC	27,317.00	174,828.80		
STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280.00	39,640.32		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	73,348.00	89,117.82		
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	32,996.73		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	168,082.00	402,388.30		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	58,562.00	44,799.93		
UNITE GROUP PLC/THE	40,691.00	441,497.35		

	WORKSPACE GROUP PLC	13,356.00	108,984.96	
	イギリス・ポンド小計	2,460,908.00	6,628,253.91 (1,004,578,163)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	16,753.00	360,189.50	
	イスラエル・シュケル小計	16,753.00	360,189.50 (12,970,856)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	14,308.00	93,002,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	4,057.00	304,275.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	23,751,280.00	
	JR REIT XXVII	8,500.00	45,730,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	2,600.00	17,056,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522.00	70,123,200.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	5,000.00	24,425,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302.00	42,416,000.00	
	韓国・ウォン小計	56,356.00	316,807,755.00 (30,350,183)	
ユーロ	AEDIFICA	3,315.00	395,479.50	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	17,199.00	334,864.53	
	ALTAREA	384.00	61,824.00	
	BEFIMMO	2,652.00	84,201.00	
	CARE PROPERTY INVEST	2,468.00	63,180.80	
	CARMILA	4,754.00	61,041.36	
	COFINIMMO	2,661.00	371,741.70	
	COIMA RES SPA	1,979.00	14,308.17	
	COVIVIO	4,594.00	337,015.84	
	CROMWELL REIT EUR	27,720.00	70,131.60	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,947.00	70,651.30	
	GECINA SA	5,357.00	639,357.95	
	HAMBORNER REIT AG	6,833.00	64,824.67	
	HIBERNIA REIT PLC	62,332.00	81,031.60	
	ICADE	3,163.00	201,324.95	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	16,912.95	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	25,636.00	210,856.10	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,723.00	73,657.15	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	38,432.00	58,877.82		

	KLEPIERRE	17,773.00	338,664.51	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	32,930.30	
	MERCIALYS	6,257.00	52,777.79	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	32,075.00	318,504.75	
	MONTEA NV	989.00	126,592.00	
	NSI NV	1,584.00	54,093.60	
	RETAIL ESTATES	963.00	66,543.30	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,159.00	669,540.00	
	VASTNED RETAIL NV	2,091.00	47,152.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,000.00	577,080.00	
	WERELDHAVE NV	3,950.00	47,439.50	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,599.00	78,351.00	
	ユーロ小計	320,327.00	5,620,951.79 (721,786,419)	
投資証券合計			17,620,715,349 (17,620,715,349)	
合計			17,620,715,349 (17,620,715,349)	

(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
アメリカ・ドル	投資証券	157銘柄	75.5%	76.4%
カナダ・ドル	投資証券	29銘柄	1.9%	1.9%
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	6.7%	6.7%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.4%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券	27銘柄	3.1%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券	35銘柄	5.6%	5.7%
イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	31銘柄	4.0%	4.1%

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	7,862,174円
負債総額	2,426円
純資産総額(-)	7,859,748円
発行済口数	7,379,852口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0650円 (10,650円)

三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	79,459,239円
負債総額	24,542円
純資産総額(-)	79,434,697円
発行済口数	73,958,409口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0740円 (10,740円)

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	103,852,307円
負債総額	33,384円
純資産総額(-)	103,818,923円
発行済口数	93,714,260口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.1078円 (11,078円)

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	9,615,962円
負債総額	2,641円
純資産総額(-)	9,613,321円
発行済口数	9,308,924口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0327円 (10,327円)

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	16,958,567円
負債総額	2,348円
純資産総額(-)	16,956,219円
発行済口数	16,804,561口
1口当たり純資産額(/)	1.0090円

(1万口当たり純資産額)	(10,090円)
----------------	-------------

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	12,865,132円
負債総額	1,581円
純資産総額(-)	12,863,551円
発行済口数	13,086,978口
1口当たり純資産額(/)	0.9829円
(1万口当たり純資産額)	(9,829円)

