

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月12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・年金バランス30(債券重点型) 三井住友D S・年金バランス50(標準型) 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・年金バランス50(標準型) 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型) 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

三井住友D S・年金バランス50（標準型）

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

（上記3ファンドの愛称として「マイパッケージNEXT」という名称を用いることがあります。）

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

また、「三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）」を「マイパッケージNEXT30」、「三井住友D S・年金バランス50（標準型）」を「マイパッケージNEXT50」、「三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）」を「マイパッケージNEXT70」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「マイパッケージNEXT30」は「マイN30」、「マイパッケージNEXT50」は「マイN50」、「マイパッケージNEXT70」は「マイN70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2022年5月13日から2022年11月15日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。

ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、当該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。

ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(合成指数)	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信 その他資産 () 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()	
中小型株	年6回(隔月)	欧州			
債券	年12回(毎月)	アジア			TOPIX
一般	日々	オセアニア			
公債	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
社債	()	アフリカ			
その他債券					
クレジット属性					
()					
不動産投信					
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(株式 債 券)資産配分固定 型))		中近東(中東)			その他 (合成指数)
資産複合					

() 資産配分固定 型 資産配分変更 型		エマージング			
-----------------------------------	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2019年6月28日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友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。

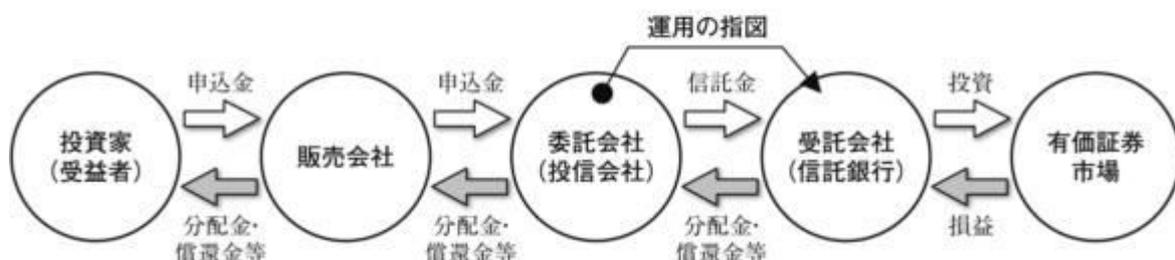
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2022年2月28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

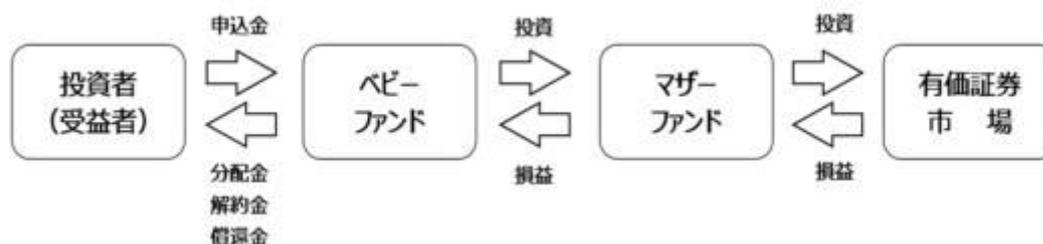
(八) 大株主の状況

(2022年2月28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	大阪府大阪府中央区城見一丁目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】

イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド

外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

ロ 投資態度

(イ) 各ファンドにつき、マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
株 式	30%	50%	70%
国内株式	20%	35%	50%
外国株式	10%	15%	20%
債 券	65%	45%	25%
国内債券	55%	35%	15%
外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

(ロ) 各ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数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。

	マイパッケージ N E X T 30	マイパッケージ N E X T 50	マイパッケージ N E X T 70
TOPIX(東証株価指数、配当込み)	20%	35%	50%
NOMURA - B P I (総合)	55%	35%	15%
M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)	10%	15%	20%
F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

(ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないことを基本とします。

(ニ) 非株式割合に関する制限

a. マイパッケージN E X T 30
制限はありません。

b. マイパッケージN E X T 50

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75%以下とします。

c. マイパッケージN E X T 70

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。

(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。

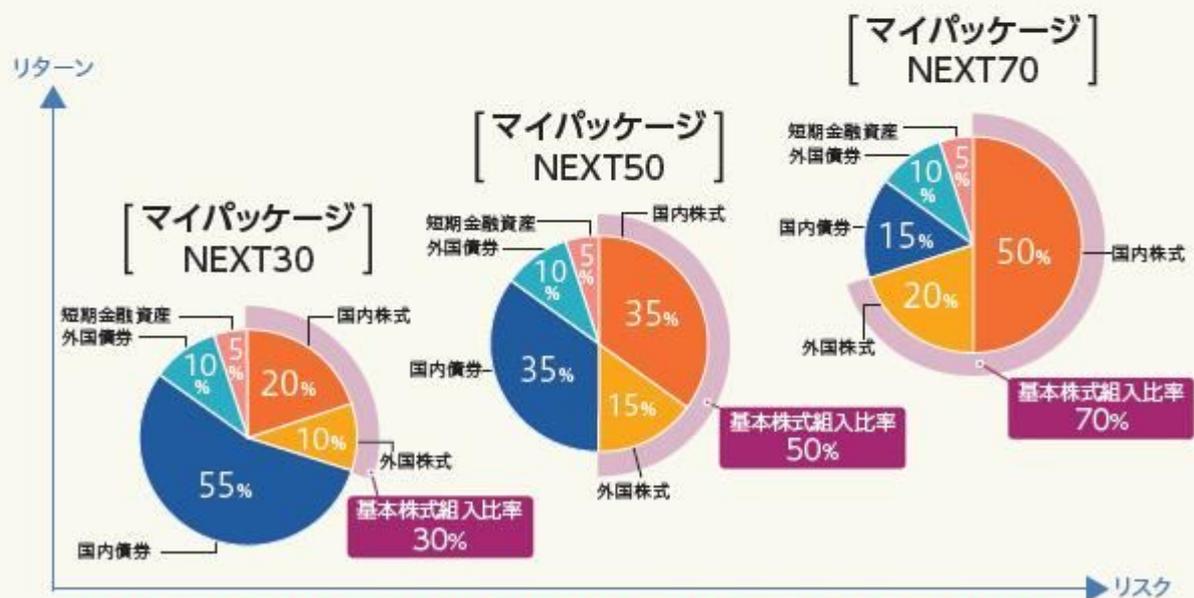
ファンドの特色

1 内外の株式、公社債に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。

2 国内株式、外国株式、国内債券および外国債券への投資割合が異なる3つのファンドからお選びいただけます。

- 各ファンドの基本資産配分は、下記の通りとします。
- 時価変動等に伴う各資産への投資比率の変化については、一定の範囲（±3%）を超えた場合、調整します。

〔基本資産配分とリスク・リターンのイメージ〕



※ 上記は、各ファンドの基本資産配分を示したものであり、実際の配分比率を示すものではありません。
また、各ファンドのリスク・リターンの関係はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

3

委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。

〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

	投資対象資産	マイパッケージ NEXT30	マイパッケージ NEXT50	マイパッケージ NEXT70
TOPIX (東証株価指数、配当込み)	国内株式	20%	35%	50%
NOMURA-BPI(総合)	国内債券	55%	35%	15%
MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	外国株式	10%	15%	20%
FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	外国債券	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	短期金融資産	5%	5%	5%

TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ株式会社JPX総研、野村證券株式会社、MSCI Inc.、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数です。

TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、それぞれ国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の代表的な指数であり、各ファンドの合成指数を構成するものです。なお、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、前日の指数を当日の対顧客電信売買相場の仲値により委託会社が円換算したものです。

※各インデックスに関する知的所有権その他一切の権利は、指数を公表する各社に帰属します。また、当該各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。

4

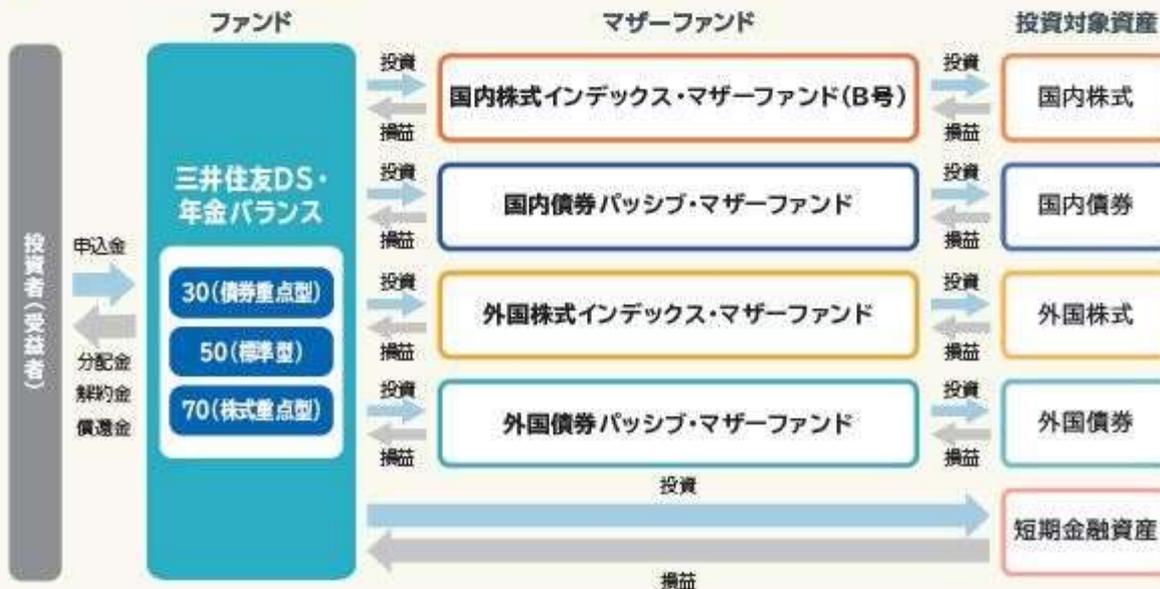
実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

■ 基準価額は為替変動の影響を受けます。

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

ファンドのしくみ

■ ファ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。



各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)

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

▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 層化抽出法により、デュレーション、満期構成、債券種別配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。

▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

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

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

デュレーションとは

「債券の投資元本の回収に要する平均残存期間」や「金利の変動に対する債券価格の変動性」を表す指標です。一般的に、この値が長い(大きい)ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

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

(2)【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券

2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定す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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券
11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 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
14. 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。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権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。次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（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。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 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。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
19. 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。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 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。）

なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2

号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

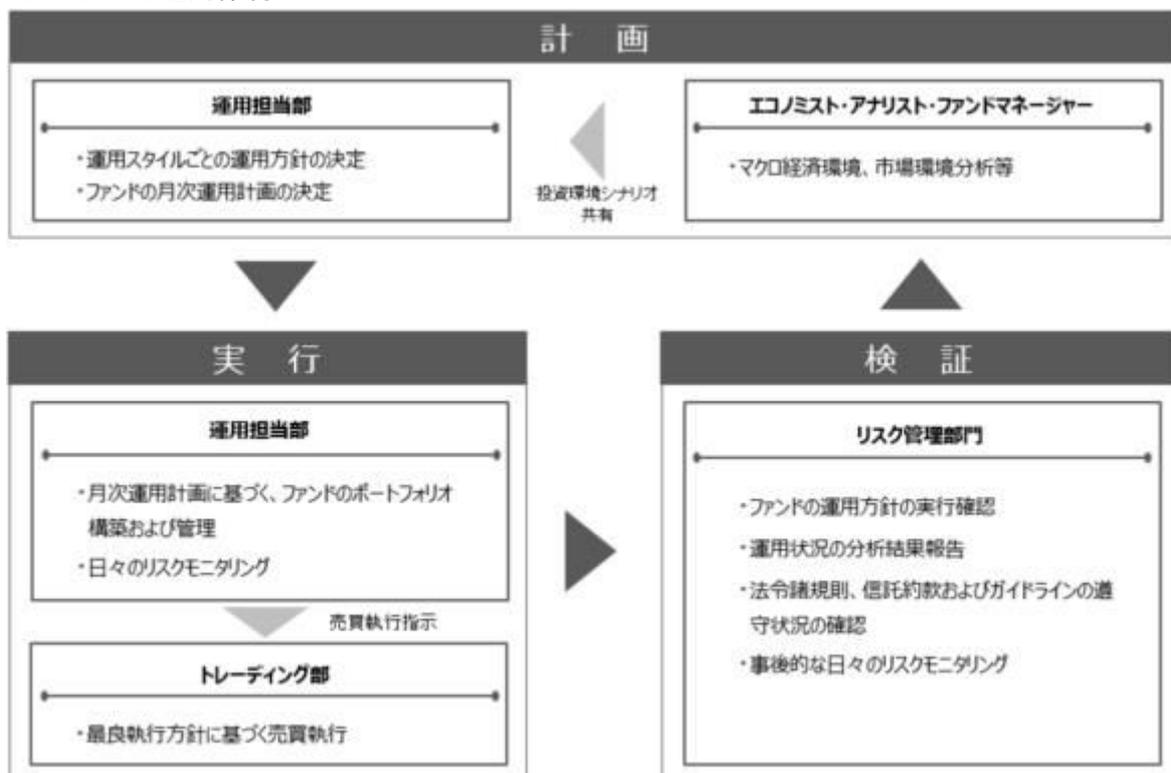
八 投資対象とする金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（4）【配分方針】

年1回(原則として毎年2月18日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。)決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

(5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- 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。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。
 - マイパッケージNEXT30 50%未満
 - マイパッケージNEXT50 25%以上
 - マイパッケージNEXT70 50%以上実質投資割合とは、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。)
- ロ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- 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。
- (二) 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цион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цион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およびオプцион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。
- (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цион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(以下本項において「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。
- (二) 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、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (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、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (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ものとしてします。
- (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) 借入れにかかる品借料は、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。
- (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当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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、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、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX

(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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券
- 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、有価証券に係るものに限りません。）
- １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １９．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- ２０．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ２１．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円で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券
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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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券
- 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せん。）
- １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １９．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- ２０．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- ２１．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資

産総額の10%以内とします。

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 信用リスク

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

(ニ) 為替変動リスク

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

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の

国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 合成指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成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、合成指数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インデックスの動きに不一致が生じること

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 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ある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。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

□ 投資リスクの管理体制

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

リスク管理担当部は、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

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。

コンプライアンス担当部は、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。

■マイパッケージNEXT30



■マイパッケージNEXT50



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

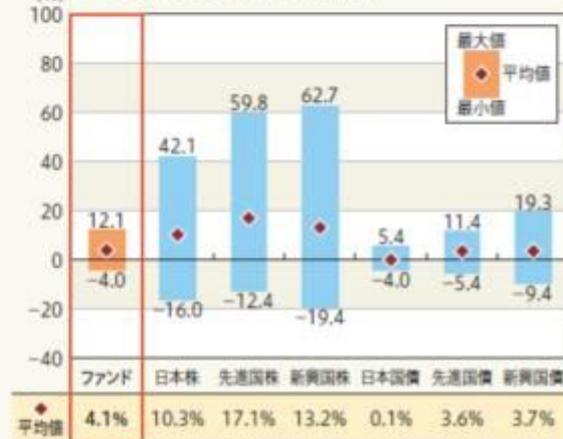
※ファンドのベンチマークは合成指数です。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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

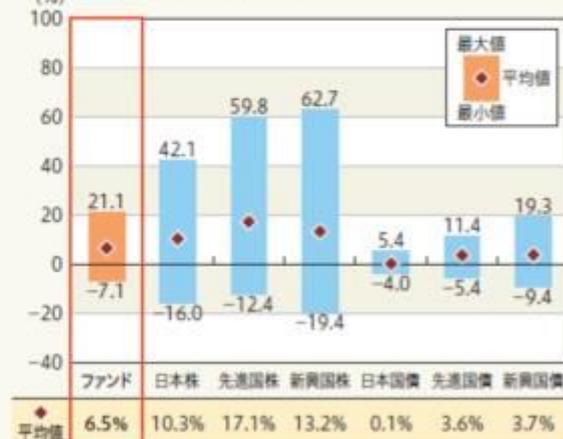
ファンド：
2017年3月～2022年2月
(2020年5月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス：
2017年3月～2022年2月



ファンド：
2017年3月～2022年2月
(2020年5月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス：
2017年3月～2022年2月



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■マイパッケージNEXT70



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドのベンチマークは合成指数です。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の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】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.154%（税抜き0.14%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き）>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.06%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.06%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を

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

- (八) 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。

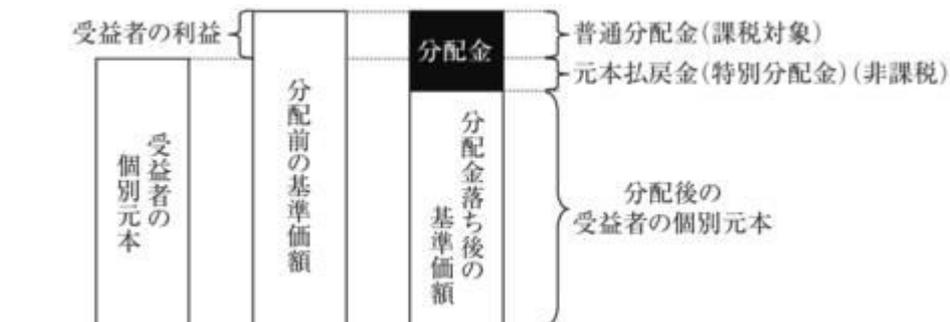
ハ 収益分配金の課税について

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。

< 配当控除および益金不算入制度の適用の可否 >

a . マイパッケージNEXT30

配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

b . マイパッケージNEXT50

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。

c . マイパッケージNEXT70

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。

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

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

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。

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。

※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	
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*1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*1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(新規の購入は2023年まで)*2	
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)

*1 2023年は成年年齢の引下げにより、NISAは18歳以上、ジュニアNISAは0~17歳になる予定です。
*2 2024年以降、NISA制度が見直しされます。また、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2022年2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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

2022年2月28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	232,617,757	94.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	12,900,774	5.25
合計（純資産総額）		245,518,531	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D S・年金バランス50（標準型）

2022年2月28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	681,219,049	95.12
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	34,949,091	4.88
合計（純資産総額）		716,168,140	100.00

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

2022年2月28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	453,785,130	95.30
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	22,374,251	4.70
合計（純資産総額）		476,159,381	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

イ 主要投資銘柄

2022年2月28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	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	106,750,115	1.2585	134,347,177	1.2637	134,900,120	54.94
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)	15,328,278	3.2196	49,351,255	3.1588	48,418,964	19.72
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	4,404,199	5.6200	24,751,523	5.6082	24,699,628	10.06
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	12,767,450	1.9314	24,658,969	1.9267	24,599,045	10.02

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

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.75
合計	94.75

三井住友DS・年金バランス50(標準型)

イ 主要投資銘柄

2022年2月28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	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	200,163,390	1.2585	251,906,609	1.2637	252,946,475	35.32
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)	79,029,221	3.2194	254,429,886	3.1588	249,637,503	34.86
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	18,997,088	5.6238	106,835,823	5.6082	106,539,468	14.88
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	37,419,216	1.9314	72,271,399	1.9267	72,095,603	10.07

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

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.12
合計	95.12

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

イ 主要投資銘柄

2022年2月28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)	75,128,463	3.2197	241,891,647	3.1588	237,315,788	49.84
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	17,016,111	5.6215	95,655,643	5.6082	95,429,753	20.04
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	57,961,015	1.2585	72,945,164	1.2637	73,245,334	15.38
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	24,806,278	1.9314	47,910,783	1.9267	47,794,255	10.04

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

2022年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	95.30
合計	95.30

【投資不動産物件】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
第2期 (2021年 2月18日)	129,349,680	129,349,680	10,869	10,869
第3期 (2022年 2月18日)	244,216,550	244,216,550	11,031	11,031
2021年 2月末日	138,580,906	-	10,723	-
3月末日	165,081,418	-	10,979	-
4月末日	178,718,047	-	10,976	-
5月末日	185,471,180	-	11,038	-
6月末日	200,638,214	-	11,092	-
7月末日	222,813,750	-	11,095	-
8月末日	234,071,577	-	11,186	-
9月末日	238,910,025	-	11,230	-
10月末日	241,494,324	-	11,297	-
11月末日	239,519,804	-	11,213	-
12月末日	247,640,226	-	11,329	-
2022年 1月末日	245,537,156	-	11,075	-
2月末日	245,518,531	-	11,009	-

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
第2期 (2021年 2月18日)	335,342,429	335,342,429	11,511	11,511
第3期 (2022年 2月18日)	718,044,759	718,044,759	11,845	11,845
2021年 2月末日	344,822,339	-	11,291	-
3月末日	422,801,118	-	11,679	-

4月末日	469,157,376	-	11,649	-
5月末日	492,513,115	-	11,747	-
6月末日	546,770,630	-	11,838	-
7月末日	608,251,652	-	11,800	-
8月末日	632,059,580	-	11,969	-
9月末日	651,115,384	-	12,087	-
10月末日	660,424,293	-	12,182	-
11月末日	676,280,521	-	12,017	-
12月末日	719,340,469	-	12,232	-
2022年 1月末日	707,831,149	-	11,846	-
2月末日	716,168,140	-	11,775	-

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期（2020年 2月18日）	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
第2期（2021年 2月18日）	212,907,677	212,907,677	12,154	12,154
第3期（2022年 2月18日）	476,770,596	476,770,596	12,669	12,669
2021年 2月末日	220,191,243	-	11,853	-
3月末日	258,385,152	-	12,386	-
4月末日	303,639,986	-	12,324	-
5月末日	323,178,621	-	12,461	-
6月末日	356,425,664	-	12,595	-
7月末日	397,527,222	-	12,509	-
8月末日	420,504,395	-	12,765	-
9月末日	437,307,659	-	12,967	-
10月末日	459,750,652	-	13,088	-
11月末日	455,023,591	-	12,830	-
12月末日	490,773,498	-	13,161	-
2022年 1月末日	477,224,845	-	12,622	-
2月末日	476,159,381	-	12,546	-

【分配の推移】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

三井住友D S・年金バランス50（標準型）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

【収益率の推移】

三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

	収益率(%)
第1期	3.7
第2期	4.9
第3期	1.5

(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・年金バランス50(標準型)

	収益率(%)
第1期	5.7
第2期	8.9
第3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・年金バランス70(株式重点型)

	収益率(%)
第1期	7.9
第2期	12.7
第3期	4.2

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

(4)【設定及び解約の実績】

三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	129,718,508	11,715,048
第3期	128,773,003	26,390,611

（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 ・年金バランス50（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,156,528	0
第2期	322,790,706	33,614,202
第3期	361,775,633	46,907,692

（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 ・年金バランス70（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	190,606,278	16,430,623
第3期	241,009,796	39,861,352

（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）

2022年2月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	195,500,069,610	98.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,446,745,931	1.24
合計（純資産総額）		197,946,815,541	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	2,439,390,000	1.23
合計	買建	-	2,439,390,000	1.23

国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年2月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	日本	104,555,965,600	80.52
地方債証券	日本	9,611,207,000	7.40
特殊債券	日本	9,473,914,748	7.30
社債券	日本	5,105,973,500	3.93
	フランス	200,834,400	0.15

	小計	5,306,807,900	4.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	900,211,250	0.69
合計(純資産総額)		129,848,106,498	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年2月28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	232,767,815,571	67.72
	イギリス	14,671,941,303	4.27
	カナダ	12,741,776,006	3.71
	スイス	11,345,536,102	3.30
	フランス	10,653,958,418	3.10
	ドイツ	8,574,475,293	2.49
	オーストラリア	6,509,865,298	1.89
	オランダ	6,306,645,851	1.83
	アイルランド	6,008,570,215	1.75
	スウェーデン	3,283,312,547	0.96
	デンマーク	2,566,609,626	0.75
	スペイン	2,392,925,904	0.70
	香港	2,141,877,630	0.62
	イタリア	1,894,307,952	0.55
	ジャージー	1,333,989,353	0.39
	フィンランド	1,218,077,338	0.35
	シンガポール	1,035,737,331	0.30
	ベルギー	841,944,376	0.24
	バミューダ	734,028,138	0.21
	イスラエル	721,521,285	0.21
	ノルウェー	713,661,333	0.21
	ケイマン諸島	651,642,107	0.19
	オランダ領キュ ラソー	334,790,618	0.10
	ルクセンブルグ	292,994,983	0.09
	ニュージーラン ド	256,692,733	0.07
	オーストリア	224,103,863	0.07
	ポルトガル	153,505,492	0.04
	パナマ	117,409,384	0.03
	リベリア	115,076,984	0.03
	マン島	73,956,848	0.02
小計	330,678,749,882	96.20	
投資証券	アメリカ	6,746,065,419	1.96
	オーストラリア	701,483,021	0.20
	イギリス	221,731,057	0.06
	フランス	163,676,288	0.05
	香港	156,725,636	0.05

	シンガポール	135,926,463	0.04
	カナダ	36,143,492	0.01
	小計	8,161,751,376	2.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,885,210,758	1.43
合計(純資産総額)		343,725,712,016	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	207,361,341	0.06
株価指数先物取引	買建	ドイツ	660,970,728	0.19
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,213,792,150	0.93
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	173,000,520	0.05
合計	買建	-	4,255,124,739	1.24
種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	1,528,631,019	0.44

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年2月28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	75,024,033,093	47.76
	フランス	15,302,862,151	9.74
	イタリア	13,489,804,361	8.59
	ドイツ	11,180,494,226	7.12
	イギリス	8,906,966,533	5.67
	スペイン	8,839,551,717	5.63
	ベルギー	3,414,924,183	2.17
	カナダ	3,147,777,103	2.00
	オランダ	2,863,320,900	1.82
	オーストラリア	2,452,797,905	1.56
	オーストリア	2,169,601,090	1.38
	中国	1,442,155,858	0.92
	アイルランド	1,218,270,015	0.78
	メキシコ	1,140,942,033	0.73
	フィンランド	893,193,197	0.57
	マレーシア	795,941,390	0.51
	シンガポール	709,054,406	0.45
	ポーランド	705,397,947	0.45
	イスラエル	682,688,937	0.43
	デンマーク	672,766,504	0.43
スウェーデン	438,599,783	0.28	
ノルウェー	384,453,024	0.24	
小計		155,875,596,356	99.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,204,673,051	0.77
合計(純資産総額)		157,080,269,407	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	92,437,120	0.06

(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)

2022年2月28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	3,839,000	2,006.21	7,701,823,948	2,138.50	8,209,701,500	4.15
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	474,800	13,806.58	6,555,362,759	11,810.00	5,607,388,000	2.83
日本	株式	キーエンス	電気機器	68,700	70,247.76	4,826,021,196	53,780.00	3,694,686,000	1.87
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	4,689,100	603.25	2,828,676,340	712.80	3,342,390,480	1.69
日本	株式	リクルート ホールディングス	サービス業	558,700	6,883.64	3,845,891,801	4,819.00	2,692,375,300	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	48,100	59,787.40	2,875,773,797	55,770.00	2,682,537,000	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	777,600	3,127.20	2,431,710,388	3,293.00	2,560,636,800	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	42,800	50,222.33	2,149,515,626	58,020.00	2,483,256,000	1.25
日本	株式	ソフトバンク グループ	情報・通信業	446,100	6,002.34	2,677,643,759	5,125.00	2,286,262,500	1.15
日本	株式	信越化学工業	化学	127,400	19,013.27	2,422,290,521	17,670.00	2,251,158,000	1.14
日本	株式	HOYA	精密機器	147,900	17,973.11	2,658,222,732	14,855.00	2,197,054,500	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	559,000	3,401.54	1,901,462,957	3,871.00	2,163,889,000	1.09
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	517,400	3,713.39	1,921,310,110	4,121.00	2,132,205,400	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	596,400	3,106.34	1,852,620,431	3,525.00	2,102,310,000	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	595,600	3,036.37	1,808,461,268	3,501.00	2,085,195,600	1.05
日本	株式	日立製作所	電気機器	364,500	6,676.95	2,433,747,791	5,650.00	2,059,425,000	1.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	96,500	23,230.58	2,241,750,511	21,205.00	2,046,282,500	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	542,100	3,304.38	1,791,304,572	3,756.00	2,036,127,600	1.03
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	521,700	3,269.43	1,705,660,330	3,743.00	1,952,723,100	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	196,500	12,975.09	2,549,605,317	9,883.00	1,942,009,500	0.98
日本	株式	オリエンタル ランド	サービス業	85,600	17,880.03	1,530,530,974	21,130.00	1,808,728,000	0.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	222,600	8,393.63	1,868,421,755	7,787.00	1,733,386,200	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	595,600	2,822.58	1,681,126,668	2,793.50	1,663,808,600	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	579,400	2,561.27	1,483,998,843	2,865.50	1,660,270,700	0.84

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,126,400	1,559.80	1,756,954,260	1,450.50	1,633,843,200	0.83
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	292,000	4,573.90	1,335,579,758	5,591.00	1,632,572,000	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	246,300	5,734.25	1,412,346,578	6,574.00	1,619,176,200	0.82
日本	株式	S M C	機械	22,200	72,667.63	1,613,221,387	68,050.00	1,510,710,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	956,400	1,405.36	1,344,090,975	1,525.00	1,458,510,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	66,500	22,292.44	1,482,447,533	21,155.00	1,406,807,500	0.71

□ 種類別・業種別投資比率

2022年2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.28
	建設業	2.30
	食料品	3.39
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.21
	化学	6.54
	医薬品	4.98
	石油・石炭製品	0.44
	ゴム製品	0.67
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.81
	金属製品	0.59
	機械	5.17
	電気機器	17.43
	輸送用機器	8.39
	精密機器	2.61
	その他製品	2.36
	電気・ガス業	1.16
	陸運業	3.04
	海運業	0.63
	空運業	0.43
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.97
	卸売業	5.65
	小売業	4.32
	銀行業	5.36
	証券、商品先物取引業	0.77
保険業	2.16	
その他金融業	1.13	

	不動産業	1.96
	サービス業	5.66
合計		98.76

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	150 5年国債	2,150,000,000	100.02	2,150,433,600	100.00	2,150,000,000	0.005	2026/12/20	1.66
日本	国債 証券	146 5年国債	1,740,000,000	100.90	1,755,660,000	100.42	1,747,273,200	0.100	2025/12/20	1.35
日本	国債 証券	147 5年国債	1,700,000,000	100.51	1,708,623,500	100.06	1,701,020,000	0.005	2026/03/20	1.31
日本	国債 証券	361 10年国 債	1,310,000,000	100.24	1,313,137,400	99.83	1,307,707,500	0.100	2030/12/20	1.01
日本	国債 証券	330 10年国 債	1,285,000,000	102.18	1,312,961,600	101.32	1,302,000,550	0.800	2023/09/20	1.00
日本	国債 証券	149 5年国債	1,240,000,000	100.43	1,245,347,000	100.02	1,240,272,800	0.005	2026/09/20	0.96
日本	国債 証券	358 10年国 債	1,100,000,000	100.70	1,107,744,000	100.12	1,101,309,000	0.100	2030/03/20	0.85
日本	国債 証券	360 10年国 債	1,090,000,000	100.51	1,095,559,000	99.92	1,089,073,500	0.100	2030/09/20	0.84
日本	国債 証券	145 5年国債	1,080,000,000	100.95	1,090,260,000	100.39	1,084,222,800	0.100	2025/09/20	0.83
日本	国債 証券	148 5年国債	1,070,000,000	100.53	1,075,722,300	100.04	1,070,460,100	0.005	2026/06/20	0.82
日本	国債 証券	359 10年国 債	1,070,000,000	100.68	1,077,275,600	100.00	1,070,000,000	0.100	2030/06/20	0.82
日本	国債 証券	692 0年国債	1,020,000,000	106.29	1,084,137,600	104.38	1,064,716,800	2.100	2024/03/20	0.82
日本	国債 証券	642 0年国債	1,025,000,000	104.72	1,073,421,000	103.04	1,056,119,000	1.900	2023/09/20	0.81
日本	国債 証券	652 0年国債	1,020,000,000	105.22	1,073,244,000	103.51	1,055,751,000	1.900	2023/12/20	0.81
日本	国債 証券	362 10年国 債	1,040,000,000	100.27	1,042,802,200	99.69	1,036,744,800	0.100	2031/03/20	0.80
日本	国債 証券	144 5年国債	980,000,000	100.89	988,722,000	100.38	983,724,000	0.100	2025/06/20	0.76
日本	国債 証券	364 10年国 債	950,000,000	100.36	953,431,400	99.39	944,186,000	0.100	2031/09/20	0.73

日本	国債証券	333 10年国債	815,000,000	102.08	831,927,550	101.30	825,619,450	0.600	2024/03/20	0.64
日本	国債証券	702 0年国債	780,000,000	107.78	840,660,600	105.59	823,602,000	2.400	2024/06/20	0.63
日本	国債証券	882 0年国債	742,000,000	112.20	832,501,740	109.92	815,628,660	2.300	2026/06/20	0.63
日本	国債証券	338 10年国債	805,000,000	102.01	821,204,650	101.27	815,199,350	0.400	2025/03/20	0.63
日本	国債証券	344 10年国債	811,000,000	101.02	819,231,650	100.46	814,690,050	0.100	2026/09/20	0.63
日本	国債証券	332 10年国債	793,000,000	101.88	807,924,260	101.16	802,167,080	0.600	2023/12/20	0.62
日本	国債証券	141 5年国債	795,000,000	100.76	801,033,300	100.32	797,536,050	0.100	2024/09/20	0.61
日本	国債証券	363 10年国債	800,000,000	100.72	805,742,600	99.54	796,328,000	0.100	2031/06/20	0.61
日本	国債証券	339 10年国債	785,000,000	102.13	801,681,250	101.36	795,636,750	0.400	2025/06/20	0.61
日本	国債証券	722 0年国債	753,000,000	107.40	808,729,530	105.44	793,925,550	2.100	2024/09/20	0.61
日本	国債証券	356 10年国債	780,000,000	100.92	787,176,000	100.23	781,755,000	0.100	2029/09/20	0.60
日本	国債証券	340 10年国債	770,000,000	102.26	787,386,600	101.46	781,226,600	0.400	2025/09/20	0.60
日本	国債証券	143 0年国債	622,000,000	128.05	796,471,000	124.93	777,089,480	2.400	2034/03/20	0.60

□ 種類別投資比率

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	80.52
地方債証券	7.40
特殊債券	7.30
社債券	4.09
合計	99.31

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)

2022年2月28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	18,538.11	16,696,218,282	19,048.42	17,155,823,882	4.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	389,149	38,882.71	15,131,167,968	34,354.17	13,368,891,095	3.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	24,855	411,178.63	10,219,844,850	355,405.22	8,833,596,830	2.57
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,412	336,227.18	5,518,160,524	310,735.90	5,099,797,664	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,698	337,637.50	5,300,233,493	310,874.56	4,880,108,913	1.42
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	45,934	131,071.78	6,020,650,927	93,580.48	4,298,525,699	1.25
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	136,508	38,476.41	5,252,337,594	27,913.41	3,810,404,250	1.11
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	130,127	39,052.41	5,081,772,956	24,320.96	3,164,814,082	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	51,407	52,274.66	2,687,283,241	54,972.91	2,825,992,512	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	163,158	18,626.15	3,039,006,130	17,097.93	2,789,664,633	0.81
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	18,480.91	2,660,272,072	19,181.30	2,761,090,591	0.80
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	72,405	32,622.67	2,362,044,184	36,888.18	2,670,888,817	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	132,439	17,230.69	2,282,015,307	18,284.63	2,421,598,377	0.70

アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	92,369	22,706.64	2,097,389,538	25,336.65	2,340,320,885	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	153,567	15,000.71	2,303,613,628	14,795.91	2,272,163,510	0.66
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	414,671	5,264.69	2,183,115,119	5,202.06	2,157,143,836	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	57,649	47,001.18	2,709,570,946	36,588.91	2,109,313,928	0.61
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	231,724	7,116.64	1,649,095,769	8,994.41	2,084,221,126	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	48,256	37,353.09	1,802,510,638	42,648.35	2,058,038,753	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	22,612	91,065.51	2,059,173,298	76,194.19	1,722,903,114	0.50
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	106,147	13,273.91	1,408,985,508	16,220.91	1,721,800,827	0.50
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	99,447	17,082.12	1,698,765,292	17,278.19	1,718,264,310	0.50
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	6,059.82	1,850,667,962	5,514.05	1,683,989,648	0.49
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	44,655.65	1,719,197,898	43,626.08	1,679,560,607	0.49
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	96,997	13,528.51	1,312,224,476	17,279.35	1,676,044,820	0.49

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・ 飲料・ タバコ	225,164	6,314.19	1,421,727,200	7,262.32	1,635,212,457	0.48
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導 体・半 導体製 造装置	22,497	65,338.46	1,469,919,308	67,944.56	1,528,548,665	0.44
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	6,447.30	1,490,249,227	6,475.42	1,496,748,467	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・ 飲料・ タバコ	75,835	18,977.56	1,439,163,307	19,456.31	1,475,469,193	0.43
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・ 生活必 需品小 売り	24,247	64,098.25	1,554,190,195	59,795.97	1,449,872,872	0.42

□ 種類別・業種別投資比率

2022年2月28日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.19
	素材	4.27
	資本財	6.00
	商業・専門サービス	1.17
	運輸	1.90
	自動車・自動車部品	2.20
	耐久消費財・アパレル	1.76
	消費者サービス	1.81
	小売	5.12
	食品・生活必需品小売り	1.46
	食品・飲料・タバコ	3.99
	家庭用品・パーソナル用品	1.73
	ヘルスケア機器・サービス	4.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	7.92
	銀行	6.37
	各種金融	4.79
	保険	3.05
	不動産	0.39
	ソフトウェア・サービス	11.17
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
半導体・半導体製造装置	4.95	
電気通信サービス	1.54	
公益事業	2.87	

	メディア・娯楽	6.31
投資証券	-	2.37
合計		98.58

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)

2022年2月28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	11,784.25	1,761,745,554	11,430.32	1,708,833,071	1.625	2026/05/15	1.09
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,093.00	1,608,369,106	11,721.05	1,558,899,031	2.250	2026/03/31	0.99
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,667.98	1,140,117,984	12,171.92	1,095,472,930	2.875	2028/05/15	0.70
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,208.55	1,037,726,818	11,832.55	1,005,766,843	2.500	2026/02/28	0.64
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,297.67	960,301,962	10,751.00	913,835,263	1.125	2031/02/15	0.58
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,800,000	10,851.76	954,955,117	10,342.07	910,102,305	0.625	2030/08/15	0.58
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,000,000	11,473.19	917,855,248	11,338.34	907,067,500	0.125	2023/08/15	0.58
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,514.79	886,638,722	11,393.35	877,287,607	0.250	2023/06/15	0.56
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,700,000	11,417.73	879,164,948	11,229.50	864,671,165	0.125	2024/02/15	0.55
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,800,000	10,988.00	857,063,699	10,612.46	827,771,774	0.375	2027/09/30	0.53
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,100,000	11,670.55	828,609,050	11,295.01	801,945,887	1.375	2026/08/31	0.51
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,500,000	10,875.22	815,641,451	10,380.43	778,532,568	0.625	2030/05/15	0.50
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,200,000	11,112.56	800,104,251	10,719.00	771,767,694	0.625	2027/12/31	0.49
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,500,000	11,917.36	774,628,712	11,675.40	758,901,201	2.125	2024/03/31	0.48
ドイ ツ	国債 証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	13,414.76	778,055,893	12,805.18	742,700,286	0.000	2030/08/15	0.47
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,067.49	774,724,618	10,543.48	738,043,271	0.875	2030/11/15	0.47
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,700,000	11,186.63	749,503,982	10,784.51	722,562,344	0.750	2028/01/31	0.46
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,200,000	11,831.16	733,532,199	11,575.68	717,692,373	1.750	2024/06/30	0.46
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,400,000	14,282.10	771,233,159	13,013.82	702,746,212	3.000	2048/08/15	0.45
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,032.45	685,849,798	11,770.73	670,931,715	2.500	2024/05/15	0.43
アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,580.19	694,811,394	11,119.38	667,162,590	1.375	2028/10/31	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,026.68	673,493,805	11,746.35	657,795,644	2.375	2024/08/15	0.42
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000	15,828.37	696,448,302	14,913.94	656,213,215	3.500	2030/03/01	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,456.09	652,997,084	11,302.64	644,250,411	0.125	2023/10/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,314.77	667,571,521	10,880.19	641,931,092	1.000	2028/07/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,757.21	646,646,687	11,485.44	631,699,139	1.500	2024/10/31	0.40
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,118.96	629,709,897	13,011.99	624,575,616	0.000	2024/03/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	11,554.08	670,136,384	10,459.01	606,622,478	1.875	2051/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,065.38	615,334,601	11,815.33	602,582,041	2.750	2024/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,005.41	612,276,108	11,714.69	597,449,195	2.250	2024/11/15	0.38

□ 種類別投資比率

2022年2月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.23
合計	99.23

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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）

2022年2月28日現在

種類	国／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	TOPIX先物 0403 月2022年 3月	買建	129	日本・円	2,457,206,900	2,439,390,000	1.23

(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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年2月28日現在

種類	国/ 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	FTS E 10 0 ID X FU T MA R 22 2022年3月	買建	18	イギリ ス・ポ ンド	1,361,181.00	210,411,358	1,341,450.00	207,361,341	0.06
	ドイ ツ	EU RE X	EUR O ST OXX 50 M AR 22 2022年3月	買建	129	ユーロ	5,344,198.00	691,218,569	5,110,335.00	660,970,728	0.19
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 500 EMIN I FU T MA R 22 2022年3月	買建	127	アメリ カ・ド ル	28,017,606.00	3,237,434,373	27,813,000.00	3,213,792,150	0.93
	オー スト ラリ ア	シド ニー 先物 取引 所	SPI 200 FUTU RES MAR 2 2 2022年 3月	買建	12	オー ストラ リア・ ドル	2,110,604.00	175,074,601	2,085,600.00	173,000,520	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。

2022年2月28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	売建	10,210,000.00	1,176,618,833	1,179,697,656	0.34
	ユーロ	売建	890,000.00	115,253,029	115,113,185	0.03
	カナダ・ドル	売建	700,000.00	63,207,513	63,360,525	0.02
	イギリス・ポンド	売建	390,000.00	60,458,779	60,283,190	0.02
	スイス・フラン	売建	370,000.00	46,266,688	46,198,948	0.01
	スウェーデン・クローナ	売建	1,450,000.00	17,630,319	17,543,977	0.01
	香港・ドル	売建	1,060,000.00	15,658,049	15,676,655	0.00
	デンマーク・クローネ	売建	710,000.00	12,357,534	12,339,800	0.00
シンガポール・ドル	売建	80,000.00	6,823,992	6,824,288	0.00	

オーストラリア・ドル	売建	50,000.00	4,142,955	4,147,445	0.00
イスラエル・シケル	売建	100,000.00	3,552,650	3,576,880	0.00
ノルウェー・クローネ	売建	240,000.00	3,092,264	3,095,834	0.00
ニュージーランド・ドル	売建	10,000.00	773,180	772,636	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年2月28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	売建	800,000.00	92,312,000	92,437,120	0.06

(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:2022年2月28日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■マイパッケージNEXT30



決算期	分配金
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2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。

■マイパッケージNEXT50



決算期	分配金
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2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。

■マイパッケージNEXT70



決算期	分配金
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■マイパッケージNEXT30

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.25
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	国内債券パッシブ・マザーファンド	54.94
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	19.72
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	10.06
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.02

■マイパッケージNEXT50

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.88
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	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.32
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)	34.86
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	14.88
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.07

■マイパッケージNEXT70

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.70
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)	49.84
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	20.04
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.38
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.04

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.24
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.23%

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	4.15
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.83
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.87
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.69
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.36
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	1.25
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.15
日本	株式	信越化学工業	化学	1.14

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	80.52
地方債証券	日本	7.40
特殊債券	日本	7.30
社債券	日本	3.93
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.69
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.66
日本	国債証券	146 5年国債	0.100	2025/12/20	1.35
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.31
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	1.01
日本	国債証券	330 10年国債	0.800	2023/09/20	1.00
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.96
日本	国債証券	358 10年国債	0.100	2030/03/20	0.85
日本	国債証券	360 10年国債	0.100	2030/09/20	0.84
日本	国債証券	145 5年国債	0.100	2025/09/20	0.83
日本	国債証券	148 5年国債	0.005	2026/06/20	0.82

■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	67.72
	イギリス	4.27
	カナダ	3.71
	スイス	3.30
	フランス	3.10
	ドイツ	2.49
	その他	11.61
投資証券	アメリカ・その他	2.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.43
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.24%

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	4.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.57
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	1.42
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.25
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.11
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.81

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	47.76
	フランス	9.74
	イタリア	8.59
	ドイツ	7.12
	イギリス	5.67
	スペイン	5.63
	ベルギー	2.17
	その他	12.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.77
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	1.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.64
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	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2023/06/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	0.53

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■マイパッケージNEXT30



■マイパッケージNEXT50



■マイパッケージNEXT70



※2019年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2019年6月28日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2022年の収益率は、年初から2022年2月28日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】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「マイパッケージNEXT30」は「マイN30」、「マイパッケージNEXT50」は「マイN50」、「マイパッケージNEXT70」は「マイN70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2019年6月28日から下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約

款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

す。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期(2021年2月19日から2022年2月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2021年 2月18日現在)	第3期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	344,040
コール・ローン	6,453,577	11,409,409
親投資信託受益証券	122,996,937	232,115,670
未収入金	435,000	1,100,000
流動資産合計	129,885,514	244,969,119
資産合計	129,885,514	244,969,119
負債の部		
流動負債		
未払解約金	464,390	557,362
未払受託者報酬	9,804	26,723
未払委託者報酬	58,749	160,500
未払利息	18	-
その他未払費用	2,873	7,984
流動負債合計	535,834	752,569
負債合計	535,834	752,569
純資産の部		
元本等		
元本	119,003,460	221,385,852
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,346,220	22,830,698
(分配準備積立金)	5,937,584	7,500,302
元本等合計	129,349,680	244,216,550
純資産合計	129,349,680	244,216,550
負債純資産合計	129,885,514	244,969,119

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期		第3期	
	自	2020年 2月19日	自	2021年 2月19日
	至	2021年 2月18日	至	2022年 2月18日
営業収益				
受取利息		-		60
有価証券売買等損益		6,333,447		2,073,733
営業収益合計		6,333,447		2,073,793
営業費用				
支払利息		2,083		7,007
受託者報酬		12,212		46,978
委託者報酬		73,024		281,951
その他費用		3,879		14,980
営業費用合計		91,198		350,916
営業利益又は営業損失()		6,242,249		1,722,877
経常利益又は経常損失()		6,242,249		1,722,877
当期純利益又は当期純損失()		6,242,249		1,722,877
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()		329,045		441,561
期首剰余金又は期首欠損金()		36,533		10,346,220
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,622,742		13,633,722
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		4,622,742		13,633,722
剰余金減少額又は欠損金増加額		226,259		2,430,560
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		226,259		2,430,560
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()		10,346,220		22,830,698

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	119,003,460口	221,385,852口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0869円 (1万口当たりの純資産額10,869円)	1口当たり純資産額 1.1031円 (1万口当たりの純資産額11,031円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2020年2月19日 至 2021年2月18日	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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(687,721円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,225,483円)、収益調整金(4,408,636円)、および分配準備積立金(24,380円)より、分配対象収益は10,346,220円(1万口当たり869.39円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,371,146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(15,330,396円)、および分配準備積立金(5,129,156円)より、分配対象収益は22,830,698円(1万口当たり1,031.26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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該評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3期 (2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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>

	(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2期(自 2020年2月19日 至 2021年2月18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	5,751,776円
合計	5,751,776円

第3期(自 2021年2月19日 至 2022年2月18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	945,539円
合計	945,539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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	119,003,460円
期中追加設定元本額	129,718,508円	128,773,003円
期中一部解約元本額	11,715,048円	26,390,611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)	15,201,309	48,951,255	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	4,312,302	24,251,523	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	12,560,303	24,258,969	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	106,995,569	134,653,923	
	親投資信託受益証券 小計		232,115,670	
合 計			232,115,670	

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 ・年金バランス50(標準型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2021年 2月18日現在)	第3期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,051,821
コール・ローン	17,041,155	34,881,580
親投資信託受益証券	318,577,696	682,691,935
未収入金	-	300,000
流動資産合計	335,618,851	718,925,336
資産合計	335,618,851	718,925,336
負債の部		
流動負債		
未払解約金	70,517	332,091
未払受託者報酬	28,216	75,116
未払委託者報酬	169,243	450,836
未払利息	49	-
その他未払費用	8,397	22,534
流動負債合計	276,422	880,577
負債合計	276,422	880,577
純資産の部		
元本等		
元本	291,333,032	606,200,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	44,009,397	111,843,786
(分配準備積立金)	29,906,979	35,793,190
元本等合計	335,342,429	718,044,759
純資産合計	335,342,429	718,044,759
負債純資産合計	335,618,851	718,925,336

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自 至	2020年 2月19日 2021年 2月18日	自 至	2021年 2月19日 2022年 2月18日
営業収益				
受取利息		-		185
有価証券売買等損益		31,775,785		11,207,239
営業収益合計		31,775,785		11,207,424
営業費用				
支払利息		6,521		19,732
受託者報酬		36,073		128,740
委託者報酬		216,370		772,507
その他費用		11,933		41,379
営業費用合計		270,897		962,358
営業利益又は営業損失（ ）		31,504,888		10,245,066
経常利益又は経常損失（ ）		31,504,888		10,245,066
当期純利益又は当期純損失（ ）		31,504,888		10,245,066
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,641,709		1,618,601
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		123,191		44,009,397
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,910,655		66,781,340
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		14,910,655		66,781,340
剰余金減少額又は欠損金増加額		887,628		7,573,416
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		887,628		7,573,416
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（ ）		44,009,397		111,843,786

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	291,333,032口	606,200,973口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1511円 (1万口当たりの純資産額11,511円)	1口当たり純資産額 1.1845円 (1万口当たりの純資産額11,845円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2020年2月19日 至 2021年2月18日	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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(2,214,750円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(27,648,429円)、収益調整金(14,102,418円)、および分配準備積立金(43,800円)より、分配対象収益は44,009,397円(1万口当たり1,510.59円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,586,050円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,040,415円)、収益調整金(76,050,596円)、および分配準備積立金(27,166,725円)より、分配対象収益は111,843,786円(1万口当たり1,845.00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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該評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3期 (2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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>

	(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2期(自 2020年2月19日 至 2021年2月18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	29,578,110円
合計	29,578,110円

第3期(自 2021年2月19日 至 2022年2月18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	8,739,129円
合計	8,739,129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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
期首元本額	2,156,528円	291,333,032円
期中追加設定元本額	322,790,706円	361,775,633円
期中一部解約元本額	33,614,202円	46,907,692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)	78,234,236	251,929,886	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	18,997,088	106,835,823	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	37,237,962	71,921,399	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	200,242,215	252,004,827	
	親投資信託受益証券 小計		682,691,935	
合 計			682,691,935	

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 ・年金バランス70(株式重点型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2021年 2月18日現在)	第3期 (2022年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	709,318
コール・ローン	10,710,390	23,523,145
親投資信託受益証券	202,385,361	452,603,237
未収入金	1,100,000	500,000
流動資産合計	214,195,751	477,335,700
資産合計	214,195,751	477,335,700
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,168,057	192,592
未払受託者報酬	16,461	51,007
未払委託者報酬	98,655	306,218
未払利息	31	-
その他未払費用	4,870	15,287
流動負債合計	1,288,074	565,104
負債合計	1,288,074	565,104
純資産の部		
元本等		
元本	175,175,655	376,324,099
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	37,732,022	100,446,497
(分配準備積立金)	24,655,577	30,719,562
元本等合計	212,907,677	476,770,596
純資産合計	212,907,677	476,770,596
負債純資産合計	214,195,751	477,335,700

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自 2020年 2月19日	至 2021年 2月18日	自 2021年 2月19日	至 2022年 2月18日
営業収益				
受取利息		-		123
有価証券売買等損益		25,798,924		11,487,876
営業収益合計		25,798,924		11,487,999
営業費用				
支払利息		3,626		13,020
受託者報酬		20,040		85,706
委託者報酬		119,974		514,347
その他費用		6,528		27,476
営業費用合計		150,168		640,549
営業利益又は営業損失（ ）		25,648,756		10,847,450
経常利益又は経常損失（ ）		25,648,756		10,847,450
当期純利益又は当期純損失（ ）		25,648,756		10,847,450
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,056,807		1,551,219
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		78,471		37,732,022
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,597,725		62,559,370
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		13,597,725		62,559,370
剰余金減少額又は欠損金増加額		536,123		9,141,126
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		536,123		9,141,126
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（ ）		37,732,022		100,446,497

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	175,175,655口	376,324,099口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2154円 (1万口当たりの純資産額12,154円)	1口当たり純資産額 1.2669円 (1万口当たりの純資産額12,669円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2020年2月19日 至 2021年2月18日	自 2021年2月19日 至 2022年2月18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(1,296,049円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(23,295,900円)、収益調整金(13,770,789円)、および分配準備積立金(63,628円)より、分配対象収益は38,426,366円(1万口当たり2,193.57円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,815,196円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,481,035円)、収益調整金(69,726,935円)、および分配準備積立金(21,423,331円)より、分配対象収益は100,446,497円(1万口当たり2,669.15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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(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、親投資信託受益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、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。 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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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>

	(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2期(自 2020年2月19日 至 2021年2月18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	24,983,975円
合計	24,983,975円

第3期(自 2021年2月19日 至 2022年2月18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	9,451,328円
合計	9,451,328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3期 自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第2期	第3期
	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	175,175,655円
期中追加設定元本額	190,606,278円	241,009,796円
期中一部解約元本額	16,430,623円	39,861,352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)	74,185,345	238,891,647	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	16,653,445	93,655,643	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	24,650,918	47,610,783	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	57,564,692	72,445,164	
	親投資信託受益証券 小計		452,603,237	
合 計			452,603,237	

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D S・年金バランス30(債券重点型)」、「三井住友D S・年金バランス50(標準型)」および「三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	502,280	83,758,164
コール・ローン	1,720,766,125	2,777,675,310
株式	191,629,346,460	199,369,314,880
派生商品評価勘定	1,288,400	30,794,600
未収入金	834,420,600	-
未収配当金	258,091,983	309,642,705
前払金	6,325,000	-
差入委託証拠金	-	127,995,000
流動資産合計	194,450,740,848	202,699,180,659
資産合計	194,450,740,848	202,699,180,659
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,672,800	31,221,600
前受金	-	10,130,000
未払金	32,510,000	-
未払解約金	898,854,281	98,843,866

未払利息	4,991	-
その他未払費用	-	4,873
流動負債合計	939,042,072	140,200,339
負債合計	939,042,072	140,200,339
純資産の部		
元本等		
元本	60,820,017,437	62,902,449,020
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	132,691,681,339	139,656,531,300
元本等合計	193,511,698,776	202,558,980,320
純資産合計	193,511,698,776	202,558,980,320
負債純資産合計	194,450,740,848	202,699,180,659

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 担保資産	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。 株式 3,237,200,000円	
2. 当計算期間の末日に おける受益権の総数	60,820,017,437口	62,902,449,020口
3. 1単位当たり純資産 の額	1口当たり純資産額 3.1817円 (1万口当たりの純資産額31,817円)	1口当たり純資産額 3.2202円 (1万口当たりの純資産額32,202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2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組 方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に 定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券 等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としておりま す。
2. 金融商品の内容及び金 融商品に係るリスク	(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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該評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	(2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	<p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</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2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400
	小計	1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400
合計		1,056,144,400	-	1,049,760,000	6,384,400

(2022年2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0403 月	3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000
	小計	3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000
合計		3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000

(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2月19日

至 2022年2月18日

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

(その他の注記)

(2021年2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	63,487,344,187円
同期中における追加設定元本額	16,694,979,606円
同期中における一部解約元本額	19,362,306,356円
2021年2月18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	9,404,590,793円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	898,808,952円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,316,392,926円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,161,513,971円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,327,444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)	4,745,714円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	21,665,760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)	62,490,514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)	126,044,617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)	99,906,541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)	194,915,092円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,071,059,349円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	15,499,280,590円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	466,003,423円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	495,863,983円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	321,041,412円
イオン・バランス戦略ファンド	121,929,057円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	22,024,273円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	120,727,451円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	100,041,705円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	327,627,673円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	164,695,408円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	189,610,939円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	22,761,586円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	148,890,453円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	8,116,700円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	36,797,812円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	33,328,379円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,050,685円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,211,203,189円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	18,445,249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>	137,166,232円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	2,206,990,978円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,875,824,112円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	7,015,323,174円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,890,062円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	181,035,305円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	438,764円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	800,316,032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>	50,237,510円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	298,824,987円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	899,084,795円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	709,877,322円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,199,096,195円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	481,330円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	49,105,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	54,941,254円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,287,272円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	19,662,852円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	143,136,198円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	285,706,660円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	76,958,035円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	45,963,151円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,816,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	52,051,459円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	702,005,565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)	182,193,344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>	333,495,594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>	140,494,480円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	916,105,450円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	79,523,793円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	22,065,298円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	61,606,512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>	51,678,499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>	303,731,689円
合計	60,820,017,437円