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	13,259,711円
負債総額	2,015円
純資産総額(-)	13,257,696円
発行済口数	11,583,041口
1口当たり純資産額(/)	1.1446円
(1万口当たり純資産額)	(11,446円)

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】

< 更新後 >

イ 資本金の額および株式数

	2021年12月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

ハ 会社の機構

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

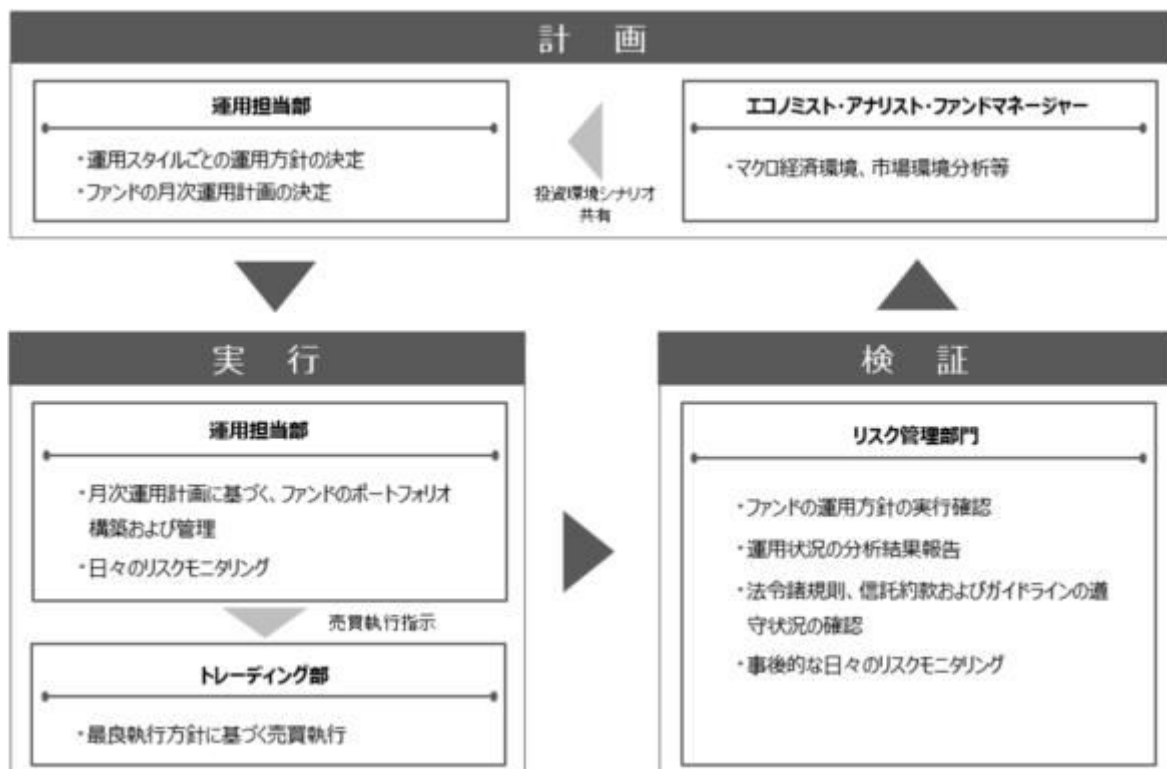
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

「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。

2021年12月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本 数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	732	9,624,127
単位型株式投資信託	102	551,334
追加型公社債投資信託	1	27,985
単位型公社債投資信託	189	415,688
合 計	1,024	10,619,135

3【委託会社等の経理状況】

< 更新後 >

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

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

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第36期（2020年4月1日から2021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37期中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		