(2022年2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,820,017,437円
同期中における追加設定元本額	11,487,243,977円
同期中における一部解約元本額	9,404,812,394円
2022年2月18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	9,520,834,455円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	951,877,317円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,478,037,849円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,395,171,931円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	127,138,615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)	4,726,830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)	21,334,615円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	65,507,861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)	154,129,074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)	131,613,738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)	235,373,969円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,444,332,755円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	19,077,187,540円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	372,665,266円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	429,325,888円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	276,656,842円
イオン・バランス戦略ファンド	7,275,121円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,464,038円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	172,024,760円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	157,517,509円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	545,398,972円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	291,040,173円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	334,763,476円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,178,840円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	493,124,501円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	15,201,309円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	78,234,236円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	74,185,345円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,134,560円
日興FWS・日本株インデックス	538,422,236円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	4,292,616円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,783,565,189円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	14,345,131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 >	102,021,389円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,801,728,322円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,641,765,844円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,244,629,351円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	41,484,094円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	165,970,889円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	725,009,629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 >	47,231,431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 >	836,648,839円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	607,228,831円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,892,033,496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 >	41,957,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	47,526,234円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	34,199,513円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,944,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	112,116,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	243,725,102円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	60,760,917円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	39,691,119円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,467,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	45,936,567円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	609,118,916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)	180,317,730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>	206,061,152円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	60,728,009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>	54,286,476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>	47,217,544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>	60,182,914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>	43,247,408円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	9,321,771円
合計	62,902,449,020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	3,215.000	11,895,500	
日本水産	102,500	560.000	57,400,000	
マルハニチロ	15,600	2,629.000	41,012,400	
雪国まいたけ	8,300	1,215.000	10,084,500	
カネコ種苗	5,000	1,577.000	7,885,000	
サカタのタネ	12,100	3,420.000	41,382,000	
ホクト	8,700	1,980.000	17,226,000	
日鉄鉱業	2,400	6,460.000	15,504,000	
三井松島ホールディングス	4,800	1,658.000	7,958,400	
INPEX	412,400	1,131.000	466,424,400	
石油資源開発	12,100	2,748.000	33,250,800	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,575.000	8,820,000	
ヒノキヤグループ	2,900	2,365.000	6,858,500	
ショーボンドホールディングス	14,700	5,190.000	76,293,000	
ミライト・ホールディングス	32,900	1,933.000	63,595,700	
タマホーム	6,300	2,312.000	14,565,600	
ベステラ	4,200	1,278.000	5,367,600	
Robot Home	22,100	212.000	4,685,200	
安藤・間	51,300	934.000	47,914,200	
東急建設	32,200	732.000	23,570,400	
コムシスホールディングス	33,000	2,800.000	92,400,000	
ピーアールホールディングス	19,200	350.000	6,720,000	
高松コンストラクショングループ	6,900	2,010.000	13,869,000	
東建コーポレーション	2,900	9,150.000	26,535,000	
オリエンタル白石	38,500	243.000	9,355,500	
大成建設	68,600	3,850.000	264,110,000	
大林組	237,300	976.000	231,604,800	
清水建設	222,400	779.000	173,249,600	

飛島建設	9,200	1,121.000	10,313,200
長谷工コーポレーション	70,100	1,518.000	106,411,800
松井建設	11,900	738.000	8,782,200
銭高組	1,800	4,090.000	7,362,000
鹿島建設	173,600	1,580.000	274,288,000
不動テトラ	6,200	1,559.000	9,665,800
大末建設	4,100	1,322.000	5,420,200
鉄建建設	7,100	1,937.000	13,752,700
西松建設	14,700	3,865.000	56,815,500
三井住友建設	56,900	454.000	25,832,600
大豊建設	3,800	3,695.000	14,041,000
奥村組	14,000	3,250.000	45,500,000
東鉄工業	10,800	2,534.000	27,367,200
浅沼組	2,900	5,360.000	15,544,000
戸田建設	99,700	770.000	76,769,000
熊谷組	11,900	2,903.000	34,545,700
北野建設	3,000	2,149.000	6,447,000
矢作建設工業	12,900	795.000	10,255,500
ピーエス三菱	9,900	612.000	6,058,800
日本ハウスホールディングス	20,200	454.000	9,170,800
大東建託	24,300	12,840.000	312,012,000
新日本建設	10,900	756.000	8,240,400
東亜道路工業	1,600	5,040.000	8,064,000
日本道路	2,400	9,880.000	23,712,000
東亜建設工業	6,400	2,675.000	17,120,000
日本国土開発	24,000	536.000	12,864,000
若築建設	5,200	1,920.000	9,984,000
東洋建設	27,400	590.000	16,166,000
五洋建設	95,400	626.000	59,720,400
世紀東急工業	13,000	810.000	10,530,000
福田組	2,800	4,305.000	12,054,000
住友林業	60,800	2,280.000	138,624,000
日本基礎技術	4,600	668.000	3,072,800
巴コーポレーション	14,600	503.000	7,343,800
大和ハウス工業	219,600	3,366.000	739,173,600
ライト工業	14,700	1,922.000	28,253,400
積水ハウス	257,800	2,383.500	614,466,300
北陸電気工事	6,600	805.000	5,313,000
ユアテック	14,900	720.000	10,728,000
日本リーテック	6,100	1,492.000	9,101,200
中電工	9,900	2,162.000	21,403,800
関電工	37,500	875.000	32,812,500
きんでん	52,300	1,630.000	85,249,000
東京エネシス	9,700	950.000	9,215,000
トーエネック	2,900	3,280.000	9,512,000
住友電設	6,300	2,221.000	13,992,300
日本電設工業	12,700	1,581.000	20,078,700
エクシオグループ	35,200	2,396.000	84,339,200

新日本空調	6,800	2,050.000	13,940,000
九電工	18,500	3,120.000	57,720,000
三機工業	15,000	1,496.000	22,440,000
日揮ホールディングス	73,900	1,089.000	80,477,100
中外炉工業	3,900	1,565.000	6,103,500
ヤマト	9,800	705.000	6,909,000
太平電業	5,700	2,707.000	15,429,900
高砂熱学工業	21,100	1,973.000	41,630,300
朝日工業社	2,300	3,030.000	6,969,000
明星工業	17,400	722.000	12,562,800
大気社	11,700	3,095.000	36,211,500
ダイダン	5,600	2,323.000	13,008,800
日比谷総合設備	8,100	1,890.000	15,309,000
テスホールディングス	5,900	1,275.000	7,522,500
インフロニア・ホールディングス	102,000	1,042.000	106,284,000
東洋エンジニアリング	12,400	596.000	7,390,400
レイズネクスト	11,800	1,140.000	13,452,000
ニッポン	20,800	1,696.000	35,276,800
日清製粉グループ本社	85,400	1,687.000	144,069,800
昭和産業	7,100	2,703.000	19,191,300
鳥越製粉	4,900	672.000	3,292,800
中部飼料	9,400	1,062.000	9,982,800
フィード・ワン	11,400	689.000	7,854,600
日本甜菜製糖	5,300	1,712.000	9,073,600
D M三井製糖ホールディングス	6,400	2,000.000	12,800,000
日新製糖	4,400	1,789.000	7,871,600
森永製菓	18,000	3,680.000	66,240,000
中村屋	2,500	3,375.000	8,437,500
江崎グリコ	20,800	3,960.000	82,368,000
名糖産業	5,100	1,680.000	8,568,000
井村屋グループ	4,700	2,293.000	10,777,100
不二家	4,400	2,494.000	10,973,600
山崎製パン	57,100	1,555.000	88,790,500
モロゾフ	2,600	2,709.000	7,043,400
亀田製菓	4,400	4,100.000	18,040,000
寿スピリッツ	7,400	6,050.000	44,770,000
カルビー	34,800	2,557.000	88,983,600
森永乳業	14,100	5,620.000	79,242,000
六甲バター	6,600	1,579.000	10,421,400
ヤクルト本社	56,400	6,120.000	345,168,000
明治ホールディングス	50,000	6,940.000	347,000,000
雪印メグミルク	18,200	2,006.000	36,509,200
プリマハム	8,900	2,435.000	21,671,500
日本ハム	29,000	4,420.000	128,180,000
丸大食品	8,100	1,526.000	12,360,600
S Foods	6,800	3,275.000	22,270,000
柿安本店	3,000	2,597.000	7,791,000
伊藤ハム米久ホールディングス	45,600	688.000	31,372,800

サッポロホールディングス	26,000	2,429.000	63,154,000
アサヒグループホールディングス	179,000	5,147.000	921,313,000
キリンホールディングス	279,700	2,032.000	568,350,400
宝ホールディングス	50,900	1,177.000	59,909,300
オエノンホールディングス	25,700	345.000	8,866,500
養命酒製造	3,800	1,771.000	6,729,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,100	1,516.000	82,015,600
サントリー食品インターナショナル	50,800	4,665.000	236,982,000
ダイドーグループホールディングス	3,900	5,160.000	20,124,000
伊藤園	23,100	6,760.000	156,156,000
キーコーヒー	7,100	2,083.000	14,789,300
日清オイリオグループ	9,000	2,996.000	26,964,000
不二製油グループ本社	16,600	2,263.000	37,565,800
かどや製油	1,400	3,580.000	5,012,000
J・オイルミルズ	7,700	1,743.000	13,421,100
キッコーマン	54,700	8,970.000	490,659,000
味の素	167,900	3,320.000	557,428,000
ブルドックソース	4,200	2,007.000	8,429,400
キューピー	39,900	2,482.000	99,031,800
ハウス食品グループ本社	28,300	3,040.000	86,032,000
カゴメ	28,800	3,050.000	87,840,000
焼津水産化学工業	6,500	916.000	5,954,000
アリアケジャパン	7,000	5,850.000	40,950,000
ニチレイ	35,100	2,633.000	92,418,300
東洋水産	36,500	4,905.000	179,032,500
イトアンドホールディングス	3,900	2,314.000	9,024,600
日清食品ホールディングス	29,800	9,140.000	272,372,000
永谷園ホールディングス	4,200	1,997.000	8,387,400
一正蒲鉾	3,100	790.000	2,449,000
フジッコ	7,700	1,965.000	15,130,500
ロック・フィールド	8,100	1,589.000	12,870,900
日本たばこ産業	407,600	2,344.000	955,414,400
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,453.000	7,991,500
わらべや日洋ホールディングス	5,400	1,835.000	9,909,000
なとり	5,200	2,084.000	10,836,800
ピクルスコーポレーション	4,200	1,526.000	6,409,200
ファーマフーズ	7,400	1,611.000	11,921,400
ユーグレナ	38,800	776.000	30,108,800
紀文食品	5,400	1,203.000	6,496,200
ミヨシ油脂	5,300	1,139.000	6,036,700
理研ビタミン	8,100	1,749.000	14,166,900
片倉工業	8,700	2,322.000	20,201,400
グンゼ	5,100	3,880.000	19,788,000
東洋紡	30,400	1,259.000	38,273,600
ユニチカ	24,300	308.000	7,484,400
富士紡ホールディングス	3,600	3,670.000	13,212,000
倉敷紡績	7,000	1,928.000	13,496,000

シキボウ	8,500	912.000	7,752,000
日本毛織	22,700	892.000	20,248,400
帝国繊維	8,900	1,927.000	17,150,300
帝人	69,800	1,417.000	98,906,600
東レ	536,600	673.300	361,292,780
住江織物	2,600	1,964.000	5,106,400
アツギ	10,200	606.000	6,181,200
ダイニツク	7,400	748.000	5,535,200
セーレン	15,500	2,172.000	33,666,000
小松マテーレ	13,000	1,293.000	16,809,000
ワコールホールディングス	19,500	2,031.000	39,604,500
ホギメディカル	10,200	3,255.000	33,201,000
T S Iホールディングス	29,400	329.000	9,672,600
マツオカコーポレーション	1,900	1,172.000	2,226,800
ワールド	11,000	1,245.000	13,695,000
オンワードホールディングス	47,400	290.000	13,746,000
ゴールドウイン	13,500	6,080.000	82,080,000
デサント	14,500	3,020.000	43,790,000
特種東海製紙	4,800	4,135.000	19,848,000
王子ホールディングス	308,800	611.000	188,676,800
日本製紙	36,500	1,153.000	42,084,500
北越コーポレーション	49,500	747.000	36,976,500
大王製紙	36,500	1,773.000	64,714,500
レンゴー	70,900	871.000	61,753,900
トーモク	5,800	1,738.000	10,080,400
ザ・バック	6,200	2,754.000	17,074,800
北の達人コーポレーション	28,600	223.000	6,377,800
クラレ	107,400	1,099.000	118,032,600
旭化成	491,400	1,109.500	545,208,300
昭和電工	64,400	2,333.000	150,245,200
住友化学	541,300	560.000	303,128,000
住友精化	3,700	3,350.000	12,395,000
日産化学	40,400	6,550.000	264,620,000
クレハ	5,800	9,160.000	53,128,000
多木化学	3,000	4,935.000	14,805,000
テイカ	6,300	1,330.000	8,379,000
石原産業	12,800	1,078.000	13,798,400
日本曹達	9,500	3,430.000	32,585,000
東ソー	106,500	1,863.000	198,409,500
トクヤマ	23,900	1,891.000	45,194,900
セントラル硝子	12,000	2,079.000	24,948,000
東亜合成	41,800	1,094.000	45,729,200
大阪ソーダ	6,800	3,130.000	21,284,000
関東電化工業	16,700	1,193.000	19,923,100
デンカ	26,900	3,565.000	95,898,500
信越化学工業	127,400	18,025.000	2,296,385,000
堺化学工業	5,600	2,041.000	11,429,600
第一稀元素化学工業	8,400	1,006.000	8,450,400

エア・ウォーター	70,100	1,687.000	118,258,700
日本酸素ホールディングス	71,200	2,280.000	162,336,000
日本化学工業	2,800	2,530.000	7,084,000
日本パーカライジング	37,000	1,008.000	37,296,000
高圧ガス工業	13,400	699.000	9,366,600
四国化成工業	9,800	1,434.000	14,053,200
ステラ ケミファ	4,100	2,422.000	9,930,200
保土谷化学工業	2,400	4,300.000	10,320,000
日本触媒	12,600	5,800.000	73,080,000
大日精化工業	6,100	2,219.000	13,535,900
カネカ	19,100	3,830.000	73,153,000
三菱瓦斯化学	68,800	2,052.000	141,177,600
三井化学	67,100	3,035.000	203,648,500
J S R	69,200	3,480.000	240,816,000
東京応化工業	12,200	7,230.000	88,206,000
大阪有機化学工業	6,400	3,110.000	19,904,000
三菱ケミカルホールディングス	496,000	839.700	416,491,200
K Hネオケム	12,300	2,767.000	34,034,100
ダイセル	107,300	885.000	94,960,500
住友ベークライト	11,800	4,945.000	58,351,000
積水化学工業	154,300	1,969.000	303,816,700
日本ゼオン	67,100	1,347.000	90,383,700
アイカ工業	20,700	3,240.000	67,068,000
宇部興産	34,500	2,192.000	75,624,000
積水樹脂	11,300	1,958.000	22,125,400
タキロンシーアイ	17,600	562.000	9,891,200
旭有機材	4,900	2,087.000	10,226,300
ニチバン	5,600	1,777.000	9,951,200
リケンテクノス	19,300	466.000	8,993,800
大倉工業	4,200	1,913.000	8,034,600
群栄化学工業	2,300	3,505.000	8,061,500
ミライアル	3,100	1,562.000	4,842,200
ダイキョーニシカワ	17,300	584.000	10,103,200
森六ホールディングス	5,000	1,916.000	9,580,000
恵和	2,100	4,520.000	9,492,000
日本化薬	59,100	1,153.000	68,142,300
カーリットホールディングス	9,600	702.000	6,739,200
日本精化	6,200	1,957.000	12,133,400
扶桑化学工業	6,600	4,630.000	30,558,000
トリケミカル研究所	7,700	2,820.000	21,714,000
A D E K A	34,000	2,654.000	90,236,000
日油	25,300	5,110.000	129,283,000
新日本理化	20,100	242.000	4,864,200
ハリマ化成グループ	7,800	813.000	6,341,400
花王	167,700	5,338.000	895,182,600
第一工業製薬	3,100	2,756.000	8,543,600
石原ケミカル	4,800	1,335.000	6,408,000
ニイタカ	2,400	2,343.000	5,623,200

三洋化成工業	4,300	5,110.000	21,973,000
大日本塗料	11,400	816.000	9,302,400
日本ペイントホールディングス	279,300	1,027.000	286,841,100
関西ペイント	77,000	2,429.000	187,033,000
中国塗料	18,800	899.000	16,901,200
日本特殊塗料	7,000	883.000	6,181,000
藤倉化成	12,000	459.000	5,508,000
太陽ホールディングス	11,000	3,090.000	33,990,000
D I C	31,200	2,745.000	85,644,000
サカタインクス	15,100	946.000	14,284,600
東洋インキS Cホールディングス	14,800	1,912.000	28,297,600
T & K T O K A	8,700	910.000	7,917,000
富士フイルムホールディングス	133,300	7,589.000	1,011,613,700
資生堂	141,400	6,780.000	958,692,000
ライオン	91,800	1,509.000	138,526,200
高砂香料工業	5,300	2,749.000	14,569,700
マンダム	16,600	1,391.000	23,090,600
ミルボン	9,500	6,090.000	57,855,000
ファンケル	30,700	3,255.000	99,928,500
コーセー	14,300	13,470.000	192,621,000
コタ	5,900	1,603.000	9,457,700
ポーラ・オルビスホールディングス	32,600	1,840.000	59,984,000
ノエビアホールディングス	6,500	5,190.000	33,735,000
エステー	5,800	1,537.000	8,914,600
コニシ	12,600	1,580.000	19,908,000
長谷川香料	13,100	2,340.000	30,654,000
小林製薬	21,200	9,760.000	206,912,000
荒川化学工業	7,600	1,138.000	8,648,800
メック	5,800	3,040.000	17,632,000
タカラバイオ	19,900	2,414.000	48,038,600
J C U	8,400	4,700.000	39,480,000
O A Tアグリオ	2,100	1,900.000	3,990,000
デクセリアルズ	19,800	3,025.000	59,895,000
アース製薬	6,300	5,550.000	34,965,000
北興化学工業	8,100	833.000	6,747,300
大成ラミック	3,500	2,747.000	9,614,500
クミアイ化学工業	29,000	808.000	23,432,000
日本農薬	16,600	538.000	8,930,800
アキレス	6,600	1,275.000	8,415,000
有沢製作所	11,700	1,003.000	11,735,100
日東電工	45,700	8,350.000	381,595,000
レック	11,600	961.000	11,147,600
藤森工業	6,700	4,030.000	27,001,000
前澤化成工業	6,900	1,273.000	8,783,700
未来工業	3,800	1,519.000	5,772,200
J S P	5,400	1,592.000	8,596,800
エフピコ	14,200	3,245.000	46,079,000
天馬	6,100	2,580.000	15,738,000

信越ポリマー	13,700	1,098.000	15,042,600
東リ	28,600	227.000	6,492,200
ニフコ	25,300	3,550.000	89,815,000
バルカー	6,200	2,549.000	15,803,800
ユニ・チャーム	146,300	4,287.000	627,188,100
協和キリン	88,600	3,070.000	272,002,000
武田薬品工業	595,600	3,536.000	2,106,041,600
アステラス製薬	656,900	1,991.500	1,308,216,350
大日本住友製薬	47,100	1,292.000	60,853,200
塩野義製薬	95,200	7,681.000	731,231,200
日本新薬	19,800	7,710.000	152,658,000
中外製薬	236,900	3,908.000	925,805,200
科研製薬	12,000	4,215.000	50,580,000
エーザイ	90,600	5,906.000	535,083,600
ロート製薬	38,900	3,750.000	145,875,000
小野薬品工業	174,100	2,851.500	496,446,150
久光製薬	20,100	3,750.000	75,375,000
持田製薬	9,700	3,870.000	37,539,000
参天製薬	141,100	1,305.000	184,135,500
扶桑薬品工業	3,600	2,353.000	8,470,800
日本ケミファ	2,500	2,178.000	5,445,000
ツムラ	23,500	3,250.000	76,375,000
日医工	25,100	858.000	21,535,800
キッセイ薬品工業	13,300	2,436.000	32,398,800
生化学工業	13,400	903.000	12,100,200
栄研化学	13,300	1,756.000	23,354,800
鳥居薬品	4,300	2,984.000	12,831,200
JCRファーマ	21,800	2,160.000	47,088,000
東和薬品	10,700	3,120.000	33,384,000
富士製薬工業	6,800	1,023.000	6,956,400
ゼリア新薬工業	13,800	1,976.000	27,268,800
第一三共	595,600	2,547.500	1,517,291,000
キョーリン製薬ホールディングス	15,000	1,852.000	27,780,000
大幸薬品	13,400	661.000	8,857,400
ダイト	5,100	2,946.000	15,024,600
大塚ホールディングス	157,400	4,053.000	637,942,200
大正製薬ホールディングス	17,900	5,790.000	103,641,000
ペプチドリーム	40,200	2,065.000	83,013,000
あすか製薬ホールディングス	9,500	1,078.000	10,241,000
サワイグループホールディングス	16,600	4,530.000	75,198,000
日本コークス工業	75,000	137.000	10,275,000
ニチレキ	10,500	1,314.000	13,797,000
ユシロ化学工業	7,200	1,066.000	7,675,200
MORESCO	5,800	1,154.000	6,693,200
出光興産	83,800	3,050.000	255,590,000
ENEOSホールディングス	1,140,100	452.200	515,553,220
コスモエネルギーホールディングス	22,100	2,515.000	55,581,500
横浜ゴム	43,300	1,773.000	76,770,900

TOYO TIRE	40,100	1,617.000	64,841,700
ブリヂストン	218,000	5,134.000	1,119,212,000
住友ゴム工業	67,800	1,174.000	79,597,200
藤倉コンポジット	7,400	699.000	5,172,600
オカモト	4,600	4,085.000	18,791,000
ニッタ	7,600	2,752.000	20,915,200
住友理工	16,600	602.000	9,993,200
三ツ星ベルト	9,300	2,097.000	19,502,100
バンドー化学	13,000	859.000	11,167,000
日東紡績	11,700	3,230.000	37,791,000
A G C	69,900	5,590.000	390,741,000
日本板硝子	16,900	515.000	8,703,500
日本電気硝子	30,700	2,876.000	88,293,200
オハラ	4,300	1,163.000	5,000,900
住友大阪セメント	14,400	3,555.000	51,192,000
太平洋セメント	43,300	2,336.000	101,148,800
日本ヒューム	12,500	699.000	8,737,500
日本コンクリート工業	22,900	300.000	6,870,000
三谷セキサン	3,600	6,450.000	23,220,000
アジアパイルホールディングス	17,100	440.000	7,524,000
東海カーボン	63,900	1,188.000	75,913,200
日本カーボン	4,000	4,210.000	16,840,000
東洋炭素	5,100	3,170.000	16,167,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	4,510.000	19,844,000
TOTO	54,200	5,030.000	272,626,000
日本碍子	81,700	1,870.000	152,779,000
日本特殊陶業	57,700	2,151.000	124,112,700
MARUWA	2,600	14,340.000	37,284,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,890.000	7,780,000
黒崎播磨	1,600	4,350.000	6,960,000
ヨータイ	5,400	1,254.000	6,771,600
東京窯業	15,300	306.000	4,681,800
フジインコーポレーテッド	6,100	6,650.000	40,565,000
ニチアス	17,500	2,646.000	46,305,000
ニチハ	10,700	2,627.000	28,108,900
日本製鉄	334,900	2,041.000	683,530,900
神戸製鋼所	138,500	614.000	85,039,000
中山製鋼所	14,900	465.000	6,928,500
合同製鉄	5,500	1,365.000	7,507,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	201,500	1,675.000	337,512,500
東京製鉄	25,700	1,160.000	29,812,000
共英製鋼	9,100	1,643.000	14,951,300
大和工業	14,500	3,700.000	53,650,000
東京製鋼	4,900	1,377.000	6,747,300
大阪製鉄	4,700	1,215.000	5,710,500
淀川製鋼所	9,600	2,780.000	26,688,000
丸一鋼管	26,300	2,985.000	78,505,500
モリ工業	2,700	2,524.000	6,814,800

大同特殊鋼	12,300	4,270.000	52,521,000
日本冶金工業	5,700	2,881.000	16,421,700
山陽特殊製鋼	7,900	2,158.000	17,048,200
愛知製鋼	4,800	2,603.000	12,494,400
日立金属	80,200	2,090.000	167,618,000
大平洋金属	4,900	3,315.000	16,243,500
新日本電工	49,600	347.000	17,211,200
栗本鐵工所	5,000	1,547.000	7,735,000
三菱製鋼	6,300	1,247.000	7,856,100
日本精線	1,500	4,425.000	6,637,500
エンビプロ・ホールディングス	2,900	1,311.000	3,801,900
大紀アルミニウム工業所	11,200	1,665.000	18,648,000
日本軽金属ホールディングス	19,000	1,850.000	35,150,000
三井金属鉱業	20,000	3,405.000	68,100,000
東邦亜鉛	4,600	2,721.000	12,516,600
三菱マテリアル	49,100	2,116.000	103,895,600
住友金属鉱山	95,800	5,362.000	513,679,600
D O W Aホールディングス	20,300	4,945.000	100,383,500
古河機械金属	12,400	1,302.000	16,144,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	883.000	9,713,000
東邦チタニウム	14,400	913.000	13,147,200
U A C J	11,200	2,361.000	26,443,200
C Kサンエツ	1,900	4,015.000	7,628,500
古河電気工業	23,500	2,410.000	56,635,000
住友電気工業	280,200	1,589.500	445,377,900
フジクラ	84,100	666.000	56,010,600
昭和電線ホールディングス	6,900	1,864.000	12,861,600
タツタ電線	15,600	454.000	7,082,400
平河ヒューテック	5,400	1,165.000	6,291,000
リョービ	10,200	1,131.000	11,536,200
アサヒホールディングス	30,000	2,194.000	65,820,000
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,525.000	9,517,500
トーカロ	19,300	1,329.000	25,649,700
アルファ	4,900	1,091.000	5,345,900
S U M C O	115,400	2,066.000	238,416,400
川田テクノロジーズ	2,100	3,810.000	8,001,000
R S T E C H N O L O G I E S	2,500	5,500.000	13,750,000
東洋製罐グループホールディングス	48,300	1,610.000	77,763,000
ホッカンホールディングス	5,700	1,401.000	7,985,700
横河ブリッジホールディングス	12,700	2,088.000	26,517,600
駒井ハルテック	2,100	2,108.000	4,426,800
三和ホールディングス	70,700	1,290.000	91,203,000
文化シャッター	23,500	1,059.000	24,886,500
三協立山	12,000	627.000	7,524,000
アルインコ	8,000	910.000	7,280,000
L I X I L	118,000	2,607.000	307,626,000
ノーリツ	14,500	1,608.000	23,316,000
長府製作所	7,400	1,993.000	14,748,200

リンナイ	14,100	9,850.000	138,885,000
日東精工	13,000	516.000	6,708,000
岡部	17,100	732.000	12,517,200
ジーテクト	9,300	1,452.000	13,503,600
東プレ	14,200	1,249.000	17,735,800
高周波熱錬	15,700	605.000	9,498,500
東京製綱	6,500	862.000	5,603,000
サンコール	8,400	499.000	4,191,600
パイオラックス	11,000	1,759.000	19,349,000
エイチワン	10,100	666.000	6,726,600
日本発条	68,900	900.000	62,010,000
立川ブラインド工業	5,000	1,082.000	5,410,000
三益半導体工業	5,800	2,374.000	13,769,200
日本製鋼所	22,900	3,610.000	82,669,000
三浦工業	32,500	3,220.000	104,650,000
タクマ	25,300	1,468.000	37,140,400
ツガミ	17,400	1,288.000	22,411,200
オークマ	8,700	4,815.000	41,890,500
芝浦機械	8,600	3,040.000	26,144,000
アマダ	117,900	1,052.000	124,030,800
アイダエンジニアリング	19,700	998.000	19,660,600
F U J I	34,200	2,360.000	80,712,000
牧野フライス製作所	8,100	3,715.000	30,091,500
オーエスジー	34,900	1,995.000	69,625,500
旭ダイヤモンド工業	20,900	582.000	12,163,800
D M G 森精機	44,500	1,745.000	77,652,500
ソディック	17,300	774.000	13,390,200
ディスコ	11,000	33,850.000	372,350,000
日東工器	4,900	1,617.000	7,923,300
日進工具	6,500	1,423.000	9,249,500
島精機製作所	11,400	1,830.000	20,862,000
オプトラン	9,700	1,985.000	19,254,500
N C ホールディングス	3,000	1,862.000	5,586,000
フリュー	7,400	1,034.000	7,651,600
ヤマシンフィルタ	17,800	361.000	6,425,800
日阪製作所	11,300	821.000	9,277,300
やまびこ	14,400	1,315.000	18,936,000
野村マイクロ・サイエンス	2,200	3,720.000	8,184,000
平田機工	3,600	5,400.000	19,440,000
マルマエ	3,500	2,406.000	8,421,000
タツモ	4,500	1,595.000	7,177,500
ナブテスコ	42,600	3,265.000	139,089,000
三井海洋開発	8,800	1,176.000	10,348,800
レオン自動機	8,900	1,048.000	9,327,200
S M C	22,200	67,630.000	1,501,386,000
ホソカワミクロン	5,300	2,734.000	14,490,200
ユニオンツール	3,000	3,620.000	10,860,000
オイレス工業	10,400	1,569.000	16,317,600

日精エー・エス・ビー機械	2,900	2,907.000	8,430,300
サトーホールディングス	10,100	1,999.000	20,189,900
技研製作所	6,700	3,730.000	24,991,000
日本エアーテック	4,900	1,007.000	4,934,300
日精樹脂工業	6,900	1,019.000	7,031,100
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,086.000	4,235,400
小松製作所	343,500	2,737.500	940,331,250
住友重機械工業	43,100	2,919.000	125,808,900
日立建機	30,400	2,949.000	89,649,600
日工	14,300	623.000	8,908,900
巴工業	3,700	2,300.000	8,510,000
井関農機	7,900	1,253.000	9,898,700
TOWA	6,700	2,295.000	15,376,500
北川鉄工所	4,800	1,363.000	6,542,400
ローツェ	3,700	10,950.000	40,515,000
クボタ	367,200	2,102.500	772,038,000
荏原実業	4,000	2,155.000	8,620,000
三菱化工機	3,000	2,017.000	6,051,000
月島機械	14,300	1,044.000	14,929,200
帝国電機製作所	6,200	1,414.000	8,766,800
新東工業	18,900	702.000	13,267,800
澁谷工業	6,700	2,523.000	16,904,100
アイチコーポレーション	12,200	863.000	10,528,600
小森コーポレーション	21,000	750.000	15,750,000
鶴見製作所	6,600	1,773.000	11,701,800
荏原製作所	31,400	5,700.000	178,980,000
西島製作所	10,000	965.000	9,650,000
北越工業	9,100	888.000	8,080,800
ダイキン工業	96,500	21,745.000	2,098,392,500
オルガノ	2,100	7,730.000	16,233,000
トーヨーカネツ	3,500	2,406.000	8,421,000
栗田工業	41,000	4,670.000	191,470,000
椿本チエイン	9,600	3,315.000	31,824,000
大同工業	5,300	924.000	4,897,200
木村化工機	7,500	789.000	5,917,500
アネスト岩田	13,800	817.000	11,274,600
ダイフク	41,800	8,550.000	357,390,000
サムコ	2,400	2,314.000	5,553,600
タダノ	40,500	1,003.000	40,621,500
フジテック	28,200	2,658.000	74,955,600
CKD	22,300	2,029.000	45,246,700
キトー	7,200	1,690.000	12,168,000
平和	21,500	1,942.000	41,753,000
理想科学工業	6,700	2,213.000	14,827,100
SANKYO	16,700	3,240.000	54,108,000
日本金銭機械	10,800	655.000	7,074,000
マースグループホールディングス	6,200	1,634.000	10,130,800
フクシマガリレイ	5,300	3,890.000	20,617,000

ダイコク電機	5,600	1,248.000	6,988,800
竹内製作所	11,400	2,610.000	29,754,000
アマノ	19,900	2,261.000	44,993,900
JUKI	11,800	696.000	8,212,800
ジャノメ	8,100	722.000	5,848,200
マックス	10,300	1,723.000	17,746,900
グローリー	19,800	2,118.000	41,936,400
新晃工業	7,300	1,739.000	12,694,700
大和冷機工業	11,000	1,135.000	12,485,000
セガサミーホールディングス	75,400	2,162.000	163,014,800
日本ピストンリング	4,400	1,380.000	6,072,000
リケン	3,800	2,602.000	9,887,600
T P R	10,200	1,433.000	14,616,600
ツバキ・ナカシマ	17,100	1,026.000	17,544,600
ホシザキ	22,100	8,010.000	177,021,000
大豊工業	8,200	719.000	5,895,800
日本精工	141,900	748.000	106,141,200
NTN	163,200	231.000	37,699,200
ジェイテクト	72,100	1,041.000	75,056,100
不二越	6,300	4,200.000	26,460,000
日本トムソン	22,100	552.000	12,199,200
THK	42,900	2,706.000	116,087,400
ユーシン精機	9,000	694.000	6,246,000
前澤給装工業	7,500	989.000	7,417,500
イーグル工業	10,500	1,063.000	11,161,500
日本ビラー工業	7,700	2,862.000	22,037,400
キッツ	26,500	678.000	17,967,000
マキタ	92,400	4,162.000	384,568,800
日立造船	64,500	787.000	50,761,500
三菱重工業	119,000	3,318.000	394,842,000
I H I	47,300	2,664.000	126,007,200
スター精密	11,800	1,501.000	17,711,800
日清紡ホールディングス	46,900	1,040.000	48,776,000
イビデン	39,700	5,700.000	226,290,000
コニカミノルタ	166,700	503.000	83,850,100
ブラザー工業	92,200	2,103.000	193,896,600
ミネベアミツミ	130,000	2,545.000	330,850,000
日立製作所	364,500	6,123.000	2,231,833,500
東芝	132,300	4,579.000	605,801,700
三菱電機	757,500	1,446.000	1,095,345,000
富士電機	45,600	6,100.000	278,160,000
安川電機	81,400	4,740.000	385,836,000
シンフォニア テクノロジー	10,400	1,313.000	13,655,200
明電舎	13,100	2,390.000	31,309,000
オリジン	4,400	1,239.000	5,451,600
山洋電気	3,500	4,965.000	17,377,500
デンヨー	7,300	1,744.000	12,731,200
PHCホールディングス	8,800	1,553.000	13,666,400

東芝テック	8,200	4,980.000	40,836,000
芝浦メカトロニクス	1,400	7,880.000	11,032,000
マブチモーター	17,600	4,105.000	72,248,000
日本電産	196,500	10,060.000	1,976,790,000
トレックス・セミコンダクター	4,200	2,546.000	10,693,200
東光高岳	5,200	1,436.000	7,467,200
ダイヘン	8,200	4,120.000	33,784,000
ヤーマン	13,500	923.000	12,460,500
JVCケンウッド	67,700	188.000	12,727,600
ミマキエンジニアリング	9,000	738.000	6,642,000
I - P E X	4,300	1,508.000	6,484,400
日新電機	17,800	1,452.000	25,845,600
大崎電気工業	19,000	485.000	9,215,000
オムロン	63,100	8,006.000	505,178,600
日東工業	9,900	1,615.000	15,988,500
I D E C	9,800	2,412.000	23,637,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,100	2,416.000	60,641,600
メルコホールディングス	2,000	3,845.000	7,690,000
日本電気	96,200	5,120.000	492,544,000
富士通	68,200	16,380.000	1,117,116,000
沖電気工業	31,300	913.000	28,576,900
電気興業	4,700	2,401.000	11,284,700
サンケン電気	7,300	5,230.000	38,179,000
アイホン	4,700	2,132.000	10,020,400
ルネサスエレクトロニクス	411,700	1,422.000	585,437,400
セイコーエプソン	94,000	1,833.000	172,302,000
ワコム	58,800	845.000	49,686,000
アルバック	15,200	5,980.000	90,896,000
アクセル	4,100	1,136.000	4,657,600
E I Z O	6,000	3,680.000	22,080,000
日本信号	20,100	885.000	17,788,500
京三製作所	19,300	428.000	8,260,400
能美防災	10,200	2,024.000	20,644,800
ホーチキ	6,500	1,228.000	7,982,000
エレコム	17,500	1,535.000	26,862,500
パナソニック	808,600	1,233.000	997,003,800
シャープ	86,300	1,314.000	113,398,200
アンリツ	49,000	1,625.000	79,625,000
富士通ゼネラル	20,900	2,581.000	53,942,900
ソニーグループ	474,800	12,075.000	5,733,210,000
T D K	109,700	4,735.000	519,429,500
帝国通信工業	5,000	1,388.000	6,940,000
タムラ製作所	30,100	611.000	18,391,100
アルプスアルパイン	68,400	1,225.000	83,790,000
日本電波工業	7,700	1,176.000	9,055,200
メイコー	6,200	3,920.000	24,304,000
日本トリム	2,100	2,700.000	5,670,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	2,855.000	13,704,000

フォスター電機	10,300	798.000	8,219,400
S M K	2,600	2,173.000	5,649,800
ヨコオ	5,700	2,763.000	15,749,100
ホシデン	18,300	1,183.000	21,648,900
ヒロセ電機	11,700	17,200.000	201,240,000
日本航空電子工業	17,500	1,826.000	31,955,000
T O A	9,800	781.000	7,653,800
マクセル	15,400	1,214.000	18,695,600
古野電気	9,900	1,045.000	10,345,500
ユニデンホールディングス	2,200	3,420.000	7,524,000
スミダコーポレーション	8,100	862.000	6,982,200
アイコム	3,500	2,380.000	8,330,000
リオン	3,600	2,111.000	7,599,600
横河電機	75,900	1,850.000	140,415,000
新電元工業	3,200	3,010.000	9,632,000
アズビル	44,400	4,130.000	183,372,000
東亜ディーケーケー	5,400	919.000	4,962,600
日本光電工業	31,500	3,150.000	99,225,000
共和電業	16,200	381.000	6,172,200
日本電子材料	4,000	2,049.000	8,196,000
堀場製作所	14,100	6,680.000	94,188,000
アドバンテスト	56,300	9,560.000	538,228,000
エスペック	6,500	2,043.000	13,279,500
キーエンス	68,700	53,970.000	3,707,739,000
日置電機	3,700	6,600.000	24,420,000
シスメックス	64,100	8,619.000	552,477,900
日本マイクロニクス	13,500	1,736.000	23,436,000
メガチップス	7,200	3,850.000	27,720,000
O B A R A G R O U P	3,800	3,160.000	12,008,000
コーセル	11,000	820.000	9,020,000
イリソ電子工業	6,600	4,180.000	27,588,000
オプテックスグループ	12,900	1,637.000	21,117,300
千代田インテグレ	4,200	1,911.000	8,026,200
レーザーテック	33,300	21,455.000	714,451,500
スタンレー電気	52,700	2,887.000	152,144,900
岩崎電気	3,600	2,283.000	8,218,800
ウシオ電機	39,200	1,874.000	73,460,800
日本セラミック	7,400	2,448.000	18,115,200
遠藤照明	5,300	1,040.000	5,512,000
古河電池	6,000	1,253.000	7,518,000
山一電機	6,100	1,989.000	12,132,900
図研	5,200	3,025.000	15,730,000
日本電子	15,800	6,670.000	105,386,000
カシオ計算機	55,200	1,329.000	73,360,800
ファナック	66,500	21,460.000	1,427,090,000
日本シイエムケイ	17,100	614.000	10,499,400
エンプラス	2,400	2,615.000	6,276,000
大真空	11,000	1,134.000	12,474,000

ローム	33,900	9,430.000	319,677,000
浜松ホトニクス	54,200	5,670.000	307,314,000
三井ハイテック	7,400	8,100.000	59,940,000
新光電気工業	22,200	4,890.000	108,558,000
京セラ	106,600	6,857.000	730,956,200
太陽誘電	36,700	5,190.000	190,473,000
村田製作所	222,600	7,981.000	1,776,570,600
双葉電子工業	15,900	678.000	10,780,200
北陸電気工業	4,700	1,325.000	6,227,500
ニチコン	24,200	1,250.000	30,250,000
日本ケミコン	7,700	1,919.000	14,776,300
K O A	11,800	1,451.000	17,121,800
市光工業	11,300	522.000	5,898,600
小糸製作所	41,400	6,410.000	265,374,000
ミツバ	16,500	400.000	6,600,000
S C R E E Nホールディングス	13,200	11,780.000	155,496,000
キヤノン電子	7,800	1,604.000	12,511,200
キヤノン	376,800	2,832.500	1,067,286,000
リコー	210,500	1,042.000	219,341,000
象印マホービン	20,700	1,437.000	29,745,900
東京エレクトロン	48,100	56,810.000	2,732,561,000
トヨタ紡織	30,800	2,159.000	66,497,200
ユニプレス	12,900	813.000	10,487,700
豊田自動織機	61,100	9,160.000	559,676,000
モリタホールディングス	13,100	1,259.000	16,492,900
三櫻工業	11,300	710.000	8,023,000
デンソー	166,800	8,516.000	1,420,468,800
東海理化電機製作所	19,300	1,576.000	30,416,800
川崎重工業	55,300	2,116.000	117,014,800
日本車輛製造	3,600	2,080.000	7,488,000
三菱ロジスネクスト	10,600	965.000	10,229,000
日産自動車	894,300	615.000	549,994,500
いすゞ自動車	237,400	1,598.000	379,365,200
トヨタ自動車	3,839,000	2,184.000	8,384,376,000
日野自動車	94,700	1,085.000	102,749,500
三菱自動車工業	281,300	335.000	94,235,500
武蔵精密工業	17,100	1,915.000	32,746,500
日産車体	12,700	677.000	8,597,900
新明和工業	21,400	934.000	19,987,600
極東開発工業	14,100	1,498.000	21,121,800
トピー工業	8,300	1,132.000	9,395,600
ティラド	2,600	2,565.000	6,669,000
曙ブレーキ工業	49,200	172.000	8,462,400
タチエス	13,900	1,163.000	16,165,700
N O K	37,200	1,251.000	46,537,200
フタバ産業	21,300	405.000	8,626,500
K Y B	7,800	3,075.000	23,985,000
大同メタル工業	18,700	638.000	11,930,600

プレス工業	39,700	386.000	15,324,200
ミクニ	11,600	417.000	4,837,200
太平洋工業	16,300	1,036.000	16,886,800
アイシン	55,200	4,385.000	242,052,000
マツダ	237,900	933.000	221,960,700
本田技研工業	596,400	3,687.000	2,198,926,800
スズキ	173,400	4,787.000	830,065,800
S U B A R U	217,900	1,968.500	428,936,150
安永	5,900	839.000	4,950,100
ヤマハ発動機	98,700	2,718.000	268,266,600
T B K	14,500	406.000	5,887,000
エクセディ	11,400	1,701.000	19,391,400
豊田合成	24,300	2,294.000	55,744,200
愛三工業	13,700	745.000	10,206,500
ヨロズ	8,900	984.000	8,757,600
エフ・シー・シー	12,300	1,453.000	17,871,900
シマノ	30,500	26,860.000	819,230,000
テイ・エス テック	31,800	1,587.000	50,466,600
ジャムコ	5,500	819.000	4,504,500
テルモ	214,500	3,712.000	796,224,000
日機装	23,200	791.000	18,351,200
日本エム・ディ・エム	5,100	1,593.000	8,124,300
島津製作所	97,200	4,100.000	398,520,000
J M S	8,600	622.000	5,349,200
長野計器	6,100	1,302.000	7,942,200
ブイ・テクノロジー	3,500	3,535.000	12,372,500
東京計器	6,800	1,037.000	7,051,600
インターアクション	4,100	2,013.000	8,253,300
東京精密	12,700	4,800.000	60,960,000
マニー	30,700	1,617.000	49,641,900
ニコン	116,000	1,307.000	151,612,000
トプコン	36,300	1,507.000	54,704,100
オリンパス	397,700	2,296.500	913,318,050
理研計器	6,100	4,645.000	28,334,500
タムロン	5,900	2,340.000	13,806,000
H O Y A	147,900	15,155.000	2,241,424,500
ノーリツ鋼機	7,100	1,848.000	13,120,800
エー・アンド・デイ	7,600	928.000	7,052,800
朝日インテック	83,300	2,348.000	195,588,400
シチズン時計	88,400	506.000	44,730,400
リズム	3,800	1,438.000	5,464,400
メニコン	25,200	2,938.000	74,037,600
松風	3,800	1,822.000	6,923,600
セイコーホールディングス	10,700	2,334.000	24,973,800
ニプロ	57,400	1,110.000	63,714,000
スノーピーク	9,900	2,521.000	24,957,900
パラマウントベッドホールディングス	14,700	1,980.000	29,106,000
トランザクション	5,700	996.000	5,677,200

ニホンフラッシュ	7,600	1,055.000	8,018,000
前田工織	8,400	3,205.000	26,922,000
永大産業	20,600	305.000	6,283,000
アートネイチャー	9,300	730.000	6,789,000
バンダイナムコホールディングス	67,700	7,848.000	531,309,600
SHOEI	7,200	4,550.000	32,760,000
フランスベッドホールディングス	12,700	918.000	11,658,600
パイロットコーポレーション	13,100	4,615.000	60,456,500
萩原工業	6,600	1,229.000	8,111,400
フジシールインターナショナル	18,500	1,772.000	32,782,000
タカラトミー	31,500	1,283.000	40,414,500
広済堂ホールディングス	6,500	856.000	5,564,000
プロネクサス	7,800	1,087.000	8,478,600
大建工業	4,900	2,302.000	11,279,800
凸版印刷	114,600	2,282.000	261,517,200
大日本印刷	89,200	2,944.000	262,604,800
共同印刷	3,000	2,784.000	8,352,000
NISSHA	15,900	1,378.000	21,910,200
TAKARA & COMPANY	5,300	1,847.000	9,789,100
アシックス	67,300	2,242.000	150,886,600
ローランド	5,500	4,155.000	22,852,500
ヤマハ	44,000	5,470.000	240,680,000
河合楽器製作所	2,500	2,991.000	7,477,500
ピジョン	45,600	2,303.000	105,016,800
キングジム	9,100	888.000	8,080,800
リンテック	16,300	2,626.000	42,803,800
イトーキ	20,200	360.000	7,272,000
任天堂	42,800	59,480.000	2,545,744,000
三菱鉛筆	12,700	1,256.000	15,951,200
タカラスタンダード	15,700	1,360.000	21,352,000
コクヨ	36,400	1,598.000	58,167,200
ナカバヤシ	11,400	508.000	5,791,200
グロープライド	6,900	2,731.000	18,843,900
オカムラ	26,300	1,168.000	30,718,400
美津濃	7,800	2,287.000	17,838,600
東京電力ホールディングス	567,900	371.000	210,690,900
中部電力	229,600	1,131.000	259,677,600
関西電力	286,100	1,164.000	333,020,400
中国電力	118,400	901.000	106,678,400
北陸電力	72,100	560.000	40,376,000
東北電力	175,000	739.000	129,325,000
四国電力	69,300	808.000	55,994,400
九州電力	153,500	847.000	130,014,500
北海道電力	67,700	507.000	34,323,900
沖縄電力	16,300	1,409.000	22,966,700
電源開発	64,400	1,880.000	121,072,000
エフオン	7,600	534.000	4,058,400
イーレックス	11,600	1,679.000	19,476,400

レノバ	15,000	1,368.000	20,520,000
東京瓦斯	144,800	2,303.000	333,474,400
大阪瓦斯	136,100	2,100.000	285,810,000
東邦瓦斯	34,900	3,010.000	105,049,000
北海道瓦斯	5,600	1,516.000	8,489,600
広島ガス	20,900	351.000	7,335,900
西部ガスホールディングス	8,700	2,227.000	19,374,900
静岡ガス	19,700	851.000	16,764,700
メタウォーター	8,500	2,054.000	17,459,000
SBSホールディングス	5,500	2,947.000	16,208,500
東武鉄道	73,100	2,971.000	217,180,100
相鉄ホールディングス	24,600	2,286.000	56,235,600
東急	189,900	1,605.000	304,789,500
京浜急行電鉄	97,000	1,284.000	124,548,000
小田急電鉄	112,000	2,192.000	245,504,000
京王電鉄	39,100	5,360.000	209,576,000
京成電鉄	52,700	3,480.000	183,396,000
富士急行	9,200	4,180.000	38,456,000
新京成電鉄	3,600	2,021.000	7,275,600
東日本旅客鉄道	133,500	7,269.000	970,411,500
西日本旅客鉄道	92,300	5,185.000	478,575,500
東海旅客鉄道	63,100	16,350.000	1,031,685,000
西武ホールディングス	99,500	1,262.000	125,569,000
鴻池運輸	12,300	1,180.000	14,514,000
西日本鉄道	21,100	2,734.000	57,687,400
ハマキョウレックス	5,400	2,906.000	15,692,400
サカイ引越センター	3,400	4,530.000	15,402,000
近鉄グループホールディングス	71,100	3,665.000	260,581,500
阪急阪神ホールディングス	89,000	3,565.000	317,285,000
南海電気鉄道	32,400	2,419.000	78,375,600
京阪ホールディングス	32,000	3,125.000	100,000,000
神戸電鉄	2,800	3,400.000	9,520,000
名古屋鉄道	58,900	2,167.000	127,636,300
山陽電気鉄道	6,700	1,996.000	13,373,200
アルプス物流	2,000	1,048.000	2,096,000
ヤマトホールディングス	100,400	2,193.000	220,177,200
山九	18,900	4,025.000	76,072,500
丸全昭和運輸	6,000	3,210.000	19,260,000
センコーグループホールディングス	35,000	933.000	32,655,000
トナミホールディングス	2,000	3,790.000	7,580,000
ニッコンホールディングス	24,300	2,167.000	52,658,100
福山通運	11,600	4,050.000	46,980,000
セイノーホールディングス	48,400	1,215.000	58,806,000
神奈川中央交通	2,600	3,555.000	9,243,000
日立物流	14,000	5,840.000	81,760,000
丸和運輸機関	15,200	1,071.000	16,279,200
C & F ロジホールディングス	7,800	1,246.000	9,718,800
九州旅客鉄道	55,900	2,626.000	146,793,400

S Gホールディングス	135,500	2,532.000	343,086,000
N I P P O N E X P R E S Sホール ディングス	24,600	7,350.000	180,810,000
日本郵船	59,700	10,280.000	613,716,000
商船三井	39,600	9,400.000	372,240,000
川崎汽船	22,100	7,800.000	172,380,000
N Sユナイテッド海運	4,100	4,165.000	17,076,500
明治海運	10,400	953.000	9,911,200
飯野海運	35,200	855.000	30,096,000
乾汽船	5,500	2,813.000	15,471,500
日本航空	164,300	2,365.000	388,569,500
A N Aホールディングス	183,800	2,630.000	483,394,000
トランコム	2,100	7,290.000	15,309,000
日新	6,400	1,722.000	11,020,800
三菱倉庫	22,900	2,800.000	64,120,000
三井倉庫ホールディングス	7,600	2,328.000	17,692,800
住友倉庫	24,600	2,138.000	52,594,800
澁澤倉庫	4,800	2,217.000	10,641,600
東陽倉庫	21,100	320.000	6,752,000
日本トランスシティ	17,000	632.000	10,744,000
川西倉庫	3,500	1,151.000	4,028,500
安田倉庫	7,600	975.000	7,410,000
東洋埠頭	5,400	1,519.000	8,202,600
上組	38,600	2,207.000	85,190,200
近鉄エクスプレス	13,300	2,931.000	38,982,300
エーアイティー	5,500	1,416.000	7,788,000
内外トランスライン	3,500	1,906.000	6,671,000
日本コンセプト	3,600	1,501.000	5,403,600
N E C ネットエスアイ	24,200	1,722.000	41,672,400
クロスキャット	2,700	1,773.000	4,787,100
システナ	105,700	387.000	40,905,900
デジタルアーツ	4,100	6,220.000	25,502,000
日鉄ソリューションズ	10,500	3,570.000	37,485,000
コア	4,100	1,540.000	6,314,000
ラクーンホールディングス	7,300	1,134.000	8,278,200
ソリトンシステムズ	4,900	1,523.000	7,462,700
ソフトクリエイイトホールディングス	3,500	4,115.000	14,402,500
T I S	70,700	2,620.000	185,234,000
グリー	34,900	815.000	28,443,500
コーエーテクモホールディングス	23,800	4,010.000	95,438,000
三菱総合研究所	3,100	3,700.000	11,470,000
ファインデックス	8,000	704.000	5,632,000
ブレインパッド	7,100	1,097.000	7,788,700
K L a b	16,500	406.000	6,699,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホール ディングス	11,800	1,020.000	12,036,000
ネクソン	168,100	2,445.000	411,004,500
エムアップホールディングス	9,400	878.000	8,253,200

エイチーム	6,700	726.000	4,864,200
エニグモ	9,500	675.000	6,412,500
コロプラ	25,300	636.000	16,090,800
ブロードリーフ	38,900	333.000	12,953,700
デジタルハーツホールディングス	4,200	1,518.000	6,375,600
システム情報	6,700	1,012.000	6,780,400
メディアドゥ	2,900	2,504.000	7,261,600
じげん	26,100	298.000	7,777,800
ブイキューブ	5,800	753.000	4,367,400
フィックスターズ	10,400	703.000	7,311,200
CARTA HOLDINGS	3,700	2,368.000	8,761,600
オプティム	6,700	880.000	5,896,000
セレス	3,300	1,375.000	4,537,500
SHIFT	3,800	19,830.000	75,354,000
ティーガイア	7,000	1,728.000	12,096,000
テクマトリックス	13,000	1,568.000	20,384,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,800	2,804.000	55,519,200
GMOペイメントゲートウェイ	14,500	10,200.000	147,900,000
システムリサーチ	3,100	1,811.000	5,614,100
インターネットイニシアティブ	19,900	3,395.000	67,560,500
さくらインターネット	10,300	524.000	5,397,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	3,990.000	7,581,000
SRAホールディングス	4,200	2,884.000	12,112,800
eBASE	11,200	612.000	6,854,400
アバント	8,700	1,034.000	8,995,800
アドソル日進	3,800	1,608.000	6,110,400
フリービット	5,700	897.000	5,112,900
コムチュア	8,300	2,794.000	23,190,200
アステリア	6,500	727.000	4,725,500
アイル	4,600	1,303.000	5,993,800
マークライنز	4,300	2,643.000	11,364,900
メディカル・データ・ビジョン	10,500	1,017.000	10,678,500
gumi	12,200	560.000	6,832,000
テラスカイ	3,500	1,428.000	4,998,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,266.000	5,570,400
PCIホールディングス	4,900	945.000	4,630,500
パイブドHD	1,900	2,609.000	4,957,100
PR TIMES	1,800	2,942.000	5,295,600
ラクス	25,800	1,736.000	44,788,800
ダブルスタンダード	2,700	1,848.000	4,989,600
オープンドア	5,100	2,049.000	10,449,900
アカツキ	3,500	2,820.000	9,870,000
UBICOMホールディングス	2,500	1,995.000	4,987,500
カナミックネットワーク	12,100	446.000	5,396,600
チェンジ	13,800	1,688.000	23,294,400

オークネット	5,000	1,512.000	7,560,000
マクロミル	17,200	1,210.000	20,812,000
オロ	2,800	2,381.000	6,666,800
ユーザーローカル	3,400	1,545.000	5,253,000
マネーフォワード	11,500	4,575.000	52,612,500
電算システムホールディングス	3,300	2,753.000	9,084,900
プロトコーポレーション	8,800	1,264.000	11,123,200
野村総合研究所	143,400	3,840.000	550,656,000
日本システム技術	1,900	2,129.000	4,045,100
インテージホールディングス	9,200	1,750.000	16,100,000
ソースネクスト	39,100	153.000	5,982,300
インフォコム	8,400	2,024.000	17,001,600
シンプレクス・ホールディングス	8,700	1,594.000	13,867,800
HEROZ	2,600	905.000	2,353,000
ラクスル	8,400	3,130.000	26,292,000
I P S	2,700	1,957.000	5,283,900
イーソル	6,700	492.000	3,296,400
アルテリア・ネットワークス	10,100	1,310.000	13,231,000
ウイングアーク1st	5,200	1,247.000	6,484,400
サーバーワークス	1,600	2,335.000	3,736,000
Sansan	27,200	1,024.000	27,852,800
ギフティ	7,900	885.000	6,991,500
ベース	1,600	4,875.000	7,800,000
JMDC	7,100	5,720.000	40,612,000
フォーカスシステムズ	6,800	915.000	6,222,000
クレスコ	6,100	1,762.000	10,748,200
フジ・メディア・ホールディングス	71,700	1,272.000	91,202,400
オービック	23,400	18,110.000	423,774,000
ジャストシステム	10,600	5,350.000	56,710,000
TDCソフト	7,800	1,118.000	8,720,400
Zホールディングス	1,078,700	560.600	604,719,220
トレンドマイクロ	39,700	5,780.000	229,466,000
日本オラクル	12,200	8,140.000	99,308,000
アルファシステムズ	2,200	3,710.000	8,162,000
フューチャー	15,600	1,319.000	20,576,400
CAC HOLDINGS	5,400	1,300.000	7,020,000
S Bテクノロジー	3,700	2,531.000	9,364,700
オービックビジネスコンサルタント	7,100	4,215.000	29,926,500
伊藤忠テクノソリューションズ	33,800	2,942.000	99,439,600
アイティフォー	10,900	774.000	8,436,600
東計電算	900	4,880.000	4,392,000
大塚商会	40,100	4,310.000	172,831,000
サイボウズ	10,700	1,311.000	14,027,700
電通国際情報サービス	10,600	3,600.000	38,160,000
ACCESS	11,400	589.000	6,714,600
デジタルガレージ	12,400	3,975.000	49,290,000
イーエムシステムズ	14,800	710.000	10,508,000
ウェザーニューズ	2,600	7,550.000	19,630,000