現金及び預金	33,264,545	33,048,142
顧客分別金信託	300,021	300,036
前払費用	515,226	449,748
未収入金	602,605	132,419
未収委託者報酬	8,404,880	9,936,096
未収運用受託報酬	2,199,785	2,247,156
未収投資助言報酬	299,826	398,108
未収収益	37,702	39,975
その他の流動資産	40,119	6,981
流動資産合計	45,664,712	46,558,665
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	101,609	1,509,450
器具備品	783,224	870,855
土地	710	710
リース資産	968	13,483
建設仮勘定	66,498	-
有形固定資産合計	953,010	2,394,500
無形固定資産		
ソフトウェア	909,133	1,347,889
ソフトウェア仮勘定	508,733	1,029,033
のれん	34,397,824	3,654,491
顧客関連資産	17,785,166	15,671,890
電話加入権	12,739	12,727
商標権	54	48
無形固定資産合計	53,613,651	21,716,080
投資その他の資産		
投資有価証券	19,436,480	22,866,282
関係会社株式	11,246,398	11,246,398
長期差入保証金	2,523,637	1,409,091
長期前払費用	113,852	116,117
会員権	90,479	90,479
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	33,390,098	35,707,619
固定資産合計	87,956,760	59,818,200
資産合計	133,621,473	106,376,866

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,064	5,153
顧客からの預り金	14,285	20,077
その他の預り金	146,200	169,380
未払金		
未払収益分配金	1,629	1,646
未払償還金	131,338	43,523
未払手数料	3,776,873	4,480,697
その他未払金	502,211	270,290
未払費用	3,935,582	5,940,121
未払消費税等	305,513	235,647
未払法人税等	489,151	762,648
賞与引当金	1,716,321	1,516,622
その他の流動負債	30,951	9,710

流動負債合計	11,051,125	13,455,519
固定負債		
リース債務	-	9,678
繰延税金負債	2,963,538	2,566,958
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448
賞与引当金	14,767	-
その他の固定負債	172,918	40,950
固定負債合計	8,451,038	7,876,035
負債合計	19,502,164	21,331,554
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	81,927,000	81,927,000
資本剰余金合計	90,555,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,364,265	10,281,242
利益剰余金合計	21,185,470	8,460,037
株主資本計	113,741,454	84,095,946
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	377,855	949,365
評価・換算差額等合計	377,855	949,365
純資産合計	114,119,309	85,045,311
負債・純資産合計	133,621,473	106,376,866

(2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	54,615,133	50,610,457
運用受託報酬	9,389,058	9,450,169
投資助言報酬	1,303,595	1,270,584
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	181,061	200,807
その他	32,421	32,820
営業収益計	65,521,269	61,564,839
営業費用		
支払手数料	24,888,040	22,784,919
広告宣伝費	447,024	365,317
調査費		
調査費	3,214,679	3,061,987
委託調査費	7,702,309	7,810,157
営業雑経費		
通信費	70,007	95,163
印刷費	612,249	554,920

協会費	45,117	40,044
諸会費	32,199	29,473
情報機器関連費	4,349,174	4,562,612
販売促進費	68,688	23,614
その他	154,201	163,332
営業費用合計	41,583,691	39,491,542
一般管理費		
給料		
役員報酬	264,325	277,027
給料・手当	9,789,691	9,280,730
賞与	914,702	950,630
賞与引当金繰入額	1,726,013	1,501,855
交際費	30,898	11,815
寄付金	2,022	949
事務委託費	956,931	844,255
旅費交通費	249,359	21,023
租税公課	389,032	389,819
不動産賃借料	1,121,553	1,639,529
退職給付費用	797,158	790,144
固定資産減価償却費	3,044,658	3,040,894
のれん償却費	2,645,986	2,645,986
諸経費	482,324	608,206
一般管理費合計	22,414,658	22,002,869
営業利益	1,522,919	70,426

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	778,113	13,164
受取利息	947	2,736
時効成立分配金・償還金	1,041	88,335
原稿・講演料	2,061	2,603
投資有価証券償還益	6,398	57,388
投資有価証券売却益	24,206	162,941
雑収入	53,484	72,933
営業外収益合計	866,254	400,104
営業外費用		
為替差損	72,457	766
投資有価証券償還損	129,006	11,762
投資有価証券売却損	12,906	34,473
雑損失	8,334	1,240
営業外費用合計	222,704	48,243
経常利益	2,166,469	422,288
特別損失		
固定資産除却損	1 110,668	54,493
減損損失	2 46,417	28,097,346
合併関連費用	42,800	-
早期退職費用	3 -	216,200
本社移転費用	4 133,168	127,044