CIJ	7,300	811.000	5,920,300
WOWOW	4,100	1,773.000	7,269,300
スカラ	9,600	670.000	6,432,000
IMAGICA GROUP	8,000	627.000	5,016,000
ネットワンシステムズ	28,400	2,778.000	78,895,200
アルゴグラフィックス	5,900	3,135.000	18,496,500
マーベラス	14,300	728.000	10,410,400
エイベックス	13,500	1,346.000	18,171,000
日本ユニシス	23,400	3,085.000	72,189,000
兼松エレクトロニクス	4,000	3,855.000	15,420,000
都築電気	4,500	1,383.000	6,223,500
TBSホールディングス	45,200	1,914.000	86,512,800
日本テレビホールディングス	61,800	1,344.000	83,059,200
朝日放送グループホールディングス	9,800	758.000	7,428,400
テレビ朝日ホールディングス	18,200	1,630.000	29,666,000
スカパーJ SATホールディングス	62,700	443.000	27,776,100
テレビ東京ホールディングス	5,900	2,149.000	12,679,100
ビジョン	13,600	1,178.000	16,020,800
USEN - NEXT HOLDINGS	7,200	2,351.000	16,927,200
コネクシオ	6,000	1,408.000	8,448,000
日本通信	62,000	177.000	10,974,000
日本電信電話	777,600	3,296.000	2,562,969,600
KDDI	542,100	3,779.000	2,048,595,900
ソフトバンク	1,126,400	1,444.500	1,627,084,800
光通信	8,600	14,360.000	123,496,000
エムティーアイ	10,700	480.000	5,136,000
GMOインターネット	26,600	2,505.000	66,633,000
ファイバーゲート	4,600	1,283.000	5,901,800
KADOKAWA	41,000	2,475.000	101,475,000
学研ホールディングス	11,100	998.000	11,077,800
ゼンリン	13,600	1,071.000	14,565,600
アイネット	5,700	1,280.000	7,296,000
松竹	5,000	11,990.000	59,950,000
東宝	43,800	4,775.000	209,145,000
東映	2,400	17,280.000	41,472,000
エヌ・ティ・ティ・データ	197,300	2,098.000	413,935,400
ピー・シー・エー	5,100	1,446.000	7,374,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	1,521.000	5,019,300
DTS	13,400	2,701.000	36,193,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	34,600	5,570.000	192,722,000
シーイーシー	9,000	1,092.000	9,828,000
カプコン	70,200	2,791.000	195,928,200
アイ・エス・ビー	4,700	975.000	4,582,500
ジャステック	5,900	1,048.000	6,183,200
SCSK	51,200	1,917.000	98,150,400
日本システムウエア	3,300	2,089.000	6,893,700
アイネス	7,800	1,529.000	11,926,200

TKC	12,400	3,085.000	38,254,000
富士ソフト	7,900	5,510.000	43,529,000
NSD	23,500	2,121.000	49,843,500
コナミホールディングス	27,000	6,760.000	182,520,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,050.000	11,895,000
JBCホールディングス	5,900	1,456.000	8,590,400
ミロク情報サービス	7,900	1,394.000	11,012,600
ソフトバンクグループ	446,100	5,184.000	2,312,582,400
高千穂交易	3,900	1,523.000	5,939,700
伊藤忠食品	2,100	5,020.000	10,542,000
エレマテック	7,200	1,077.000	7,754,400
あらた	5,800	3,915.000	22,707,000
トーメンデバイス	1,200	6,240.000	7,488,000
東京エレクトロン デバイス	2,300	5,330.000	12,259,000
フィールズ	10,000	635.000	6,350,000
双日	82,000	1,974.000	161,868,000
アルフレッサ ホールディングス	83,000	1,775.000	147,325,000
横浜冷凍	22,900	872.000	19,968,800
アルコニックス	10,000	1,343.000	13,430,000
神戸物産	58,000	3,810.000	220,980,000
あい ホールディングス	11,000	1,770.000	19,470,000
ダイワボウホールディングス	36,400	1,786.000	65,010,400
マクニカ・富士エレホールディングス	17,700	2,627.000	46,497,900
ラクト・ジャパン	3,200	2,035.000	6,512,000
グリムス	3,700	2,093.000	7,744,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,900	811.000	12,083,900
八洲電機	8,400	967.000	8,122,800
レスターホールディングス	7,100	1,975.000	14,022,500
ジューテックホールディングス	1,700	1,228.000	2,087,600
TOKAIホールディングス	35,600	906.000	32,253,600
三洋貿易	8,900	1,020.000	9,078,000
ビューティガレージ	1,600	3,255.000	5,208,000
ウイン・パートナーズ	6,000	1,057.000	6,342,000
シップヘルスケアホールディングス	24,200	2,365.000	57,233,000
コメダホールディングス	17,200	2,137.000	36,756,400
フルサト・マルカホールディングス	7,500	2,296.000	17,220,000
ヤマエグループホールディングス	6,200	1,056.000	6,547,200
小野建	7,700	1,621.000	12,481,700
佐鳥電機	6,400	918.000	5,875,200
伯東	4,800	2,343.000	11,246,400
コンドーテック	7,600	1,027.000	7,805,200
ナガイレーベン	10,400	2,127.000	22,120,800
三菱食品	6,800	3,145.000	21,386,000
松田産業	5,800	2,244.000	13,015,200
第一興商	14,400	3,620.000	52,128,000
メディパルホールディングス	80,100	2,102.000	168,370,200
SPK	5,300	1,319.000	6,990,700

萩原電気ホールディングス	3,700	2,077.000	7,684,900
アズワン	10,900	6,500.000	70,850,000
尾家産業	5,000	1,011.000	5,055,000
シモジマ	6,500	1,015.000	6,597,500
ドウシシャ	7,600	1,527.000	11,605,200
高速	5,500	1,571.000	8,640,500
丸文	8,600	718.000	6,174,800
ハピネット	7,100	1,590.000	11,289,000
日本ライフライン	22,900	1,041.000	23,838,900
タカショー	8,400	669.000	5,619,600
I D O M	23,800	659.000	15,684,200
進和	5,200	2,042.000	10,618,400
ダイترون	3,800	1,809.000	6,874,200
シークス	11,400	1,193.000	13,600,200
オーハシテクニカ	5,400	1,360.000	7,344,000
白銅	2,800	2,596.000	7,268,800
伊藤忠商事	521,700	3,844.000	2,005,414,800
丸紅	735,800	1,237.000	910,184,600
長瀬産業	40,600	1,869.000	75,881,400
蝶理	4,800	1,807.000	8,673,600
豊田通商	74,700	5,110.000	381,717,000
三共生興	13,500	570.000	7,695,000
兼松	26,900	1,394.000	37,498,600
三井物産	579,400	3,100.000	1,796,140,000
日本紙パルプ商事	4,000	4,125.000	16,500,000
カメイ	9,500	1,051.000	9,984,500
スターゼン	6,000	2,124.000	12,744,000
山善	30,100	1,024.000	30,822,400
椿本興業	1,800	4,105.000	7,389,000
住友商事	470,600	1,904.000	896,022,400
内田洋行	3,400	4,665.000	15,861,000
三菱商事	559,000	4,090.000	2,286,310,000
第一実業	3,600	4,375.000	15,750,000
キャノンマーケティングジャパン	18,800	2,465.000	46,342,000
西華産業	5,200	1,619.000	8,418,800
佐藤商事	7,100	1,203.000	8,541,300
菱洋エレクトロ	5,200	2,155.000	11,206,000
東京産業	8,500	702.000	5,967,000
ユアサ商事	6,900	2,994.000	20,658,600
神鋼商事	2,000	3,830.000	7,660,000
阪和興業	14,600	3,310.000	48,326,000
正栄食品工業	4,900	4,195.000	20,555,500
カナデン	7,900	1,012.000	7,994,800
菱電商事	6,800	1,785.000	12,138,000
岩谷産業	18,000	5,360.000	96,480,000
ナイス	3,100	1,854.000	5,747,400
極東貿易	2,700	2,311.000	6,239,700
アステナホールディングス	13,500	420.000	5,670,000

三愛石油	18,700	944.000	17,652,800
稲畑産業	15,500	2,437.000	37,773,500
G S Iクレオス	4,700	1,138.000	5,348,600
明和産業	7,500	1,116.000	8,370,000
ワキタ	16,600	1,012.000	16,799,200
東邦ホールディングス	24,300	1,881.000	45,708,300
サンゲツ	20,200	1,576.000	31,835,200
ミツウロコグループホールディングス	11,800	1,056.000	12,460,800
シナネンホールディングス	3,200	3,330.000	10,656,000
伊藤忠エネクス	15,600	1,025.000	15,990,000
サンリオ	23,100	2,500.000	57,750,000
サンワテクノス	5,300	1,364.000	7,229,200
リョーサン	8,600	2,344.000	20,158,400
新光商事	13,300	908.000	12,076,400
トーヨー	5,400	1,101.000	5,945,400
三信電気	4,900	1,679.000	8,227,100
東陽テクニカ	9,100	1,085.000	9,873,500
モスフードサービス	9,900	3,020.000	29,898,000
加賀電子	6,800	3,225.000	21,930,000
ソーダニッカ	9,700	813.000	7,886,100
立花エレテック	6,500	1,576.000	10,244,000
PALTAC	10,600	4,520.000	47,912,000
太平洋興発	9,300	651.000	6,054,300
西本Wismettacホールディングス	2,200	2,851.000	6,272,200
国際紙パルプ商事	19,400	365.000	7,081,000
ヤマタネ	4,700	1,636.000	7,689,200
日鉄物産	5,100	5,330.000	27,183,000
泉州電業	2,200	6,270.000	13,794,000
トラスコ中山	15,300	2,527.000	38,663,100
オートバックスセブン	26,300	1,432.000	37,661,600
モリト	9,800	747.000	7,320,600
加藤産業	10,300	3,185.000	32,805,500
イノテック	5,500	1,426.000	7,843,000
イエローハット	12,900	1,623.000	20,936,700
J Kホールディングス	6,800	1,073.000	7,296,400
日伝	6,400	2,320.000	14,848,000
杉本商事	4,200	2,186.000	9,181,200
因幡電機産業	19,300	2,619.000	50,546,700
東テク	3,100	2,469.000	7,653,900
ミスミグループ本社	93,600	3,635.000	340,236,000
タキヒヨー	4,200	1,327.000	5,573,400
スズケン	29,400	3,615.000	106,281,000
ジェコス	7,500	828.000	6,210,000
ローソン	16,600	4,880.000	81,008,000
サンエー	5,300	4,080.000	21,624,000
カワチ薬品	5,900	2,387.000	14,083,300
エービーシー・マート	11,600	5,250.000	60,900,000

アスクル	17,200	1,671.000	28,741,200
ゲオホールディングス	10,200	1,553.000	15,840,600
アダストリア	8,200	1,739.000	14,259,800
くら寿司	7,900	3,840.000	30,336,000
キャンドウ	3,900	2,057.000	8,022,300
パルグループホールディングス	7,400	1,627.000	12,039,800
エディオン	32,700	1,184.000	38,716,800
サーラコーポレーション	16,500	645.000	10,642,500
ハローズ	3,700	2,803.000	10,371,100
フジオフードグループ本社	7,900	1,325.000	10,467,500
あみやき亭	2,800	3,025.000	8,470,000
大黒天物産	2,500	4,750.000	11,875,000
ハニーズホールディングス	7,400	1,022.000	7,562,800
アルペン	6,000	2,132.000	12,792,000
クオールホールディングス	10,000	1,329.000	13,290,000
ジinzホールディングス	5,200	6,580.000	34,216,000
ビックカメラ	43,600	1,023.000	44,602,800
DCMホールディングス	45,300	1,100.000	49,830,000
Monotaro	94,500	2,181.000	206,104,500
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,260.000	13,786,000
J.フロント リテイリング	89,600	1,055.000	94,528,000
ドトール・日レスホールディングス	12,700	1,627.000	20,662,900
マツキヨココカラ&カンパニー	45,800	4,435.000	203,123,000
ブロンコビリー	5,200	2,261.000	11,757,200
ZOZO	51,600	3,225.000	166,410,000
物語コーポレーション	3,800	6,660.000	25,308,000
三越伊勢丹ホールディングス	130,400	971.000	126,618,400
Hamee	3,900	1,105.000	4,309,500
ウエルシアホールディングス	39,500	3,095.000	122,252,500
クリエイトSDホールディングス	10,600	3,125.000	33,125,000
チムニー	4,900	1,157.000	5,669,300
シュッピン	7,200	1,158.000	8,337,600
オイシックス・ラ・大地	10,900	2,626.000	28,623,400
ネクステージ	15,200	2,559.000	38,896,800
ジョイフル本田	21,900	1,549.000	33,923,100
鳥貴族ホールディングス	3,700	1,854.000	6,859,800
ホットランド	7,800	1,317.000	10,272,600
すかいらーくホールディングス	96,600	1,498.000	144,706,800
SFPホールディングス	5,500	1,434.000	7,887,000
綿半ホールディングス	7,000	1,317.000	9,219,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,400	1,062.000	21,664,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	1,050.000	5,565,000
B E E N O S	4,300	1,509.000	6,488,700
あさひ	6,300	1,324.000	8,341,200
日本調剤	5,500	1,399.000	7,694,500
コスモス薬品	7,500	15,190.000	113,925,000
セブン&アイ・ホールディングス	292,000	5,698.000	1,663,816,000

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,500	746.000	30,213,000
ツルハホールディングス	16,300	9,140.000	148,982,000
サンマルクホールディングス	8,000	1,646.000	13,168,000
トリドールホールディングス	18,600	2,622.000	48,769,200
T O K Y O B A S E	9,200	438.000	4,029,600
J Mホールディングス	5,900	1,758.000	10,372,200
アレンザホールディングス	6,600	1,076.000	7,101,600
串カツ田中ホールディングス	2,500	2,077.000	5,192,500
バロックジャパンリミテッド	7,700	858.000	6,606,600
クスリのアオキホールディングス	7,500	6,970.000	52,275,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	43,800	3,745.000	164,031,000
メディカルシステムネットワーク	9,000	512.000	4,608,000
ノジマ	11,900	2,574.000	30,630,600
カップ・クリエイト	11,800	1,384.000	16,331,200
良品計画	85,900	1,743.000	149,723,700
アドヴァングループ	9,400	940.000	8,836,000
アルビス	3,400	2,227.000	7,571,800
G - 7ホールディングス	8,900	1,655.000	14,729,500
イオン北海道	13,500	1,178.000	15,903,000
コジマ	14,000	546.000	7,644,000
コーナン商事	10,700	3,605.000	38,573,500
エコス	3,300	2,018.000	6,659,400
ワタミ	10,800	985.000	10,638,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	149,300	1,867.000	278,743,100
西松屋チェーン	16,400	1,393.000	22,845,200
ゼンショーホールディングス	36,500	2,730.000	99,645,000
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,412.000	9,601,600
サイゼリヤ	11,500	2,939.000	33,798,500
V Tホールディングス	28,400	493.000	14,001,200
フジ・コーポレーション	5,600	1,167.000	6,535,200
ユナイテッドアローズ	8,300	1,794.000	14,890,200
ハイデイ日高	10,600	1,759.000	18,645,400
コロワイド	31,400	1,749.000	54,918,600
壱番屋	5,300	4,670.000	24,751,000
スギホールディングス	14,900	6,380.000	95,062,000
薬王堂ホールディングス	4,000	2,403.000	9,612,000
スクロール	12,300	927.000	11,402,100
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,715.000	13,205,500
木曽路	10,600	2,230.000	23,638,000
S R Sホールディングス	14,900	827.000	12,322,300
千趣会	17,900	371.000	6,640,900
リテールパートナーズ	9,800	1,185.000	11,613,000
ケーヨー	15,800	872.000	13,777,600
上新電機	8,100	2,069.000	16,758,900
日本瓦斯	36,600	1,745.000	63,867,000

ロイヤルホールディングス	13,300	2,016.000	26,812,800
いなげや	9,300	1,390.000	12,927,000
チヨダ	12,200	747.000	9,113,400
ライフコーポレーション	7,000	2,989.000	20,923,000
リンガーハット	10,000	2,240.000	22,400,000
MrMaxHD	12,200	610.000	7,442,000
AOKIホールディングス	16,300	619.000	10,089,700
オークワ	12,900	944.000	12,177,600
コメリ	11,100	2,741.000	30,425,100
青山商事	17,700	773.000	13,682,100
しまむら	8,600	10,000.000	86,000,000
高島屋	55,000	1,174.000	64,570,000
松屋	17,000	737.000	12,529,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,800	879.000	30,589,200
近鉄百貨店	3,500	2,632.000	9,212,000
丸井グループ	59,100	2,325.000	137,407,500
アクシアル リテイリング	5,800	3,250.000	18,850,000
イオン	287,000	2,655.500	762,128,500
イズミ	13,600	3,210.000	43,656,000
平和堂	13,000	1,975.000	25,675,000
フジ	9,200	2,084.000	19,172,800
ヤオコー	8,400	6,550.000	55,020,000
ゼビオホールディングス	11,400	963.000	10,978,200
ケーズホールディングス	68,400	1,254.000	85,773,600
日産東京販売ホールディングス	22,300	234.000	5,218,200
Genky DrugStores	3,400	3,620.000	12,308,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,044.000	5,846,400
ギフト	1,800	2,327.000	4,188,600
アインホールディングス	10,200	6,590.000	67,218,000
元気寿司	2,900	2,582.000	7,487,800
ヤマダホールディングス	274,200	403.000	110,502,600
アークランドサカモト	11,900	1,531.000	18,218,900
ニトリホールディングス	29,700	16,350.000	485,595,000
グルメ杵屋	10,800	1,044.000	11,275,200
吉野家ホールディングス	26,500	2,406.000	63,759,000
松屋フーズホールディングス	3,700	3,660.000	13,542,000
サガミホールディングス	13,900	1,213.000	16,860,700
関西フードマーケット	6,300	1,121.000	7,062,300
王将フードサービス	4,900	6,020.000	29,498,000
プレナス	8,700	2,020.000	17,574,000
ミニストップ	7,000	1,456.000	10,192,000
アークス	13,600	2,177.000	29,607,200
バローホールディングス	16,000	2,211.000	35,376,000
ベルク	3,400	5,260.000	17,884,000
ファーストリテイリング	10,000	64,340.000	643,400,000
サンドラッグ	28,100	3,145.000	88,374,500
ベルーナ	17,100	736.000	12,585,600
めぶきフィナンシャルグループ	383,200	281.000	107,679,200

東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	2,088.000	20,462,400
九州フィナンシャルグループ	150,200	416.000	62,483,200
ゆうちょ銀行	175,900	1,016.000	178,714,400
富山第一銀行	9,800	318.000	3,116,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	425,000	491.000	208,675,000
西日本フィナンシャルホールディングス	49,600	842.000	41,763,200
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,533.000	13,337,100
第四北越フィナンシャルグループ	12,400	2,732.000	33,876,800
ひろぎんホールディングス	111,000	691.000	76,701,000
おきなわフィナンシャルグループ	7,000	2,382.000	16,674,000
十六フィナンシャルグループ	10,500	2,437.000	25,588,500
北國フィナンシャルホールディングス	7,400	3,335.000	24,679,000
新生銀行	49,000	2,188.000	107,212,000
あおぞら銀行	41,500	2,686.000	111,469,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,689,100	726.300	3,405,693,330
りそなホールディングス	852,600	537.900	458,613,540
三井住友トラスト・ホールディングス	140,600	4,164.000	585,458,400
三井住友フィナンシャルグループ	517,400	4,266.000	2,207,228,400
千葉銀行	247,700	774.000	191,719,800
群馬銀行	140,200	400.000	56,080,000
武蔵野銀行	11,600	1,925.000	22,330,000
筑波銀行	26,300	220.000	5,786,000
七十七銀行	23,700	1,561.000	36,995,700
青森銀行	5,600	1,940.000	10,864,000
秋田銀行	4,300	1,741.000	7,486,300
山形銀行	10,600	1,013.000	10,737,800
岩手銀行	6,000	1,947.000	11,682,000
東邦銀行	73,100	223.000	16,301,300
東北銀行	2,000	1,023.000	2,046,000
みちのく銀行	4,500	892.000	4,014,000
ふくおかフィナンシャルグループ	62,500	2,399.000	149,937,500
静岡銀行	179,800	897.000	161,280,600
スルガ銀行	66,900	453.000	30,305,700
八十二銀行	164,500	441.000	72,544,500
山梨中央銀行	10,800	967.000	10,443,600
大垣共立銀行	15,000	2,052.000	30,780,000
福井銀行	8,000	1,493.000	11,944,000
清水銀行	4,400	1,646.000	7,242,400
富山銀行	2,400	2,251.000	5,402,400
滋賀銀行	14,200	2,261.000	32,106,200
南都銀行	12,200	2,121.000	25,876,200
百五銀行	73,900	360.000	26,604,000
京都銀行	26,700	5,640.000	150,588,000
紀陽銀行	25,800	1,571.000	40,531,800
ほくほくフィナンシャルグループ	47,300	977.000	46,212,100
山陰合同銀行	45,900	690.000	31,671,000
中国銀行	59,200	920.000	54,464,000

伊予銀行	97,300	640.000	62,272,000
百十四銀行	9,200	1,782.000	16,394,400
四国銀行	13,400	808.000	10,827,200
阿波銀行	11,800	2,346.000	27,682,800
大分銀行	5,500	2,044.000	11,242,000
宮崎銀行	5,400	2,244.000	12,117,600
佐賀銀行	4,500	1,552.000	6,984,000
琉球銀行	18,200	857.000	15,597,400
セブン銀行	219,600	248.000	54,460,800
みずほフィナンシャルグループ	956,400	1,593.500	1,524,023,400
山口フィナンシャルグループ	87,200	737.000	64,266,400
名古屋銀行	5,800	3,200.000	18,560,000
北洋銀行	115,700	269.000	31,123,300
愛知銀行	2,900	4,835.000	14,021,500
中京銀行	4,000	1,664.000	6,656,000
愛媛銀行	13,100	984.000	12,890,400
京葉銀行	33,500	524.000	17,554,000
栃木銀行	43,200	234.000	10,108,800
東和銀行	17,400	582.000	10,126,800
トモニホールディングス	60,300	359.000	21,647,700
フィデアホールディングス	8,500	1,413.000	12,010,500
池田泉州ホールディングス	94,200	191.000	17,992,200
F P G	27,600	858.000	23,680,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,900	1,170.000	8,073,000
S B Iホールディングス	91,700	3,075.000	281,977,500
ジャフコ グループ	28,800	1,713.000	49,334,400
大和証券グループ本社	560,100	696.900	390,333,690
野村ホールディングス	1,140,500	544.000	620,432,000
岡三証券グループ	59,700	391.000	23,342,700
丸三証券	22,100	545.000	12,044,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,700	414.000	34,237,800
水戸証券	25,200	282.000	7,106,400
いちよし証券	16,300	663.000	10,806,900
松井証券	37,500	820.000	30,750,000
マネックスグループ	61,600	538.000	33,140,800
極東証券	10,300	774.000	7,972,200
岩井コスモホールディングス	8,300	1,413.000	11,727,900
アイザワ証券グループ	13,400	946.000	12,676,400
スパークス・グループ	41,100	260.000	10,686,000
かんぽ生命保険	75,600	2,090.000	158,004,000
S O M P Oホールディングス	122,400	5,390.000	659,736,000
アニコム ホールディングス	26,500	781.000	20,696,500
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	167,000	3,993.000	666,831,000
第一生命ホールディングス	367,500	2,652.000	974,610,000
東京海上ホールディングス	246,300	7,038.000	1,733,459,400
T & Dホールディングス	193,600	1,781.000	344,801,600

アドバンスクリエイト	5,500	1,008.000	5,544,000
全国保証	17,800	4,780.000	85,084,000
ジェイリース	2,900	1,870.000	5,423,000
日本モーゲージサービス	4,100	1,024.000	4,198,400
アルヒ	12,400	1,009.000	12,511,600
プレミアグループ	4,200	4,310.000	18,102,000
ネットプロテクションズホールディングス	17,400	608.000	10,579,200
クレディセゾン	48,000	1,370.000	65,760,000
芙蓉総合リース	7,700	7,800.000	60,060,000
みずほリース	11,700	3,260.000	38,142,000
東京センチュリー	14,400	5,630.000	81,072,000
日本証券金融	30,900	906.000	27,995,400
アイフル	127,100	364.000	46,264,400
リコーリース	6,800	3,800.000	25,840,000
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,245.000	50,422,500
アコム	149,100	325.000	48,457,500
ジャックス	8,500	3,245.000	27,582,500
オリエントコーポレーション	207,000	126.000	26,082,000
オリックス	454,000	2,371.000	1,076,434,000
三菱H C キャピタル	277,000	610.000	168,970,000
日本取引所グループ	189,400	2,247.500	425,676,500
イー・ギャランティ	11,300	2,050.000	23,165,000
N E C キャピタルソリューション	3,800	2,147.000	8,158,600
いちご	89,600	286.000	25,625,600
日本駐車場開発	101,600	138.000	14,020,800
スター・マイカ・ホールディングス	6,800	1,230.000	8,364,000
S R E ホールディングス	2,600	3,665.000	9,529,000
ヒューリック	179,700	1,073.000	192,818,100
三栄建築設計	4,300	1,628.000	7,000,400
野村不動産ホールディングス	39,000	2,846.000	110,994,000
三重交通グループホールディングス	20,700	476.000	9,853,200
サムティ	10,100	2,124.000	21,452,400
ディア・ライフ	13,800	515.000	7,107,000
地主	7,400	1,795.000	13,283,000
プレサンスコーポレーション	10,300	1,814.000	18,684,200
日本管理センター	6,700	1,023.000	6,854,100
フージャースホールディングス	13,300	690.000	9,177,000
オープンハウスグループ	24,000	5,050.000	121,200,000
東急不動産ホールディングス	221,600	672.000	148,915,200
飯田グループホールディングス	62,500	2,188.000	136,750,000
A n d D o ホールディングス	5,700	890.000	5,073,000
シーアールイー	4,100	1,674.000	6,863,400
ケイアイスター不動産	3,400	5,240.000	17,816,000
グッドコムアセット	5,500	1,139.000	6,264,500
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,175.000	6,667,500
パーク24	40,800	1,799.000	73,399,200
パラカ	4,400	1,691.000	7,440,400

宮越ホールディングス	4,500	885.000	3,982,500
三井不動産	341,500	2,602.000	888,583,000
三菱地所	492,400	1,807.500	890,013,000
平和不動産	13,200	4,010.000	52,932,000
東京建物	74,800	1,814.000	135,687,200
京阪神ビルディング	13,200	1,478.000	19,509,600
住友不動産	157,400	3,644.000	573,565,600
テーオーシー	16,900	710.000	11,999,000
東京楽天地	2,400	3,930.000	9,432,000
スターツコーポレーション	10,400	2,538.000	26,395,200
フジ住宅	12,900	658.000	8,488,200
空港施設	13,200	568.000	7,497,600
ゴールドクレスト	7,700	1,866.000	14,368,200
日神グループホールディングス	17,300	497.000	8,598,100
日本エスコン	16,100	756.000	12,171,600
タカラレーベン	41,800	320.000	13,376,000
A V A N T I A	9,400	840.000	7,896,000
イオンモール	38,400	1,654.000	63,513,600
カチタス	18,600	3,295.000	61,287,000
トーセイ	12,200	1,076.000	13,127,200
サンフロンティア不動産	12,800	1,080.000	13,824,000
F Jネクストホールディングス	9,500	993.000	9,433,500
日本空港ビルデング	28,900	5,540.000	160,106,000
日本工営	4,900	3,025.000	14,822,500
L I F U L L	30,100	237.000	7,133,700
ミクシィ	16,800	2,260.000	37,968,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,200	1,779.000	11,029,800
日本M & Aセンターホールディングス	119,300	1,735.000	206,985,500
メンバーズ	2,600	2,859.000	7,433,400
UTグループ	10,600	3,455.000	36,623,000
アイティメディア	4,300	1,586.000	6,819,800
E・Jホールディングス	5,200	1,155.000	6,006,000
夢真ビーネックスグループ	23,800	1,553.000	36,961,400
コシダカホールディングス	20,500	654.000	13,407,000
パソナグループ	7,900	2,465.000	19,473,500
リンクアンドモチベーション	18,800	433.000	8,140,400
エス・エム・エス	25,000	3,120.000	78,000,000
パーソルホールディングス	72,400	2,517.000	182,230,800
リニカル	7,000	675.000	4,725,000
クックパッド	29,600	261.000	7,725,600
スタジオアリス	4,200	2,221.000	9,328,200
シミックホールディングス	5,400	1,525.000	8,235,000
総合警備保障	28,700	4,230.000	121,401,000
カカクコム	53,600	2,594.000	139,038,400
アイロムグループ	3,500	1,938.000	6,783,000
ルネサンス	6,700	1,109.000	7,430,300
ディップ	12,800	3,560.000	45,568,000
デジタルホールディングス	5,700	1,538.000	8,766,600

新日本科学	9,700	1,583.000	15,355,100
ベネフィット・ワン	26,400	2,477.000	65,392,800
エムスリー	127,900	4,074.000	521,064,600
アウトソーシング	41,900	1,355.000	56,774,500
ウェルネット	15,500	445.000	6,897,500
ワールドホールディングス	3,300	2,025.000	6,682,500
ディー・エヌ・エー	28,000	1,750.000	49,000,000
博報堂D Yホールディングス	100,400	1,573.000	157,929,200
ぐるなび	16,300	427.000	6,960,100
タカミヤ	15,600	385.000	6,006,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,000	992.000	5,952,000
ファンコミュニケーションズ	24,200	391.000	9,462,200
ライク	3,200	1,891.000	6,051,200
エスプール	20,800	958.000	19,926,400
W D Bホールディングス	3,700	2,654.000	9,819,800
手間いらず	1,300	5,050.000	6,565,000
アドウェイズ	12,000	661.000	7,932,000
バリューコマース	5,700	3,320.000	18,924,000
インフォマート	80,800	630.000	50,904,000
J Pホールディングス	26,300	230.000	6,049,000
プレステージ・インターナショナル	27,900	698.000	19,474,200
アミューズ	4,800	2,101.000	10,084,800
ドリームインキュベータ	2,700	2,505.000	6,763,500
クイック	6,100	1,542.000	9,406,200
電通グループ	74,600	4,860.000	362,556,000
ぴあ	2,600	3,395.000	8,827,000
イオンファンタジー	3,800	2,121.000	8,059,800
シーティーエス	10,000	821.000	8,210,000
H . U . グループホールディングス	19,300	3,015.000	58,189,500
アルプス技研	7,300	1,990.000	14,527,000
日本空調サービス	10,300	788.000	8,116,400
オリエンタルランド	85,600	21,380.000	1,830,128,000
ダスキン	16,900	2,787.000	47,100,300
明光ネットワークジャパン	13,300	573.000	7,620,900
ファルコホールディングス	4,400	2,001.000	8,804,400
ラウンドワン	20,700	1,370.000	28,359,000
リゾートトラスト	33,700	1,978.000	66,658,600
ビー・エム・エル	9,400	3,345.000	31,443,000
りらいあコミュニケーションズ	11,900	1,062.000	12,637,800
リソー教育	35,700	389.000	13,887,300
ユー・エス・エス	81,000	1,957.000	158,517,000
東京個別指導学院	9,200	617.000	5,676,400
サイバーエージェント	178,800	1,514.000	270,703,200
楽天グループ	372,900	983.000	366,560,700
クリーク・アンド・リバー社	4,400	1,684.000	7,409,600
モーニングスター	16,200	575.000	9,315,000
山田コンサルティンググループ	5,000	1,156.000	5,780,000
セントラルスポーツ	3,900	2,445.000	9,535,500

フルキャストホールディングス	6,400	2,214.000	14,169,600
エン・ジャパン	11,800	2,940.000	34,692,000
テクノプロ・ホールディングス	43,600	3,315.000	144,534,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	3,755.000	13,142,500
K e e P e r 技研	5,100	2,086.000	10,638,600
G u n o s y	5,200	796.000	4,139,200
イー・ガーディアン	3,400	2,582.000	8,778,800
ジャパンマテリアル	22,400	1,752.000	39,244,800
ベクトル	11,200	1,064.000	11,916,800
チャーム・ケア・コーポレーション	6,100	1,059.000	6,459,900
キャリアリンク	3,300	1,438.000	4,745,400
I B J	8,000	802.000	6,416,000
アサンテ	5,200	1,594.000	8,288,800
バリューHR	3,500	2,487.000	8,704,500
M & Aキャピタルパートナーズ	6,000	5,040.000	30,240,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,346.000	5,114,800
E R Iホールディングス	2,900	1,137.000	3,297,300
シグマクシス・ホールディングス	4,800	2,066.000	9,916,800
ウィルグループ	6,100	1,239.000	7,557,900
メドピア	5,700	2,728.000	15,549,600
リクルートホールディングス	558,700	4,722.000	2,638,181,400
エラン	10,100	950.000	9,595,000
日本郵政	946,100	976.500	923,866,650
ベルシステム24ホールディングス	10,700	1,376.000	14,723,200
鎌倉新書	11,000	503.000	5,533,000
エアトリ	5,000	3,490.000	17,450,000
アトラエ	5,600	2,001.000	11,205,600
ストライク	2,900	4,435.000	12,861,500
ソラスト	18,200	994.000	18,090,800
インソース	7,400	1,908.000	14,119,200
ベイカレント・コンサルティング	5,100	41,500.000	211,650,000
O r c h e s t r a H o l d i n g s	1,800	2,703.000	4,865,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23,000	1,514.000	34,822,000
ウェルビー	6,000	1,178.000	7,068,000
エル・ティー・エス	1,500	2,008.000	3,012,000
ミダックホールディングス	3,600	2,368.000	8,524,800
日総工産	7,300	850.000	6,205,000
キュービーネットホールディングス	4,500	1,737.000	7,816,500
R P Aホールディングス	13,100	338.000	4,427,800
スプリックス	2,900	1,482.000	4,297,800
マネジメントソリューションズ	3,800	3,130.000	11,894,000
カーブスホールディングス	20,700	709.000	14,676,300
F A S T F I T N E S S J A P A N	1,500	1,832.000	2,748,000
ダイレクトマーケティングミックス	9,400	1,460.000	13,724,000
ポピンズホールディングス	2,200	2,298.000	5,055,600
L I T A L I C O	6,100	2,961.000	18,062,100

アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	655.000	3,733,500
リログループ	40,100	1,713.000	68,691,300
東祥	6,400	1,738.000	11,123,200
TREホールディングス	10,300	1,551.000	15,975,300
人・夢・技術グループ	3,600	1,888.000	6,796,800
エイチ・アイ・エス	16,500	2,072.000	34,188,000
ラックランド	3,600	2,834.000	10,202,400
共立メンテナンス	13,000	4,480.000	58,240,000
イチネンホールディングス	8,300	1,309.000	10,864,700
建設技術研究所	4,900	2,328.000	11,407,200
燦ホールディングス	4,400	1,529.000	6,727,600
東京テアトル	6,100	1,254.000	7,649,400
ナガワ	2,300	9,690.000	22,287,000
東京都競馬	5,600	4,085.000	22,876,000
カナモト	12,600	2,308.000	29,080,800
西尾レントオール	6,700	2,858.000	19,148,600
トランス・コスモス	9,400	3,205.000	30,127,000
乃村工藝社	31,200	939.000	29,296,800
日本管財	7,600	2,799.000	21,272,400
トーカイ	6,400	1,862.000	11,916,800
セコム	71,300	8,678.000	618,741,400
セントラル警備保障	4,000	2,377.000	9,508,000
丹青社	16,300	736.000	11,996,800
メイテック	9,000	6,940.000	62,460,000
応用地質	8,000	2,078.000	16,624,000
船井総研ホールディングス	15,000	2,217.000	33,255,000
オオバ	8,100	713.000	5,775,300
ベネッセホールディングス	24,700	2,336.000	57,699,200
イオンディライト	8,900	2,987.000	26,584,300
ダイセキ	13,200	4,395.000	58,014,000
合 計	81,953,700		199,369,314,880

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1)貸借対照表

(単位:円)

	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	11,754,192
コール・ローン	2,728,345,705	389,804,746
国債証券	102,126,845,070	103,251,731,330

地方債証券	8,642,456,560	9,588,458,300
特殊債券	12,556,759,175	9,447,523,174
社債券	4,039,898,000	5,297,396,900
未収入金	507,203,000	508,302,200
未収利息	376,676,876	356,702,726
前払費用	4,039,280	4,632,157
流動資産合計	130,982,223,666	128,856,305,725
資産合計	130,982,223,666	128,856,305,725
負債の部		
流動負債		
未払金	1,104,493,400	200,000,000
未払解約金	2,317,953,000	223,632,227
未払利息	7,914	-
その他未払費用	-	753
流動負債合計	3,422,454,314	423,632,980
負債合計	3,422,454,314	423,632,980
純資産の部		
元本等		
元本	100,129,074,120	102,053,846,373
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	27,430,695,232	26,378,826,372
元本等合計	127,559,769,352	128,432,672,745
純資産合計	127,559,769,352	128,432,672,745
負債純資産合計	130,982,223,666	128,856,305,725

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,129,074,120口	102,053,846,373口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2740円 (1万口当たりの純資産額12,740円)	1口当たり純資産額 1.2585円 (1万口当たりの純資産額12,585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2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(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、地方債証券、特殊債券、社債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。 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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該評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	(2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,405,246,912円
同期中における追加設定元本額	31,312,880,290円
同期中における一部解約元本額	38,589,053,082円
2021年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,849,125,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,277,305,275円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,281,609,671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)	557,497,100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)	42,772,936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)	195,547,502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)	416,828,870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)	506,152,768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)	222,180,703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)	359,091,057円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,162,809円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,290,177,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	405,171,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	30,166,475円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,117,329,028円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	356,713,253円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	509,322,266円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,902,299円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	29,345,283円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	84,760,569円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	55,942,355円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	92,132,794円

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	25,221,489円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,051,909円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,635,333,683円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,645,125,243円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,716,300,176円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,758,553,795円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	324,470,878円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	584,749,121円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,828,677円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	269,243,070円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,304,219円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,906,397,650円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,164,794,277円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,519,848,740円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,294,363,282円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,106,276円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,295,938,945円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	467,586,621円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	599,719,035円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	177,900,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	46,646,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,629,572,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,241,285,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	821,846,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	212,410,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,427,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	302,971,200円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420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>	288,586,835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>	885,855,263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>	742,864,411円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,910,700,492円
合計	100,129,074,120円

(2022年2月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	100,129,074,120円
同期中における追加設定元本額	17,663,518,982円
同期中における一部解約元本額	15,738,746,729円

2022年2月18日現在の元本の内訳

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	6,655,940,182円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,416,731,765円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,611,374,720円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	811,383,592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)	43,771,585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)	197,469,805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)	477,710,690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)	720,810,481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)	341,197,909円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	493,301,432円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	146,777,854円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,106,558,375円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	337,487,521円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,533,572円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	44,807,171円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,918,698,861円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	641,421,985円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	990,386,432円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	229,284,271円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	84,963,102円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	146,654,699円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	106,995,569円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	200,242,215円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	57,564,692円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,951,548円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,448,683,462円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	12,422,883,716円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,372,792,213円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	16,011,855,332円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	319,334,808円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	565,801,602円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	265,754,075円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	119,806,572円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,887,217,652円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,215,198,814円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,371,642,862円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	8,596,867,318円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	972,339円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,198,994,627円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	444,446,764円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	547,012,597円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	180,274,882円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	43,674,401円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	1,457,491,849円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	2,120,941,549円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	699,571,659円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	210,722,470円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	19,095,952円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	278,445,136円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	5,230,302,006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>	997,745,813円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,060,685,582円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,356,845,714円

S M A M ・ マ ル チ ア セ ッ ト ・ ダイ ナ ミ ッ ク ア ロ ケ ー シ ョ ン ・ ス ト ラ テ ジ ー ・ フ ァ ン ド <

適格機関投資家限定>

3,805,764,579円

合 計

102,053,846,373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
国債証券	4 2 7 2年国債	2,900,000,000	2,902,088,000	
	4 2 8 2年国債	100,000,000	100,068,000	
	4 2 9 2年国債	70,000,000	70,050,400	
	4 3 0 2年国債	70,000,000	70,046,900	
	4 3 1 2年国債	80,000,000	80,049,600	
	4 3 2 2年国債	750,000,000	750,412,500	
	4 3 3 2年国債	330,000,000	330,125,400	
	1 3 7 5年国債	100,000,000	100,228,000	
	1 3 8 5年国債	600,000,000	601,422,000	
	1 3 9 5年国債	260,000,000	260,644,800	
	1 4 0 5年国債	600,000,000	601,530,000	
	1 4 1 5年国債	795,000,000	797,043,150	
	1 4 2 5年国債	760,000,000	762,036,800	
	1 4 3 5年国債	770,000,000	772,125,200	
	1 4 4 5年国債	980,000,000	982,763,600	
	1 4 5 5年国債	1,080,000,000	1,083,088,800	
	1 4 6 5年国債	1,740,000,000	1,744,976,400	
	1 4 7 5年国債	1,700,000,000	1,698,266,000	
	1 4 8 5年国債	1,070,000,000	1,068,609,000	
	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	1,237,730,800	
	1 5 0 5年国債	550,000,000	548,806,500	
	1 4 0年国債	40,000,000	54,453,200	
	2 4 0年国債	242,000,000	318,457,480	
	3 4 0年国債	185,000,000	244,375,750	
	4 4 0年国債	247,000,000	328,179,020	
	5 4 0年国債	235,000,000	301,897,450	
	6 4 0年国債	240,000,000	303,434,400	
	7 4 0年国債	255,000,000	310,016,250	
	8 4 0年国債	300,000,000	340,836,000	
	9 4 0年国債	473,000,000	400,872,230	
	1 0 4 0年国債	440,000,000	437,082,800	
	1 1 4 0年国債	370,000,000	356,043,600	
1 2 4 0年国債	380,000,000	329,053,400		

1 3	4 0 年国債	445,000,000	383,643,400	
1 4	4 0 年国債	420,000,000	387,315,600	
3 3 0	1 0 年国債	1,285,000,000	1,302,039,100	
3 3 2	1 0 年国債	793,000,000	802,056,060	
3 3 3	1 0 年国債	815,000,000	825,391,250	
3 3 4	1 0 年国債	315,000,000	319,469,850	
3 3 5	1 0 年国債	90,000,000	91,160,100	
3 3 6	1 0 年国債	340,000,000	344,756,600	
3 3 7	1 0 年国債	120,000,000	120,999,600	
3 3 8	1 0 年国債	805,000,000	814,643,900	
3 3 9	1 0 年国債	785,000,000	795,040,150	
3 4 0	1 0 年国債	770,000,000	780,456,600	
3 4 1	1 0 年国債	557,000,000	562,854,070	
3 4 2	1 0 年国債	350,000,000	350,994,000	
3 4 3	1 0 年国債	310,000,000	310,868,000	
3 4 4	1 0 年国債	811,000,000	813,035,610	
3 4 5	1 0 年国債	258,000,000	258,681,120	
3 4 6	1 0 年国債	540,000,000	541,225,800	
3 4 7	1 0 年国債	680,000,000	681,441,600	
3 4 8	1 0 年国債	405,000,000	405,899,100	
3 4 9	1 0 年国債	370,000,000	370,751,100	
3 5 0	1 0 年国債	550,000,000	550,995,500	
3 5 1	1 0 年国債	180,000,000	180,282,600	
3 5 2	1 0 年国債	570,000,000	570,741,000	
3 5 3	1 0 年国債	570,000,000	570,575,700	
3 5 4	1 0 年国債	435,000,000	435,304,500	
3 5 5	1 0 年国債	780,000,000	779,711,400	
3 5 6	1 0 年国債	810,000,000	809,384,400	
3 5 7	1 0 年国債	680,000,000	678,939,200	
3 5 8	1 0 年国債	1,100,000,000	1,097,360,000	
3 5 9	1 0 年国債	1,070,000,000	1,066,469,000	
3 6 0	1 0 年国債	1,090,000,000	1,085,378,400	
3 6 1	1 0 年国債	1,020,000,000	1,014,226,800	
3 6 2	1 0 年国債	1,040,000,000	1,032,564,000	
3 6 3	1 0 年国債	800,000,000	793,400,000	
3 6 4	1 0 年国債	950,000,000	940,623,500	
3 6 5	1 0 年国債	280,000,000	276,900,400	
2	3 0 年国債	510,000,000	602,345,700	
4	3 0 年国債	340,000,000	420,889,400	
5	3 0 年国債	290,000,000	343,560,100	
7	3 0 年国債	474,000,000	572,743,680	
9	3 0 年国債	240,000,000	268,670,400	
1 0	3 0 年国債	535,000,000	582,117,450	
1 1	3 0 年国債	430,000,000	496,757,500	
1 2	3 0 年国債	570,000,000	685,185,600	

14	30年国債	622,000,000	773,295,280	
16	30年国債	465,000,000	586,857,900	
18	30年国債	540,000,000	671,225,400	
19	30年国債	470,000,000	585,568,300	
21	30年国債	345,000,000	431,450,100	
22	30年国債	315,000,000	403,137,000	
23	30年国債	329,000,000	422,041,200	
24	30年国債	310,000,000	398,300,400	
25	30年国債	290,000,000	365,078,100	
26	30年国債	363,000,000	462,923,010	
27	30年国債	420,000,000	543,757,200	
28	30年国債	386,000,000	501,232,580	
29	30年国債	177,000,000	227,960,070	
30	30年国債	442,000,000	564,049,460	
31	30年国債	325,000,000	410,949,500	
32	30年国債	360,000,000	462,427,200	
33	30年国債	368,000,000	454,873,760	
34	30年国債	457,000,000	582,144,880	
35	30年国債	350,000,000	434,325,500	
36	30年国債	90,000,000	111,971,700	
37	30年国債	335,000,000	411,376,650	
38	30年国債	280,000,000	338,738,400	
39	30年国債	180,000,000	221,518,800	
40	30年国債	270,000,000	327,210,300	
41	30年国債	270,000,000	322,037,100	
42	30年国債	280,000,000	334,171,600	
43	30年国債	285,000,000	340,355,550	
44	30年国債	240,000,000	286,790,400	
45	30年国債	275,000,000	317,053,000	
46	30年国債	315,000,000	363,254,850	
47	30年国債	330,000,000	387,608,100	
48	30年国債	335,000,000	379,005,600	
49	30年国債	315,000,000	356,387,850	
50	30年国債	255,000,000	255,000,000	
51	30年国債	345,000,000	306,439,350	
52	30年国債	343,000,000	319,240,390	
53	30年国債	307,000,000	292,162,690	
54	30年国債	75,000,000	74,610,000	
55	30年国債	325,000,000	322,959,000	
56	30年国債	220,000,000	218,145,400	
57	30年国債	355,000,000	351,240,550	
58	30年国債	340,000,000	335,654,800	
59	30年国債	380,000,000	365,769,000	
60	30年国債	380,000,000	382,872,800	
61	30年国債	345,000,000	330,444,450	

6 2	3 0 年国債	165,000,000	149,653,350	
6 3	3 0 年国債	320,000,000	281,510,400	
6 4	3 0 年国債	305,000,000	267,756,450	
6 5	3 0 年国債	305,000,000	267,195,250	
6 6	3 0 年国債	330,000,000	288,812,700	
6 7	3 0 年国債	320,000,000	295,331,200	
6 8	3 0 年国債	350,000,000	322,829,500	
6 9	3 0 年国債	350,000,000	331,320,500	
7 0	3 0 年国債	360,000,000	340,657,200	
7 1	3 0 年国債	340,000,000	321,609,400	
7 2	3 0 年国債	300,000,000	283,662,000	
7 3	3 0 年国債	130,000,000	122,874,700	
6 4	2 0 年国債	1,025,000,000	1,056,395,750	
6 5	2 0 年国債	1,020,000,000	1,055,893,800	
6 9	2 0 年国債	1,020,000,000	1,064,747,400	
7 0	2 0 年国債	780,000,000	823,633,200	
7 2	2 0 年国債	753,000,000	793,759,890	
7 4	2 0 年国債	664,000,000	703,222,480	
7 5	2 0 年国債	490,000,000	521,389,400	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	626,762,900	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	665,985,400	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	537,655,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	699,321,900	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	814,589,860	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,870,200	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	637,101,000	
9 2	2 0 年国債	424,000,000	465,857,280	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	694,195,120	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	341,270,600	
9 7	2 0 年国債	677,000,000	757,542,690	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	171,075,420	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	233,736,120	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	405,147,300	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	524,060,180	
1 0 5	2 0 年国債	390,000,000	441,694,500	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	421,463,300	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	429,846,480	
1 0 8	2 0 年国債	390,000,000	438,196,200	
1 0 9	2 0 年国債	140,000,000	157,866,800	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	444,949,920	
1 1 3	2 0 年国債	227,000,000	261,045,460	
1 1 4	2 0 年国債	263,000,000	303,615,090	
1 1 6	2 0 年国債	100,000,000	116,632,000	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	230,804,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	335,577,250	

120	20年国債	200,000,000	224,216,000	
121	20年国債	55,000,000	63,204,900	
122	20年国債	330,000,000	376,431,000	
123	20年国債	80,000,000	93,590,400	
124	20年国債	190,000,000	220,622,300	
125	20年国債	205,000,000	242,295,650	
126	20年国債	180,000,000	209,529,000	
127	20年国債	145,000,000	167,490,950	
128	20年国債	65,000,000	75,288,850	
130	20年国債	155,000,000	178,474,750	
131	20年国債	380,000,000	433,975,200	
132	20年国債	450,000,000	515,052,000	
133	20年国債	190,000,000	219,298,000	
134	20年国債	200,000,000	231,256,000	
135	20年国債	155,000,000	177,695,100	
136	20年国債	120,000,000	136,387,200	
137	20年国債	185,000,000	212,429,950	
139	20年国債	60,000,000	68,290,800	
140	20年国債	340,000,000	391,006,800	
142	20年国債	190,000,000	220,812,300	
143	20年国債	120,000,000	137,086,800	
144	20年国債	170,000,000	192,378,800	
145	20年国債	110,000,000	127,077,500	
146	20年国債	95,000,000	109,881,750	
147	20年国債	260,000,000	298,264,200	
148	20年国債	309,000,000	351,181,590	
149	20年国債	575,000,000	654,292,500	
150	20年国債	321,000,000	361,606,500	
151	20年国債	580,000,000	639,339,800	
152	20年国債	355,000,000	391,497,550	
153	20年国債	307,000,000	342,605,860	
154	20年国債	290,000,000	319,875,800	
155	20年国債	410,000,000	441,073,900	
156	20年国債	380,000,000	377,484,400	
157	20年国債	255,000,000	245,756,250	
158	20年国債	360,000,000	361,224,000	
159	20年国債	388,000,000	394,169,200	
160	20年国債	355,000,000	365,206,250	
161	20年国債	350,000,000	354,476,500	
162	20年国債	250,000,000	252,700,000	
163	20年国債	430,000,000	434,076,400	
164	20年国債	385,000,000	381,873,800	
165	20年国債	390,000,000	386,209,200	
166	20年国債	335,000,000	341,596,150	
167	20年国債	400,000,000	394,488,000	

	168	20年国債	330,000,000	319,529,100	
	169	20年国債	400,000,000	379,972,000	
	170	20年国債	415,000,000	393,324,550	
	171	20年国債	265,000,000	250,581,350	
	172	20年国債	510,000,000	489,773,400	
	173	20年国債	505,000,000	483,926,350	
	174	20年国債	510,000,000	487,651,800	
	175	20年国債	515,000,000	500,358,550	
	176	20年国債	410,000,000	397,536,000	
	177	20年国債	540,000,000	512,854,200	
	178	20年国債	560,000,000	541,178,400	
	179	20年国債	180,000,000	173,881,800	
		国債証券 小計		103,251,731,330	
地方債証券	727	東京都公債	500,000,000	505,642,500	
	792	東京都公債	300,000,000	296,523,300	
	1	東京都30年	100,000,000	120,224,800	
	8	東京都30年	400,000,000	500,862,800	
	13	東京都30年	500,000,000	611,716,500	
	1	東京都20年	100,000,000	101,970,300	
	6	東京都20年	100,000,000	105,680,800	
	24-14	北海道公債	100,000,000	100,758,700	
	26-15	北海道公債	100,000,000	100,849,600	
	30-18	北海道公債	200,000,000	198,571,600	
	1	神奈川県20年	100,000,000	105,646,500	
	3	神奈川県20年	100,000,000	106,516,700	
	7	神奈川県20年	100,000,000	110,379,300	
	13	神奈川県20年	100,000,000	115,239,800	
	373	大阪府公債	100,000,000	101,130,600	
	377	大阪府公債	100,000,000	101,063,300	
	388	大阪府公債	100,000,000	101,018,400	
	27-4	京都府公債	100,000,000	101,339,200	
	29-12	京都府5年	300,000,000	299,942,100	
	1-6	京都府5年	200,000,000	199,259,600	
	5	兵庫県公債15年	300,000,000	320,218,200	
	10	兵庫県公債20年	100,000,000	115,527,100	
	7	静岡県30年	100,000,000	123,697,700	
	1	静岡県20年	100,000,000	107,254,800	
	22-8	愛知県20年	200,000,000	227,607,800	
	27-16	愛知県公債	400,000,000	404,565,600	
	25-11	福岡県公債	100,000,000	101,152,000	
	26-3	福岡県公債	100,000,000	101,064,200	
	26-10	福岡県公債	100,000,000	100,918,400	
	1-1	福岡県公債	200,000,000	196,943,000	
	25-8	千葉県公債	100,000,000	101,004,800	
	118	共同発行地方	100,000,000	100,738,600	

	1 3 7 共同発行地方	200,000,000	202,151,400	
	1 3 8 共同発行地方	200,000,000	202,136,000	
	1 7 2 共同発行地方	500,000,000	501,176,000	
	1 8 3 共同発行地方	600,000,000	599,669,400	
	1 名古屋市20年	200,000,000	206,910,600	
	3 名古屋市20年	100,000,000	106,258,300	
	5 名古屋市20年	100,000,000	109,741,600	
	2 9 - 5 京都市5年	100,000,000	99,971,000	
	1 京都市30年	100,000,000	129,580,400	
	7 京都市20年	100,000,000	114,147,500	
	2 6 - 1 7 神戸市公債	100,000,000	100,394,800	
	2 6 - 3 横浜市公債	200,000,000	202,173,800	
	4 横浜市20年	100,000,000	105,769,500	
	9 横浜市20年	100,000,000	109,454,100	
	1 4 横浜市20年	100,000,000	112,790,600	
	4 7 横浜市5年	100,000,000	99,990,600	
	2 6 - 4 札幌市公債	100,000,000	100,972,900	
	2 4 - 2 北九州市債	100,000,000	100,568,900	
	1 - 2 北九州市5年	100,000,000	99,630,200	
	2 9 - 1 1 福岡市5年	300,000,000	299,942,100	
	地方債証券 小計		9,588,458,300	
特殊債券	3 政保政策投資CO	200,000,000	207,609,800	
	3 6 日本政策投資B	100,000,000	110,665,700	
	1 8 道路機構	100,000,000	142,836,800	
	2 2 道路機構	300,000,000	415,389,900	
	2 7 道路機構	100,000,000	111,966,900	
	3 7 道路機構	300,000,000	340,869,300	
	4 7 道路機構	200,000,000	230,378,000	
	1 0 4 道路機構	400,000,000	402,794,000	
	7 9 政保道路機構	200,000,000	227,433,200	
	8 1 政保道路機構	200,000,000	227,674,800	
	8 8 政保道路機構	100,000,000	127,229,300	
	9 0 政保道路機構	500,000,000	571,700,000	
	9 9 政保道路機構	100,000,000	115,691,400	
	1 7 6 政保道路機構	100,000,000	113,830,200	
	1 9 6 政保道路機構	100,000,000	115,797,500	
	2 1 0 政保道路機構	200,000,000	226,870,400	
	2 2 7 政保道路機構	200,000,000	202,497,400	
	2 3 1 政保道路機構	300,000,000	303,534,300	
	2 8 8 政保道路機構	189,000,000	188,042,526	
	9 道路債券	100,000,000	125,798,200	
	2 地方公営20年	100,000,000	114,496,700	
	4 5 地方公共団体	200,000,000	201,496,800	
	6 1 地方公共団体	100,000,000	101,329,900	
	6 2 地方公共団体	400,000,000	404,889,200	

6 3	地方公共団体	100,000,000	101,122,800	
6 7	政保地方公共団	100,000,000	101,120,700	
1 0 1	地方公共団体	100,000,000	100,174,300	
1 0 6	地方公共団体	200,000,000	199,898,800	
3	公営企業20年	100,000,000	101,047,900	
5	公営企業20年	100,000,000	103,204,600	
1 7	公営企業20年	100,000,000	109,094,000	
2 0	公営企業20年	100,000,000	110,473,800	
2 2	公営企業20年	100,000,000	111,249,400	
2 4	公営企業20年	200,000,000	225,287,800	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	114,317,800	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	229,287,000	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	100,121,000	
S 9	住宅金融R M B S	21,082,000	21,326,551	
S 1 0	住宅金融R M B S	32,673,000	33,019,333	
S 3	住宅機構R M B S	11,386,000	11,589,809	
S 5	住宅機構R M B S	24,148,000	24,700,989	
S 7	住宅機構R M B S	12,428,000	12,706,387	
S 9	住宅機構R M B S	12,628,000	12,970,218	
S 1 0	住宅機構R M B S	12,428,000	12,721,300	
S 1 1	住宅機構R M B S	13,360,000	13,814,240	
S 1 7	住宅機構R M B S	17,618,000	17,646,188	
2 9	住宅金融R M B S	10,193,000	10,279,640	
3 2	住宅金融R M B S	11,222,000	11,370,130	
3 5	住宅金融R M B S	12,120,000	12,366,036	
3 9	住宅金融R M B S	10,998,000	11,162,970	
4 1	住宅金融R M B S	11,712,000	11,991,916	
4 3	住宅金融R M B S	22,418,000	22,866,360	
5 1	住宅金融R M B S	10,742,000	10,858,013	
5 3	住宅金融R M B S	11,613,000	11,858,034	
1	住宅機構R M B S	21,234,000	21,461,203	
2	住宅機構R M B S	23,878,000	24,501,215	
4	住宅機構R M B S	10,979,000	11,127,216	
6	住宅機構R M B S	10,905,000	11,021,683	
1 9	住宅機構R M B S	16,171,000	16,963,379	
2 4	住宅機構R M B S	33,312,000	35,187,465	
2 6	住宅機構R M B S	51,243,000	53,928,133	
2 7	住宅機構R M B S	18,671,000	19,710,974	
2 8	住宅機構R M B S	20,284,000	21,482,784	
2 9	住宅機構R M B S	22,517,000	23,940,074	
3 0	住宅機構R M B S	22,412,000	23,841,885	
3 2	住宅機構R M B S	43,940,000	46,378,670	
3 5	住宅機構R M B S	22,420,000	23,700,182	
3 6	住宅機構R M B S	21,747,000	22,908,289	
4 3	住宅機構R M B S	27,580,000	29,072,078	