その他特別損失	-	5,460
特別損失合計	333,054	28,500,544
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失（ ）	1,833,414	28,078,256
法人税、住民税及び事業税	1,874,278	1,549,173
法人税等調整額	619,676	693,192
法人税等合計	1,254,602	855,980
当期純利益又は 当期純損失（ ）	578,811	28,934,237

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
		資本剰余金		利益剰余金
				その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当				-				711,271
当期純損失（ ）				-				28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）				-				
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	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	
当期首残高	21,185,470		113,741,454	377,855	377,855
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271		-	711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237		-	28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

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）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

(会計方針の変更)

当社は「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準第31号 2019年7月4日）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	466,875千円	102,329千円
器具備品	1,225,261千円	1,153,649千円
リース資産	1,452千円	2,830千円

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

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

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	132,559千円	93,374千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
建物	879千円	18,278千円
器具備品	119千円	28,604千円
リース資産	5,377千円	- 千円
ソフトウェア	1,596千円	7,610千円
ソフトウェア仮勘定	102,695千円	- 千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

当事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

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

当社は、当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 本社移転費用

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

当事業年度の本社移転費用は、本社移転に伴うものであり、主に設備撤去費用、引越費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(リース取引関係)

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1年以内	1,618,641	1,194,699
1年超	5,844,934	3,497,258
合計	7,463,576	4,691,958

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

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、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	45,369	39,809
合計	45,369	39,809
子会社株式		
非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含まれておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そ

のため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(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(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,994,762	6,729,039	265,723
小計	6,994,762	6,729,039	265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,978,622	162,941	34,473

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,418,601	5,299,814
勤務費用	523,396	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	195	67,476
退職給付の支払額	349,050	585,151
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	1,707,062	-
退職給付債務の期末残高	5,299,814	5,258,448

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
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	5,299,814	5,258,448

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	492,511	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	195	67,476
その他	304,842	246,359
確定給付制度に係る退職給付費用	797,158	790,144

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.020%

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248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

(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 (2020年 3月 31日)	当事業年度 (2021年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,622,803	1,610,136
賞与引当金	530,059	464,389
調査費	178,573	247,208
未払金	162,557	206,090
未払事業税	46,423	66,891
ソフトウェア償却	91,937	90,431
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	150,771	131,391
その他	88,250	35,930
繰延税金資産小計	2,986,254	2,967,346
評価性引当額(注)	193,485	218,966
繰延税金資産合計	2,792,768	2,748,380
繰延税金負債		
無形固定資産	5,445,817	4,798,732
その他有価証券評価差額金	310,488	516,605
繰延税金負債合計	5,756,306	5,315,338
繰延税金資産(負債)の純額	2,963,538	2,566,958

(注)評価性引当額が25,480千円増加しております。この増加の内容は、主としてその他有価証券評価差額金に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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

	前事業年度 (2020年 3月 31日)	当事業年度 (2021年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため 記載を省略して おります。
(調整)		
評価性引当額の増減	3.5	
受取配当等永久に益金に算入されない項目	13.9	
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021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葉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	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	(株)三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	3,369.33円	2,510.93円

1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失（ ）	17.09円	854.27円
-------------------------------	--------	---------

（注）1. 前事業年度の潜在株式調整後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いません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失（ ）（千円）	578,811	28,934,237
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又は 当期純損失（ ）（千円）	578,811	28,934,237
期中平均株式数（株）	33,870,060	33,870,060

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

第37期中間会計期間 (2021年 9月 30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	38,529,337
顧客分別金信託	300,038
前払費用	518,490
未収委託者報酬	10,909,133
未収運用受託報酬	2,723,571
未収投資助言報酬	399,072
未収収益	39,947
その他	224,189
流動資産合計	53,643,782
固定資産	
有形固定資産	1 2,218,463
無形固定資産	
のれん	3,502,221
顧客関連資産	14,615,253
その他	2,778,211
無形固定資産合計	20,895,685
投資その他の資産	
投資有価証券	22,000,657
関係会社株式	11,246,398
その他	1,595,579
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	34,821,886
固定資産合計	57,936,035
資産合計	111,579,818
負債の部	
流動負債	
リース債務	3,567
顧客からの預り金	12,736
その他の預り金	100,610

未払金		5,104,509
未払費用		7,204,066
未払法人税等		1,493,440
前受収益		32,829
賞与引当金		1,725,017
その他	2	695,069
流動負債合計		16,371,848
固定負債		
リース債務		6,309
繰延税金負債		2,389,323
退職給付引当金		5,414,560
その他		40,950
固定負債合計		7,851,143
負債合計		24,222,992
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,761,706
利益剰余金合計		2,045,951
株主資本合計		86,141,897
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,214,928
評価・換算差額等合計		1,214,928
純資産合計		87,356,826
負債純資産合計		111,579,818

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		32,740,035
運用受託報酬		4,392,826
投資助言報酬		633,982
その他の営業収益		117,708
営業収益計		37,884,552
営業費用		25,219,811
一般管理費	1	9,605,282
営業利益		3,059,458
営業外収益	2	198,028
営業外費用	3	26,126
経常利益		3,231,360
特別損失	4	146,753

税引前中間純利益	3,084,607
法人税、住民税及び事業税	1,373,478
法人税等調整額	334,822
法人税等合計	1,038,655
中間純利益	2,045,951

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当中間期変動額								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
中間純利益								2,045,951
任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
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	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	12,042,949
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	1,761,706

	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	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当中間期変動額					
欠損填補	8,460,037	-			-
中間純利益	2,045,951	2,045,951			2,045,951
任意積立金の取崩					
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)			265,562	265,562	265,562
当中間期変動額合計	10,505,989	2,045,951	265,562	265,562	2,311,514
当中間期末残高	2,045,951	86,141,897	1,214,928	1,214,928	87,356,826

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

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

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4．収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。）等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

5．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。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当中間会計期間の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当該会計基準等の適用が中間財務諸表に及ぼす影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,320,556千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額73,437千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	191,604千円
無形固定資産	1,304,363千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	6,622千円
受取配当金	4,755千円
投資有価証券償還益	90,952千円
投資有価証券売却益	48,142千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	15,001千円
投資有価証券売却損	8,258千円
4.特別損失のうち主要なもの	
システム統合関連費用	145,261千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

発行済株式数に関する事項

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

(リース取引関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,179,776千円
1年超	2,903,862千円
合計	4,083,639千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

2021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、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	38,529,337	38,529,337	-
(2)顧客分別金信託	300,038	300,038	-
(3)未収委託者報酬	10,909,133	10,909,133	-
(4)未収運用受託報酬	2,723,571	2,723,571	-
(5)未収投資助言報酬	399,072	399,072	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	21,960,848	21,960,848	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	1,408,170	1,408,170	-
資産計	76,230,173	76,230,173	-
(1)顧客からの預り金	12,736	12,736	-
(2)未払金			
未払手数料	4,996,181	4,996,181	-
負債計	5,008,917	5,008,917	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

その他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式	
非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって中間貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(有価証券関係)

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

1. 子会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,269,607	14,102,355	2,167,252
小計	16,269,607	14,102,355	2,167,252
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,691,240	6,001,639	310,398
小計	5,691,240	6,001,639	310,398
合計	21,960,848	20,103,994	1,856,853

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021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	32,740,035	4,392,826	633,982	117,708	37,884,552

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,579円18銭
1株当たり中間純利益	60円41銭

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

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2022年1月11日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2021年8月23日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財

務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月22日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021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（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。