4 6	住宅機構 R M B S	21,974,000	23,164,990	
4 8	住宅機構 R M B S	41,566,000	43,727,432	
4 9	住宅機構 R M B S	21,048,000	22,051,989	
5 1	住宅機構 R M B S	46,512,000	48,698,064	
5 5	住宅機構 R M B S	62,778,000	65,609,287	
5 7	住宅機構 R M B S	31,190,000	32,615,383	
5 8	住宅機構 R M B S	35,854,000	37,643,114	
5 9	住宅機構 R M B S	69,296,000	72,850,884	
6 0	住宅機構 R M B S	107,292,000	112,291,807	
6 1	住宅機構 R M B S	34,929,000	36,403,003	
6 7	住宅機構 R M B S	40,818,000	42,189,484	
6 9	住宅機構 R M B S	82,638,000	86,158,378	
7 0	住宅機構 R M B S	72,236,000	75,082,098	
7 3	住宅機構 R M B S	41,080,000	42,866,980	
9 9	住宅機構 R M B S	61,621,000	63,081,417	
1 2 3	住宅機構 R M B S	79,597,000	79,119,418	
1 2 4	住宅機構 R M B S	79,457,000	78,749,832	
1 2 5	住宅機構 R M B S	79,704,000	78,994,634	
1 2 7	住宅機構 R M B S	81,358,000	80,463,062	
1 2 8	住宅機構 R M B S	80,334,000	79,586,893	
1 2 9	住宅機構 R M B S	82,041,000	81,474,917	
1 3 7	住宅機構 R M B S	84,866,000	84,204,045	
1 6 7	住宅機構 R M B S	96,923,000	95,924,693	
8 5	中日本高速道	300,000,000	298,875,900	
	特殊債券 小計		9,447,523,174	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,781,400	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	101,059,700	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	101,091,300	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,990,100	
	3 0 東レ	100,000,000	100,385,500	
	5 6 住友化学	200,000,000	200,664,000	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	100,278,600	
	1 6 日立製作所	100,000,000	101,277,300	
	2 2 パナソニック	100,000,000	99,700,200	
	9 T D K	100,000,000	98,880,100	
	6 3 三井物産	100,000,000	110,889,300	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	111,891,200	
	1 三井住友 F G 劣後	100,000,000	101,018,900	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	109,721,200	
	1 みずほ F G 劣後	100,000,000	101,084,200	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	109,878,200	
	1 7 N T T ファイナンス	200,000,000	199,747,600	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,662,000	
	2 三菱 H C キヤピタル	200,000,000	199,205,800	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	99,982,600	

5 8 三菱地所	100,000,000	124,364,300	
1 3 5 三菱地所	200,000,000	197,108,000	
1 0 東急	100,000,000	98,362,200	
3 8 京王電鉄	100,000,000	100,084,100	
1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	117,776,400	
1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	196,531,600	
4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	112,853,400	
4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	114,315,300	
4 5 東京地下鉄	100,000,000	99,087,500	
6 4 阪急阪神H L D G	100,000,000	99,167,600	
5 4 6 中部電力	200,000,000	196,163,400	
5 5 3 中部電力	200,000,000	200,000,000	
5 0 8 東北電力	200,000,000	200,669,200	
4 9 6 九州電力	300,000,000	295,323,900	
3 7 東京電力パワー	200,000,000	200,324,800	
3 8 東京電力パワー	100,000,000	100,821,500	
4 1 大阪瓦斯	200,000,000	197,625,600	
7 ファーストリテイリング	100,000,000	100,628,900	
社債券 小計		5,297,396,900	
合 計		127,585,109,704	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2021年2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,920,973,169	2,883,879,727
金銭信託	-	32,714,820
コール・ローン	228,430,090	1,084,922,886
株式	267,313,435,920	331,942,389,153
投資証券	6,105,616,194	8,024,316,993
派生商品評価勘定	69,749,174	20,243,668
未収入金	758,789,533	57,653,943
未収配当金	286,772,376	308,088,498
差入委託証拠金	848,540,673	1,831,575,820
流動資産合計	277,532,307,129	346,185,785,508
資産合計	277,532,307,129	346,185,785,508
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	267,971	55,364,690
前受金	68,809,493	-

未払解約金	1,002,530,455	783,550,584
未払利息	662	-
その他未払費用	-	1,369
流動負債合計	1,071,608,581	838,916,643
負債合計	1,071,608,581	838,916,643
純資産の部		
元本等		
元本	58,766,657,288	61,407,657,975
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	217,694,041,260	283,939,210,890
元本等合計	276,460,698,548	345,346,868,865
純資産合計	276,460,698,548	345,346,868,865
負債純資産合計	277,532,307,129	346,185,785,508

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,766,657,288口	61,407,657,975口
2. 1単位あたり純資産の額	1口あたり純資産額 4.7044円 (1万口当たりの純資産額47,044円)	1口あたり純資産額 5.6238円 (1万口当たりの純資産額56,238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2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年2月18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</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2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SPMINI 2103	2,065,041,400	-	2,118,268,272	53,226,872
	SP1200 2103	110,074,006	-	111,970,950	1,896,944
	FTSE 2103	134,662,153	-	136,794,293	2,132,140
	DJ EUR 2103	435,929,493	-	447,483,032	11,553,539
	小計	2,745,707,052	-	2,814,516,547	68,809,495
合計		2,745,707,052	-	2,814,516,547	68,809,495

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	233,044,600	-	232,606,000	438,600
	イギリス・ポンド	45,498,240	-	45,470,800	27,440
	イスラエル・シェケル	973,890	-	971,700	2,190
	オーストラリア・ドル	6,567,680	-	6,562,400	5,280
	カナダ・ドル	26,667,100	-	26,649,600	17,500
	シンガポール・ドル	1,595,490	-	1,593,200	2,290
	スイス・フラン	16,524,600	-	16,483,600	41,000
	スウェーデン・クローナ	5,983,120	-	5,973,700	9,420
	デンマーク・クローネ	4,120,260	-	4,111,200	9,060
	ニュージーランド・ドル	760,620	-	760,600	20
	ノルウェー・クローネ	1,620,330	-	1,618,500	1,830

	ユーロ	15,400,320	-	15,289,200	111,120
	香港・ドル	6,007,560	-	6,001,600	5,960
	小計	364,763,810	-	364,092,100	671,710
	合計	364,763,810	-	364,092,100	671,710

(2022年2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT MAR22	4,375,284,375	-	4,349,641,904	25,642,471
	SPI 200 FUTURES MAR22	188,524,536	-	193,351,678	4,827,142
	FTSE 100 IDX FUT MAR22	271,150,942	-	268,997,038	2,153,904
	EURO STOXX 50 MAR22	889,936,395	-	878,702,152	11,234,243
	小計	5,724,896,248	-	5,690,692,772	34,203,476
	合計	5,724,896,248	-	5,690,692,772	34,203,476

(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		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	469,698,762	-	468,965,001	733,761
	カナダ・ドル	16,283,628	-	16,272,310	11,318
	オーストラリア・ ドル	9,946,672	-	9,897,404	49,268
	香港・ドル	6,350,317	-	6,337,437	12,880
	シンガポール・ド ル	1,715,733	-	1,711,822	3,911
	ニュージーラン ド・ドル	772,270	-	768,900	3,370

市場取引以 外の取引	イギリス・ポンド	26,613,014	-	26,588,778	24,236
	イスラエル・シ ケル	1,436,395	-	1,431,722	4,673
	スイス・フラン	21,259,620	-	21,234,567	25,053
	デンマーク・ク ローネ	5,450,034	-	5,441,095	8,939
	ノルウェー・ク ローネ	776,814	-	773,302	3,512
	スウェーデン・ク ローナ	7,272,104	-	7,257,000	15,104
	ユーロ	49,640,490	-	49,618,969	21,521
	小計	617,215,853	-	616,298,307	917,546
	合 計	617,215,853	-	616,298,307	917,546

(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2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,028,905,441円
同期中における追加設定元本額	21,383,368,865円
同期中における一部解約元本額	21,645,617,018円
2021年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,959,034,399円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	303,792,749円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,258,091,387円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	856,580,813円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	72,192,845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)	1,387,865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)	6,808,713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)	20,760,185円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	51,873,489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)	49,391,613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)	96,959,787円
外国株式指数ファンド	568,180,269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	8,713,337,204円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	274,434,170円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	290,257,470円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,039,592円
イオン・バランス戦略ファンド	47,420,115円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,429,026円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	92,308,642円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	76,998,068円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	241,854,195円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	120,616,253円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	136,527,997円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,180,752円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	161,377,669円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	2,741,835円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	10,771,338円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	9,141,735円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,883,247円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	19,920,837円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	854,963,605円
バランスファンドVA(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	6,257,384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＞	45,229,221円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	1,006,088,194円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,105,519,628円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	4,733,561,628円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	15,126,382円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	82,302,577円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	221,797円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	618,727,388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＞	50,710,438円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	132,813,524円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	615,908,839円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	474,127,525円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,109,446,238円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	323,177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)	258,084,232円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	97,914,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	12,472,286円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	10,134,411円

SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	5,648,485円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	31,438,597円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	83,975,579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>	230,303,089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>	90,262,097円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,445,551,577円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	171,768,987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>	1,326,659,547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>	14,023,156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>	40,287,615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>	33,743,927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>	385,767,128円
合計	58,766,657,288円

(2022年2月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	58,766,657,288円
同期中における追加設定元本額	13,897,863,438円
同期中における一部解約元本額	11,256,862,751円

2022年2月18日現在の元本の内訳

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>	7,741,901円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,041,277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>	58,834,436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>	130,885,825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>	61,717,109円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	617,208,199円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	107,877,816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>	49,785,224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>	30,625,590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>	26,421,298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>	33,774,984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>	71,402,336円
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	32,224,488,074円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	267,740,321円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,086,252,349円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	769,361,737円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	50,131,931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)	1,172,766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)	6,019,213円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	17,882,397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)	48,968,012円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	51,247,016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)	97,638,793円

外国株式指数ファンド	832,266,976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	13,549,725,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,436,603円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	203,184,616円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	129,304,051円
イオン・バランス戦略ファンド	14,159,067円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	15,873,266円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	121,558,830円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	107,101,698円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	367,788,050円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	190,350,995円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	221,270,706円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	42,907,633円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	631,760,314円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	4,312,302円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	18,997,088円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	16,653,445円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,126,325円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	135,053,059円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	138,305,233円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	494,524,360円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	18,407,244円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	547,572,635円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	4,050,001円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	28,727,858円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	667,997,195円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	802,068,341円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	3,487,539,177円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	11,523,953円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	62,266,508円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	467,481,408円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	39,529,370円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	102,099,408円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	486,937,001円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	339,113,420円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	789,808,587円
S M A M・バランスV A株4 0 T <適格機関投資家限定>	213,357円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	213,566,235円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	73,691,382円
合計	61,407,657,975円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

			評価額
--	--	--	-----

通貨	銘柄	株数	単価	金額	備考
アメリカ・ドル	BAKER HUGHES CO	48,147	29.430	1,416,966.21	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	115.880	1,594,856.44	
	CHEVRON CORP	106,147	133.610	14,182,300.67	
	CONOCOPHILLIPS	73,421	91.160	6,693,058.36	
	COTERRA ENERGY INC	40,261	22.790	917,548.19	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	55.250	1,999,829.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,236	129.690	1,197,816.84	
	EOG RESOURCES INC	30,830	112.600	3,471,458.00	
	EXXON MOBIL CORP	231,724	78.230	18,127,768.52	
	HALLIBURTON CO	52,615	32.970	1,734,716.55	
	HESS CORP	14,344	94.200	1,351,204.80	
	KINDER MORGAN INC	105,940	16.760	1,775,554.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	33,933	76.960	2,611,483.68	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,580	39.860	1,936,398.80	
	ONEOK INC	24,725	62.600	1,547,785.00	
	PHILLIPS 66	25,198	87.040	2,193,233.92	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,184	230.130	2,803,903.92	
	SCHLUMBERGER LTD	73,444	41.110	3,019,282.84	
	VALERO ENERGY CORP	21,447	87.040	1,866,746.88	
	WILLIAMS COS INC	64,802	29.690	1,923,971.38	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,372	240.610	2,976,826.92	
	ALBEMARLE CORP	6,560	197.020	1,292,451.20	
	AMCOR PLC	82,302	11.790	970,340.58	
	AVERY DENNISON CORP	4,232	182.700	773,186.40	
	BALL CORP	17,166	90.920	1,560,732.72	
	CELANESE CORP	6,643	152.930	1,015,913.99	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	76.190	914,432.38	
	CORTEVA INC	39,348	51.270	2,017,371.96	
	CROWN HOLDINGS INC	6,863	121.630	834,746.69	
	DOW INC	41,516	61.170	2,539,533.72	
	DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	79.730	2,227,975.12	
	EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	121.820	856,029.14	
	ECOLAB INC	14,157	178.380	2,525,325.66	
	FMC CORP	6,676	118.110	788,502.36	
FREEMPORT-MCMORAN INC	80,828	43.210	3,492,577.88		
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	46.120	882,736.80		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,922	135.700	1,889,215.40		
LINDE PLC	27,981	298.970	8,365,479.57		
LYONDELLBASELL INDU-CL A	13,931	100.950	1,406,334.45		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	385.020	1,370,286.18		

MOSAIC CO/THE	18,584	46.020	855,235.68	
NEWMONT CORP	45,161	67.750	3,059,657.75	
NUCOR CORP	15,455	120.940	1,869,127.70	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,682	148.530	695,417.46	
PPG INDUSTRIES INC	13,502	149.050	2,012,473.10	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	86.200	663,395.20	
SEALED AIR CORP	7,895	67.350	531,728.25	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,616	267.220	3,638,467.52	
STEEL DYNAMICS INC	10,191	63.240	644,478.84	
VULCAN MATERIALS CO	7,555	187.610	1,417,393.55	
WESTROCK CO	13,034	46.510	606,211.34	
3M CO	31,724	148.640	4,715,455.36	
ALLEGION PLC	4,764	114.590	545,906.76	
AMETEK INC	12,171	128.320	1,561,782.72	
BOEING CO/THE	30,130	213.580	6,435,165.40	
CARRIER GLOBAL CORP	46,600	44.580	2,077,428.00	
CATERPILLAR INC	29,738	194.740	5,791,178.12	
CUMMINS INC	8,207	218.690	1,794,788.83	
DEERE & CO	16,310	380.530	6,206,444.30	
DOVER CORP	8,225	159.390	1,310,982.75	
EATON CORP PLC	21,326	152.400	3,250,082.40	
EMERSON ELECTRIC CO	33,573	93.190	3,128,667.87	
FASTENAL CO	32,763	51.280	1,680,086.64	
FORTIVE CORP	18,373	63.370	1,164,297.01	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	89.370	640,425.42	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	302.800	999,240.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	12,642	214.400	2,710,444.80	
GENERAL ELECTRIC CO	58,947	98.460	5,803,921.62	
HEICO CORP	1,888	143.750	271,400.00	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	118.540	541,727.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,549	184.590	6,931,169.91	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	34.980	665,459.52	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	184.920	389,626.44	
IDEX CORP	3,839	188.710	724,457.69	
ILLINOIS TOOL WORKS	16,869	217.160	3,663,272.04	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	53.310	1,120,203.03	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	60.340	693,910.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,803	65.820	2,554,013.46	
KORNIT DIGITAL LTD	3,043	94.220	286,711.46	

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	221.000	2,448,459.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	252.740	531,764.96	
LOCKHEED MARTIN CORP	13,359	388.770	5,193,578.43	
MASCO CORP	14,885	57.750	859,608.75	
NORDSON CORP	2,884	228.880	660,089.92	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,215	398.110	3,270,473.65	
OTIS WORLDWIDE CORP	21,111	76.220	1,609,080.42	
OWENS CORNING	5,205	97.680	508,424.40	
PACCAR INC	18,041	93.640	1,689,359.24	
PARKER HANNIFIN CORP	7,329	303.020	2,220,833.58	
PENTAIR PLC	8,220	57.620	473,636.40	
PLUG POWER INC	28,584	23.150	661,719.60	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	82,039	94.360	7,741,200.04	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	266.460	1,657,114.74	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,657	438.190	2,478,840.83	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	57.680	438,368.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	71.050	508,504.85	
SNAP-ON INC	3,106	216.340	671,952.04	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	162.790	1,486,109.91	
SUNRUN INC	10,669	23.130	246,773.97	
TEXTRON INC	11,803	70.110	827,508.33	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	151.430	1,932,095.37	
TRANSDIGM GROUP INC	3,010	657.800	1,979,978.00	
UNITED RENTALS INC	4,113	314.210	1,292,345.73	
WABTEC CORP	9,231	96.040	886,545.24	
WW GRAINGER INC	2,390	471.370	1,126,574.30	
XYLEM INC	9,124	89.810	819,426.44	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	73.870	593,102.23	
CINTAS CORP	5,169	370.640	1,915,838.16	
CLARIVATE PLC	19,939	15.920	317,428.88	
COPART INC	12,238	124.800	1,527,302.40	
COSTAR GROUP INC	20,540	65.650	1,348,451.00	
EQUIFAX INC	6,841	212.000	1,450,292.00	
IHS MARKIT LTD	21,051	107.890	2,271,192.39	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	119.700	829,161.90	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	91.810	637,804.07	
REPUBLIC SERVICES INC	12,824	116.730	1,496,945.52	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	121.130	672,877.15	
ROLLINS INC	11,493	31.190	358,466.67	

TRANSUNION	11,233	98.300	1,104,203.90	
VERISK ANALYTICS INC	8,757	190.300	1,666,457.10	
WASTE CONNECTIONS INC	13,556	120.460	1,632,955.76	
WASTE MANAGEMENT INC	22,718	143.060	3,250,037.08	
AMERCO	650	590.110	383,571.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	90.850	629,136.25	
CSX CORP	121,827	35.100	4,276,127.70	
DELTA AIR LINES INC	8,299	43.310	359,429.69	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	106.060	921,555.34	
FEDEX CORP	13,580	224.370	3,046,944.60	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,411	187.840	828,562.24	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	53.680	426,219.20	
LYFT INC-A	13,145	42.900	563,920.50	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,579	273.230	3,710,190.17	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	289.740	1,604,869.86	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	46.380	328,184.88	
UBER TECHNOLOGIES INC	67,187	35.710	2,399,247.77	
UNION PACIFIC CORP	35,400	250.990	8,885,046.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	40,123	210.710	8,454,317.33	
APTIV PLC	15,307	143.130	2,190,890.91	
BORGWARNER INC	12,075	44.620	538,786.50	
FORD MOTOR CO	218,306	17.540	3,829,087.24	
GENERAL MOTORS CO	72,747	48.820	3,551,508.54	
LEAR CORP	3,736	172.400	644,086.40	
LUCID GROUP INC	21,730	28.110	610,830.30	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,269	64.740	600,075.06	
TESLA INC	45,934	876.350	40,254,260.90	
DR HORTON INC	18,162	82.750	1,502,905.50	
GARMIN LTD	8,444	113.320	956,874.08	
HASBRO INC	7,491	99.080	742,208.28	
LENNAR CORP-A	14,494	89.330	1,294,749.02	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	310.030	2,009,304.43	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	146.800	420,288.40	
NEWELL BRANDS INC	17,587	25.920	455,855.04	
NIKE INC -CL B	70,178	142.800	10,021,418.40	
NVR INC	173	5,001.330	865,230.09	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	15,071	30.590	461,021.89	
PULTEGROUP INC	13,075	47.950	626,946.25	
VF CORP	17,117	59.150	1,012,470.55	
WHIRLPOOL CORP	3,212	204.930	658,235.16	

AIRBNB INC-CLASS A	12,651	183.600	2,322,723.60	
ARAMARK	13,242	37.600	497,899.20	
BOOKING HOLDINGS INC	2,231	2,623.950	5,854,032.45	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,690	81.920	875,724.80	
CARNIVAL CORP	48,156	22.420	1,079,657.52	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,586	1,509.860	2,394,637.96	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	142.850	1,086,517.10	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	430.530	913,154.13	
DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	22.060	369,328.52	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	209.310	1,687,247.91	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,836	153.040	2,423,541.44	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	47.060	829,856.04	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	14,715	178.170	2,621,771.55	
MCDONALD'S CORP	41,033	250.930	10,296,410.69	
MELCO RESORTS & ENTERT- ADR	17,945	11.400	204,573.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	43.680	969,608.64	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	85.140	1,012,314.60	
STARBUCKS CORP	63,821	93.050	5,938,544.05	
VAIL RESORTS INC	2,038	266.290	542,699.02	
WYNN RESORTS LTD	4,913	93.870	461,183.31	
YUM! BRANDS INC	15,549	123.480	1,919,990.52	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	220.410	755,124.66	
AMAZON.COM INC	24,855	3,093.050	76,877,757.75	
AUTOZONE INC	1,137	1,893.110	2,152,466.07	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	52.160	803,264.00	
BEST BUY CO INC	12,132	98.630	1,196,579.16	
BURLINGTON STORES INC	3,391	217.520	737,610.32	
CARMAX INC	8,427	107.480	905,733.96	
CARVANA CO	4,496	135.230	607,994.08	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	45.660	181,224.54	
DOLLAR GENERAL CORP	12,746	197.120	2,512,491.52	
DOLLAR TREE INC	12,047	135.750	1,635,380.25	
DOORDASH INC - A	5,953	105.030	625,243.59	
EBAY INC	35,551	55.760	1,982,323.76	
ETSY INC	7,168	132.170	947,394.56	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,931	78.460	151,506.26	
GENUINE PARTS CO	7,406	127.610	945,079.66	
HOME DEPOT INC	57,649	347.940	20,058,393.06	
LKQ CORP	15,922	47.640	758,524.08	

LOWE'S COS INC	37,552	223.790	8,403,762.08	
MERCADOLIBRE INC	2,457	1,021.070	2,508,768.99	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,641	674.940	2,457,456.54	
POOL CORP	2,107	445.920	939,553.44	
ROSS STORES INC	18,792	91.750	1,724,166.00	
TARGET CORP	26,578	204.000	5,421,912.00	
TJX COMPANIES INC	66,779	65.170	4,351,987.43	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	213.480	1,305,857.16	
ULTA BEAUTY INC	2,765	369.120	1,020,616.80	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	130.800	491,284.80	
COSTCO WHOLESALE CORP	24,247	515.010	12,487,447.47	
KROGER CO	38,955	45.230	1,761,934.65	
SYSCO CORP	26,862	84.260	2,263,392.12	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,703	46.810	1,905,307.43	
WALMART INC	84,599	138.880	11,749,109.12	
ALTRIA GROUP INC	98,956	51.370	5,083,369.72	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,341	76.650	2,325,637.65	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,130	65.980	1,064,257.40	
BUNGE LTD	7,174	100.000	717,400.00	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	44.190	470,093.22	
COCA-COLA CO/THE	225,164	62.120	13,987,187.68	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,253	55.760	683,227.28	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	35.880	884,047.32	
CONSTELLATION BRANDS INC- A	8,881	218.870	1,943,784.47	
GENERAL MILLS INC	34,440	67.790	2,334,687.60	
HERSHEY CO/THE	7,514	202.030	1,518,053.42	
HORMEL FOODS CORP	14,939	47.310	706,764.09	
JM SMUCKER CO/THE	5,768	138.330	797,887.44	
KELLOGG CO	12,949	64.840	839,613.16	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	37.920	1,450,212.48	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,438	37.790	1,452,572.02	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	98.080	1,283,278.72	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	48.750	469,413.75	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	75,111	66.060	4,961,832.66	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,202	82.140	1,823,672.28	
PEPSICO INC	75,835	166.750	12,645,486.25	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	84,316	111.900	9,434,960.40	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	93.210	1,580,002.71	

CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	96.950	1,389,293.50	
CLOROX COMPANY	6,542	146.010	955,197.42	
COLGATE-PALMOLIVE CO	43,041	79.150	3,406,695.15	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,953	304.290	3,941,468.37	
KIMBERLY-CLARK CORP	17,800	131.630	2,343,014.00	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	132,439	159.820	21,166,400.98	
ABBOTT LABORATORIES	97,253	120.580	11,726,766.74	
ABIOMED INC	2,288	307.110	702,667.68	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	501.760	2,084,311.04	
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,993	142.110	1,135,885.23	
ANTHEM INC	13,309	451.340	6,006,884.06	
BAXTER INTERNATIONAL INC	26,434	82.800	2,188,735.20	
BECTON DICKINSON AND CO	16,013	266.150	4,261,859.95	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	79,811	42.830	3,418,305.13	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	54.510	823,864.14	
CENTENE CORP	30,528	82.810	2,528,023.68	
CERNER CORP	15,537	91.710	1,424,898.27	
CIGNA CORP	18,324	227.110	4,161,563.64	
COOPER COS INC/THE	2,771	388.950	1,077,780.45	
CVS HEALTH CORP	71,858	102.300	7,351,073.40	
DAVITA INC	4,138	117.320	485,470.16	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	55.550	659,045.20	
DEXCOM INC	5,440	387.250	2,106,640.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,018	106.880	3,635,843.84	
HCA HEALTHCARE INC	14,148	250.800	3,548,318.40	
HENRY SCHEIN INC	7,559	84.000	634,956.00	
HOLOGIC INC	13,592	69.880	949,808.96	
HUMANA INC	7,201	424.710	3,058,336.71	
IDEXX LABORATORIES INC	4,601	493.350	2,269,903.35	
INMODE LTD	2,666	42.500	113,305.00	
INSULET CORP	3,400	240.810	818,754.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	19,252	284.080	5,469,108.16	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,995	261.920	1,308,290.40	
MASIMO CORP	2,941	152.370	448,120.17	
MCKESSON CORP	8,411	273.350	2,299,146.85	
MEDTRONIC PLC	72,698	101.700	7,393,386.60	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	319.840	1,096,411.52	
NOVOCURE LTD	4,517	78.630	355,171.71	
OAK STREET HEALTH INC	6,212	16.000	99,392.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	129.120	879,823.68	
RESMED INC	7,595	234.240	1,779,052.80	
STERIS PLC	5,282	226.700	1,197,429.40	

STRYKER CORP	18,845	251.580	4,741,025.10	
TELADOC HEALTH INC	7,496	70.490	528,393.04	
TELEFLEX INC	2,340	317.990	744,096.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	51,407	470.340	24,178,768.38	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	136.360	573,121.08	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,675	219.290	1,683,050.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,856	119.970	1,302,394.32	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	80.990	308,895.86	
ABBVIE INC	96,997	144.970	14,061,655.09	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,873	130.250	2,197,708.25	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	149.950	1,021,159.50	
AMGEN INC	30,947	221.680	6,860,330.96	
AVANTOR INC	30,428	34.400	1,046,723.20	
BIOGEN INC	7,987	210.600	1,682,062.20	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	90.300	819,924.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	588.230	717,640.60	
BIO-TECHNE CORP	1,991	398.190	792,796.29	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,007	67.390	8,154,661.73	
CATALENT INC	8,935	97.970	875,361.95	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	291.630	751,530.51	
DANAHER CORP	35,291	269.270	9,502,807.57	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	25.780	536,507.58	
ELI LILLY & CO	43,937	240.970	10,587,498.89	
EXACT SCIENCES CORP	8,428	74.770	630,161.56	
GILEAD SCIENCES INC	68,627	61.290	4,206,148.83	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	94.360	1,092,877.52	
ILLUMINA INC	8,237	317.840	2,618,048.08	
INCYTE CORP	9,243	67.830	626,952.69	
IQVIA HOLDINGS INC	10,637	226.360	2,407,791.32	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	140.900	366,903.60	
JOHNSON & JOHNSON	143,947	166.190	23,922,551.93	
MERCK & CO. INC.	136,493	76.360	10,422,605.48	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,258	1,417.120	1,782,736.96	
MODERNA INC	18,663	146.360	2,731,516.68	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	84.680	354,470.48	
NOVAVAX INC	3,601	83.440	300,467.44	
PERKINELMER INC	5,624	177.820	1,000,059.68	
PFIZER INC	305,400	48.900	14,934,060.00	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,867	626.720	3,676,966.24	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,344	39.680	727,889.92	
SEAGEN INC	7,790	124.160	967,206.40	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	63,719	8.320	530,142.08	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,497	540.540	11,619,988.38	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,580	232.770	3,393,786.60	
VIATRIS INC	63,072	14.830	935,357.76	
WATERS CORP	3,425	314.980	1,078,806.50	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	387.300	1,642,539.30	
ZOETIS INC	26,218	193.070	5,061,909.26	
BANK OF AMERICA CORP	414,671	46.070	19,103,892.97	
CITIGROUP INC	110,527	64.710	7,152,202.17	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,225	53.090	1,339,195.25	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	48.190	1,790,258.50	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	766.020	513,233.40	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,688	172.620	1,672,342.56	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	15.870	1,203,215.79	
JPMORGAN CHASE & CO	163,158	151.430	24,707,015.94	
KEYCORP	51,128	25.730	1,315,523.44	
M & T BANK CORP	7,237	182.660	1,321,910.42	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	23,168	201.300	4,663,718.40	
REGIONS FINANCIAL CORP	56,345	23.900	1,346,645.50	
SIGNATURE BANK	3,256	338.590	1,102,449.04	
SVB FINANCIAL GROUP	3,111	620.800	1,931,308.80	
TRUIST FINANCIAL CORP	74,318	62.550	4,648,590.90	
US BANCORP	78,364	57.130	4,476,935.32	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	60.180	577,728.00	
WELLS FARGO & CO	222,862	56.150	12,513,701.30	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	49.340	993,658.26	
AMERICAN EXPRESS CO	36,796	195.710	7,201,345.16	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,380	299.400	1,910,172.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	19,982	65.230	1,303,425.86	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	57.350	2,554,770.45	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	72,405	313.550	22,702,587.75	
BLACKROCK INC	8,252	762.500	6,292,150.00	
BLACKSTONE INC	37,250	122.630	4,567,967.50	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	154.360	3,651,231.44	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	45.580	460,084.52	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	118.430	670,432.23	
CME GROUP INC	19,696	238.850	4,704,389.60	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,027	191.920	389,021.84	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	123.080	2,021,589.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	33.220	758,080.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	405.680	786,613.52	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	30.110	430,512.78	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	44.280	139,880.52	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,167	349.060	6,341,373.02	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	30,781	123.250	3,793,758.25	
INVESCO LTD	18,328	22.390	410,363.92	
KKR & CO INC	28,569	58.410	1,668,715.29	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	374.880	716,770.56	
MOODY'S CORP	9,247	323.140	2,988,075.58	
MORGAN STANLEY	75,499	96.150	7,259,228.85	
MSCI INC	4,383	531.480	2,329,476.84	
NASDAQ INC	6,509	171.880	1,118,766.92	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	118.450	1,305,674.35	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,639	108.980	1,050,458.22	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	9,737	12.250	119,278.25	
S&P GLOBAL INC	13,322	381.490	5,082,209.78	
SCHWAB (CHARLES) CORP	79,993	86.020	6,880,997.86	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	58.940	323,050.14	
SOFI TECHNOLOGIES INC	27,739	12.180	337,861.02	
STATE STREET CORP	20,939	93.650	1,960,937.35	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	43.660	1,402,009.92	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	143.420	1,766,073.88	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	81.870	427,361.40	
UPSTART HOLDINGS INC	1,044	139.630	145,773.72	
AFLAC INC	34,185	63.200	2,160,492.00	
ALLEGHANY CORP	689	680.360	468,768.04	
ALLSTATE CORP	16,419	122.640	2,013,626.16	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	135.620	479,959.18	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	44,745	61.380	2,746,448.10	

AON PLC-CLASS A	12,005	281.040	3,373,885.20	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	46.970	961,757.72	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,028	153.500	1,692,798.00	
ASSURANT INC	3,114	166.020	516,986.28	
BROWN & BROWN INC	14,273	65.630	936,736.99	
CHUBB LTD	23,561	203.630	4,797,726.43	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,858	126.250	992,072.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	180.220	232,123.36	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	302.760	625,199.40	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	47.230	658,244.51	
GLOBE LIFE INC	4,333	104.640	453,405.12	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	70.620	1,294,535.22	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	70.320	610,166.64	
LOEWS CORP	12,727	61.000	776,347.00	
MARKEL CORP	702	1,250.390	877,773.78	
MARSH & MCLENNAN COS	28,143	151.150	4,253,814.45	
METLIFE INC	39,703	69.810	2,771,666.43	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	72.820	1,028,509.68	
PROGRESSIVE CORP	32,839	105.230	3,455,647.97	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	114.250	2,368,174.00	
TRAVELERS COS INC/THE	13,126	170.590	2,239,164.34	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	223.170	1,522,688.91	
WR BERKLEY CORP	7,428	89.760	666,737.28	
CBRE GROUP INC - A	18,244	99.800	1,820,751.20	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	5.710	451,661.00	
ZILLOW GROUP INC - A	3,154	62.230	196,273.42	
ZILLOW GROUP INC - C	7,906	62.680	495,548.08	
ACCENTURE PLC-CL A	34,789	322.910	11,233,715.99	
ADOBE INC	26,092	457.710	11,942,569.32	
AFFIRM HOLDINGS INC	5,352	37.670	201,609.84	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,321	102.930	856,480.53	
ANSYS INC	4,983	310.790	1,548,666.57	
ASANA INC - CL A	4,435	67.180	297,943.30	
AUTODESK INC	12,331	223.390	2,754,622.09	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,443	200.460	4,699,383.78	
AVALARA INC	4,319	96.570	417,085.83	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	37.820	333,118.56	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,158	232.040	964,822.32	
BLACK KNIGHT INC	7,623	57.810	440,685.63	

BLOCK INC	27,565	104.020	2,867,311.30	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,889	142.380	838,475.82	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,400	138.220	2,128,588.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	68.990	481,481.21	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,400	132.430	847,552.00	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	101.670	659,838.30	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,673	103.810	1,315,584.13	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS- A	29,348	85.920	2,521,580.16	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	119.590	417,369.10	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,874	169.850	1,677,098.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,055	146.420	300,893.10	
DATADOG INC - CLASS A	10,423	165.810	1,728,237.63	
DOCUSIGN INC	10,078	115.000	1,158,970.00	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	23.580	391,050.72	
DYNATRACE INC	9,587	41.760	400,353.12	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	440.990	1,364,864.05	
FAIR ISAAC CORP	1,494	508.930	760,341.42	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,940	97.570	3,311,525.80	
FISERV INC	31,564	94.330	2,977,432.12	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	235.390	1,028,889.69	
FORTINET INC	7,360	310.540	2,285,574.40	
GARTNER INC	4,568	286.500	1,308,732.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	15,331	137.810	2,112,765.11	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	83.050	739,560.25	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	90.510	428,202.81	
HUBSPOT INC	2,561	507.580	1,299,912.38	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	48,920	124.970	6,113,532.40	
INTUIT INC	14,765	496.180	7,326,097.70	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	170.350	666,920.25	
MASTERCARD INC - A	48,256	373.700	18,033,267.20	
MICROSOFT CORP	389,149	290.730	113,137,288.77	
MONGODB INC	3,155	409.560	1,292,161.80	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	28.190	883,671.93	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,690	55.180	976,134.20	
OKTA INC	7,232	173.450	1,254,390.40	
ORACLE CORP	90,947	75.530	6,869,226.91	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	82,071	11.770	965,975.67	

PALO ALTO NETWORKS INC	5,393	499.140	2,691,862.02	
PAYCHEX INC	17,729	116.350	2,062,769.15	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	327.720	985,454.04	
PAYPAL HOLDINGS INC	61,305	105.200	6,449,286.00	
PTC INC	5,462	109.540	598,307.48	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	156.310	623,989.52	
SALESFORCE.COM INC	53,395	200.030	10,680,601.85	
SERVICENOW INC	10,696	565.750	6,051,262.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,562	286.280	3,309,969.36	
SPLUNK INC	8,252	117.540	969,940.08	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	74.690	862,370.74	
SYNOPSYS INC	8,565	293.310	2,512,200.15	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	79.410	1,913,781.00	
TWILIO INC - A	8,993	170.130	1,529,979.09	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	428.620	1,031,259.72	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	102.270	291,776.31	
VERISIGN INC	5,227	208.370	1,089,149.99	
VISA INC-CLASS A SHARES	92,369	224.610	20,747,001.09	
VMWARE INC-CLASS A	10,605	124.400	1,319,262.00	
WESTERN UNION CO	21,840	19.810	432,650.40	
WIX.COM LTD	3,194	88.370	282,253.78	
WORKDAY INC-CLASS A	10,736	216.710	2,326,598.56	
ZENDESK INC	6,067	116.650	707,715.55	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,049	129.380	1,558,899.62	
ZSCALER INC	4,551	261.940	1,192,088.94	
AMPHENOL CORP-CL A	31,396	75.480	2,369,770.08	
APPLE INC	900,643	168.880	152,100,589.84	
ARISTA NETWORKS INC	12,952	129.230	1,673,786.96	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	125.160	516,910.80	
CDW CORP/DE	7,404	182.280	1,349,601.12	
CISCO SYSTEMS INC	231,143	55.770	12,890,845.11	
COGNEX CORP	8,698	61.650	536,231.70	
CORNING INC	45,688	41.360	1,889,655.68	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,550	59.260	862,233.00	
F5 INC	2,909	200.650	583,690.85	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	63,881	17.240	1,101,308.44	
HP INC	65,388	36.420	2,381,430.96	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	138.080	245,230.08	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	34.380	600,274.80	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	9,542	165.500	1,579,201.00	

MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	215.910	1,988,962.92	
NETAPP INC	13,273	91.070	1,208,772.11	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	111.190	1,312,042.00	
TE CONNECTIVITY LTD	17,425	144.300	2,514,427.50	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,371	419.980	995,772.58	
TRIMBLE INC	12,759	68.060	868,377.54	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	56.450	1,043,873.40	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,737	423.500	1,159,119.50	
ADVANCED MICRO DEVICES	89,627	112.370	10,071,385.99	
ANALOG DEVICES INC	29,273	160.430	4,696,267.39	
APPLIED MATERIALS INC	49,124	136.470	6,703,952.28	
BROADCOM INC	22,497	579.000	13,025,763.00	
ENPHASE ENERGY INC	7,293	148.370	1,082,062.41	
ENTEGRIS INC	7,892	133.500	1,053,582.00	
INTEL CORP	222,854	47.570	10,601,164.78	
KLA CORP	8,157	366.050	2,985,869.85	
LAM RESEARCH CORP	7,779	580.610	4,516,565.19	
MARVELL TECHNOLOGY INC	45,111	67.550	3,047,248.05	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,704	71.170	2,042,863.68	
MICRON TECHNOLOGY INC	61,223	93.730	5,738,431.79	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,243	461.880	1,035,996.84	
NVIDIA CORP	136,508	245.070	33,454,015.56	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	187.610	2,712,277.77	
ON SEMICONDUCTOR	24,630	60.190	1,482,479.70	
QORVO INC	6,042	133.040	803,827.68	
QUALCOMM INC	60,894	166.800	10,157,119.20	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	136.420	1,194,629.94	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	263.260	693,426.84	
TERADYNE INC	8,542	116.000	990,872.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	49,876	164.650	8,212,083.40	
AT&T INC	385,489	23.760	9,159,218.64	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	28.170	593,795.43	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	28.140	237,276.48	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	9.780	486,633.24	
T-MOBILE US INC	33,335	124.550	4,151,874.25	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	227,372	53.580	12,182,591.76	
AES CORP	33,656	21.470	722,594.32	
ALLIANT ENERGY CORP	12,101	56.620	685,158.62	
AMEREN CORPORATION	14,760	84.510	1,247,367.60	

AMERICAN ELECTRIC POWER	27,967	85.490	2,390,898.83	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	148.060	1,516,282.46	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	106.660	742,886.90	
CENTERPOINT ENERGY INC	32,003	26.810	858,000.43	
CMS ENERGY CORP	16,996	62.400	1,060,550.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,399	81.450	1,498,598.55	
CONSTELLATION ENERGY	18,329	45.290	830,120.41	
DOMINION ENERGY INC	44,347	79.140	3,509,621.58	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	118.550	1,249,042.80	
DUKE ENERGY CORP	42,041	98.730	4,150,707.93	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	60.250	1,307,485.25	
ENERGY CORP	10,866	104.950	1,140,386.70	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	45.930	638,840.37	
EVERGY INC	11,273	61.050	688,216.65	
EVERSOURCE ENERGY	19,764	82.280	1,626,181.92	
EXELON CORP	54,987	41.750	2,295,707.25	
FIRSTENERGY CORP	31,966	41.120	1,314,441.92	
NEXTERA ENERGY INC	105,966	75.380	7,987,717.08	
NISOURCE INC	18,919	28.570	540,515.83	
NRG ENERGY INC	13,547	38.320	519,121.04	
P G & E CORP	76,538	11.590	887,075.42	
PPL CORP	39,561	28.140	1,113,246.54	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	64.730	1,762,662.63	
SEMPRA ENERGY	17,453	135.390	2,362,961.67	
SOUTHERN CO/THE	58,115	64.790	3,765,270.85	
UGI CORP	10,588	38.580	408,485.04	
VISTRA CORP	25,777	21.490	553,947.73	
WEC ENERGY GROUP INC	16,438	89.390	1,469,392.82	
XCEL ENERGY INC	29,237	66.100	1,932,565.70	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,952	80.970	3,558,793.44	
ALPHABET INC-CL A	16,412	2,650.780	43,504,601.36	
ALPHABET INC-CL C	15,698	2,646.170	41,539,576.66	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	18.940	523,842.52	
CABLE ONE INC	246	1,462.580	359,794.68	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,002	597.830	4,186,005.66	
COMCAST CORP-CLASS A	251,448	46.770	11,760,222.96	
DISCOVERY INC - A	7,075	29.870	211,330.25	
DISCOVERY INC-C	17,417	29.760	518,329.92	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	29.880	386,557.56	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	130.400	2,001,900.80	

	FOX CORP - CLASS A	16,962	42.910	727,839.42	
	FOX CORP - CLASS B	8,773	38.660	339,164.18	
	IAC/INTERACTIVECORP	3,974	115.010	457,049.74	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	36.120	708,891.12	
	LIBERTY BROADBAND-A	1,312	146.370	192,037.44	
	LIBERTY BROADBAND-C	8,196	148.810	1,219,646.76	
	LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	10,288	62.980	647,938.24	
	LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	4,141	51.190	211,977.79	
	LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	7,648	51.110	390,889.28	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,770	116.480	1,021,529.60	
	MATCH GROUP INC	13,729	111.880	1,536,000.52	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	130,127	207.710	27,028,679.17	
	NETFLIX INC	24,263	386.670	9,381,774.21	
	NEWS CORP - CLASS A	23,102	22.760	525,801.52	
	OMNICOM GROUP	10,417	84.460	879,819.82	
	PARAMOUNT GLOBAL	32,381	29.350	950,382.35	
	PINTEREST INC- CLASS A	28,563	24.690	705,220.47	
	ROKU INC	6,012	144.710	869,996.52	
	SEA LTD-ADR	7,673	137.650	1,056,188.45	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.030	407,965.68	
	SNAP INC - A	58,789	39.450	2,319,226.05	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,707	162.130	925,275.91	
	TWITTER INC	45,558	35.430	1,614,119.94	
	WALT DISNEY CO/THE	99,447	152.950	15,210,418.65	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	12,699	53.300	676,856.70	
	アメリカ・ドル小計	17,259,341		2,094,145,672.42 (240,722,045,045)	
カナダ・ ドル	CAMECO CORP	18,890	26.740	505,118.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	64,374	68.490	4,408,975.26	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	20.150	1,512,459.00	
	ENBRIDGE INC	112,831	52.750	5,951,835.25	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	56.080	728,983.92	
	KEYERA CORP	11,374	30.360	345,314.64	
	PARKLAND CORP	7,666	34.110	261,487.26	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	42.310	1,361,197.32	
	SUNCOR ENERGY INC	78,642	37.680	2,963,230.56	
	TC ENERGY CORP	53,918	66.600	3,590,938.80	

TOURMALINE OIL CORP	16,638	46.600	775,330.80	
AGNICO EAGLE MINES LTD	24,068	71.350	1,717,251.80	
BARRICK GOLD CORP	102,105	29.530	3,015,160.65	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	63.960	556,771.80	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	34.400	1,089,516.80	
FRANCO-NEVADA CORP	10,165	189.950	1,930,841.75	
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	11.460	374,719.08	
KINROSS GOLD CORP	63,501	7.380	468,637.38	
LUNDIN MINING CORP	46,446	12.070	560,603.22	
NUTRIEN LTD	31,389	98.030	3,077,063.67	
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	31.260	367,711.38	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,814	45.710	1,134,247.94	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	123.630	548,669.94	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	56.030	1,363,490.05	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	12.660	215,321.28	
CAE INC	12,891	32.780	422,566.98	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	110.700	425,420.10	
WSP GLOBAL INC	6,141	155.900	957,381.90	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	36.680	363,608.84	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	72.880	413,010.96	
THOMSON REUTERS CORP	9,710	127.960	1,242,491.60	
AIR CANADA	12,083	24.630	297,604.29	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	38,687	160.330	6,202,686.71	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	50,607	93.240	4,718,596.68	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	131.930	672,447.21	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	99.370	1,622,811.47	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	49.450	448,313.70	
RESTAURANT BRANDS INTERN	14,510	72.420	1,050,814.20	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	188.680	566,228.68	
DOLLARAMA INC	17,025	64.170	1,092,494.25	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	44,270	50.800	2,248,916.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	39.270	359,241.96	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	98.820	858,054.06	
METRO INC/CN	13,109	67.380	883,284.42	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	138.480	690,184.32	
SAPUTO INC	13,425	30.870	414,429.75	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	31.380	516,106.86	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	10.350	116,447.85	
BANK OF MONTREAL	35,424	146.950	5,205,556.80	

BANK OF NOVA SCOTIA	66,677	92.020	6,135,617.54	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	23,513	160.780	3,780,420.14	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	100.650	1,975,356.90	
ROYAL BANK OF CANADA	77,035	141.460	10,897,371.10	
TORONTO-DOMINION BANK	98,488	106.590	10,497,835.92	
BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A	76,223	69.330	5,284,540.59	
IGM FINANCIAL INC	4,949	45.420	224,783.58	
ONEX CORPORATION	4,217	87.870	370,547.79	
TMX GROUP LTD	3,142	127.300	399,976.60	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	648.320	903,109.76	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	39.280	557,776.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	80.620	391,087.62	
INTACT FINANCIAL CORP	10,095	183.470	1,852,129.65	
MANULIFE FINANCIAL CORP	110,844	26.980	2,990,571.12	
POWER CORP OF CANADA	31,768	40.890	1,298,993.52	
SUN LIFE FINANCIAL INC	30,550	68.300	2,086,565.00	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	178.820	449,911.12	
BLACKBERRY LTD	25,993	8.700	226,139.10	
CGI INC	11,493	105.720	1,215,039.96	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,098	2,046.840	2,247,430.32	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	35.580	226,395.54	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	3,084	71.650	220,968.60	
OPEN TEXT CORP	13,665	54.900	750,208.50	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,234	837.090	5,218,419.06	
BCE INC	5,509	66.770	367,835.93	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	18,236	67.270	1,226,735.72	
TELUS CORP	15,222	31.920	485,886.24	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	31,359	17.810	558,503.79	
ALTAGAS LTD	17,347	27.780	481,899.66	
BROOKFIELD RENEWABLE COR- A	6,336	44.430	281,508.48	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	35.070	257,554.08	
EMERA INC	14,279	58.700	838,177.30	
FORTIS INC	25,895	57.830	1,497,507.85	
HYDRO ONE LTD	18,821	31.440	591,732.24	
NORTHLAND POWER INC	10,870	37.270	405,124.90	
QUEBECOR INC -CL B	9,953	30.540	303,964.62	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	37.390	1,018,204.48	

カナダ・ドル小計		2,145,404		139,129,408.06 (12,578,689,783)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	10,927	32.130	351,084.51	
	SANTOS LTD	166,651	7.070	1,178,222.57	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,025	25.800	361,845.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	50,354	27.720	1,395,812.88	
	BHP GROUP LTD	162,972	47.970	7,817,766.84	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	19.030	484,541.86	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.080	344,433.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,448	20.500	1,813,184.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	26,108	46.690	1,218,982.52	
	NEWCREST MINING LTD	42,131	23.850	1,004,824.35	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	9.440	621,567.36	
	ORICA LTD	17,981	14.960	268,995.76	
	RIO TINTO LTD	19,336	119.940	2,319,159.84	
	SOUTH32 LTD	276,348	4.500	1,243,566.00	
	REECE LTD	19,309	20.390	393,710.51	
	BRAMBLES LTD	74,638	10.100	753,843.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.680	347,539.20	
	QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.390	247,029.09	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	40.300	1,239,184.70	
	CROWN RESORTS LTD	21,863	12.470	272,631.61	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	103.170	391,426.98	
	IDP EDUCATION LTD	10,940	27.960	305,882.40	
	TABCORP HOLDINGS LTD	139,785	5.360	749,247.60	
	WESFARMERS LTD	60,628	50.810	3,080,508.68	
	COLES GROUP LTD	73,552	16.630	1,223,169.76	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	65,607	6.590	432,350.13	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,646	34.470	2,400,697.62	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.940	435,380.16	
	COCHLEAR LTD	4,095	192.800	789,516.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	64.910	613,139.86	
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	38.100	924,229.80		
CSL LTD	26,040	277.000	7,213,080.00		
AUST AND NZ BANKING GROUP	156,874	28.220	4,426,984.28		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	96,041	98.810	9,489,811.21		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	184,003	30.850	5,676,492.55		

	WESTPAC BANKING CORP	201,731	23.490	4,738,661.19	
	ASX LTD	11,180	82.040	917,207.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	18,953	195.650	3,708,154.45	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	5,783	18.320	105,944.56	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117,187	4.750	556,638.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.210	413,204.04	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	12.650	1,022,916.95	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	11.530	737,147.49	
	COMPUTERSHARE LTD	33,563	23.220	779,332.86	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	45.260	357,961.34	
	XERO LTD	7,459	105.820	789,311.38	
	TELSTRA CORP LTD	254,603	3.900	992,951.70	
	ORIGIN ENERGY LTD	88,060	6.160	542,449.60	
	REA GROUP LTD	2,833	136.060	385,457.98	
	SEEK LTD	17,266	28.590	493,634.94	
	オーストラリア・ドル小計	3,339,057		78,370,816.96	
				(6,464,024,983)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	153,924	60.150	9,258,528.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	70,500	138.300	9,750,150.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	21.850	2,053,900.00	
	MTR CORP	84,500	42.800	3,616,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	32.550	2,278,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	48.350	5,705,300.00	
	SANDS CHINA LTD	116,000	24.000	2,784,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	16.060	1,879,020.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	23.150	2,074,240.00	
	WH GROUP LTD	581,500	5.710	3,320,365.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	31.550	5,915,625.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	166.600	6,464,080.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	67,100	437.400	29,349,540.00	
	AIA GROUP LTD	654,000	89.300	58,402,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,924	53.050	5,460,118.20	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	25.850	2,636,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.380	1,605,240.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	34.200	2,851,732.80	

	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	32.800	2,782,522.40	
	SINO LAND CO	248,200	10.420	2,586,244.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	99.200	6,745,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	47.850	1,291,950.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	21.450	1,136,850.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	36.350	3,307,850.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	50.850	1,525,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	94,100	80.000	7,528,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	12.160	7,373,690.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	71,500	50.150	3,585,725.00	
	香港・ドル小計	4,202,754		193,269,771.24 (2,848,796,428)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	6.080	428,640.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.860	419,196.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.410	421,796.06	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.785	257,087.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.730	488,136.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	102,000	36.530	3,726,060.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	181,200	13.410	2,429,892.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	32.860	2,126,042.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.650	413,020.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	136,600	3.740	510,884.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.310	188,598.00	
	UOL GROUP LTD	17,200	7.300	125,560.00	
	VENTURE CORP LTD	8,700	18.200	158,340.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,815	2.560	1,125,926.40	
	シンガポール・ドル小計	1,706,581		12,819,177.96 (1,097,321,633)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.210	509,826.31	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	29.500	921,875.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	24,028	9.600	230,668.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	81,240	4.480	363,955.20	
	MERCURY NZ LTD	26,913	5.900	158,786.70	
	MERIDIAN ENERGY LTD	88,445	5.050	446,647.25	
	ニュージーランド・ドル小計	322,587		2,631,759.26 (202,382,287)	
イギリス	BP PLC	1,097,928	3.979	4,368,655.51	

ス・ボン
ド

SHELL PLC	426,967	19.694	8,408,688.09	
ANGLO AMERICAN PLC	72,470	35.230	2,553,118.10	
ANTOFAGASTA PLC	19,439	13.730	266,897.47	
BHP GROUP LTD-DI	116,484	25.025	2,915,012.10	
CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	72.540	568,568.52	
GLENCORE PLC	539,565	4.207	2,269,949.95	
JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	17.725	178,561.65	
MONDI PLC	25,128	19.090	479,693.52	
RIO TINTO PLC	61,130	55.880	3,415,944.40	
ASHTED GROUP PLC	23,686	49.190	1,165,114.34	
BAE SYSTEMS PLC	165,753	5.944	985,235.83	
BUNZL PLC	17,064	27.400	467,553.60	
DCC PLC	5,954	62.000	369,148.00	
FERGUSON PLC	12,017	111.050	1,334,487.85	
MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.555	344,765.27	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	1.180	583,089.92	
SMITHS GROUP PLC	24,369	15.115	368,337.43	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	118.800	529,729.20	
EXPERIAN PLC	48,895	28.910	1,413,554.45	
INTERTEK GROUP PLC	8,184	51.940	425,076.96	
RELX PLC	106,284	22.410	2,381,824.44	
RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	4.997	562,677.19	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	6.026	390,279.91	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	39.760	263,887.12	
BURBERRY GROUP PLC	19,012	19.940	379,099.28	
PERSIMMON PLC	16,916	24.080	407,337.28	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.487	335,449.35	
COMPASS GROUP PLC	97,177	17.510	1,701,569.27	
ENTAIN PLC	28,865	16.990	490,416.35	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,587	50.800	487,019.60	
WHITBREAD PLC	11,282	31.430	354,593.26	
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.650	238,095.00	
KINGFISHER PLC	109,678	3.189	349,763.14	
NEXT PLC	6,860	69.180	474,574.80	
OCADO GROUP PLC	27,379	13.605	372,491.29	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.782	315,701.36	
TESCO PLC	399,930	2.937	1,174,594.41	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	18.990	318,481.29	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	118,959	34.355	4,086,836.44	

COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	24.310	211,594.24	
DIAGEO PLC	126,868	36.160	4,587,546.88	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	17.535	876,802.60	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	40,047	61.520	2,463,691.44	
UNILEVER PLC	141,843	37.995	5,389,324.78	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	12.085	536,030.17	
ASTRAZENECA PLC	85,239	89.180	7,601,614.02	
GLAXOSMITHKLINE PLC	272,706	15.796	4,307,663.97	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	19.895	150,823.99	
BARCLAYS PLC	904,741	1.926	1,742,531.16	
HSBC HOLDINGS PLC	1,107,975	5.401	5,984,172.97	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,817,021	0.512	1,954,314.75	
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.403	760,037.66	
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	5.580	817,810.38	
3I GROUP PLC	49,338	13.205	651,508.29	
ABRDN PLC	123,263	2.317	285,600.37	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	12.880	252,087.36	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,716	67.540	1,196,538.64	
M&G PLC	133,064	2.134	283,958.57	
SCHRODERS PLC	6,213	32.160	199,810.08	
ST JAMES' S PLACE PLC	33,823	15.160	512,756.68	
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	29.930	345,242.55	
AVIVA PLC	229,027	4.323	990,083.72	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.726	854,974.46	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.520	240,268.52	
PRUDENTIAL PLC	143,405	11.835	1,697,198.17	
AVEVA GROUP PLC	6,037	26.900	162,395.30	
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	6.852	383,622.92	
HALMA PLC	19,839	23.150	459,272.85	
BT GROUP PLC	469,907	1.951	916,788.55	
VODAFONE GROUP PLC	1,546,057	1.379	2,132,012.60	
NATIONAL GRID PLC	191,851	10.786	2,069,304.88	
SEVERN TRENT PLC	12,418	28.290	351,305.22	
SSE PLC	55,879	16.055	897,137.34	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.505	441,577.67	
AUTO TRADER GROUP PLC	59,819	6.340	379,252.46	
INFORMA PLC	78,152	6.090	475,945.68	
PEARSON PLC	39,623	6.232	246,930.53	
WPP PLC	63,987	11.925	763,044.97	

イギリス・ポンド小計		15,872,242		103,068,489.73 (16,121,973,165)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	28,711	33.400	958,947.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	557.000	773,673.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	33.490	2,223,836.47	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,150	34.450	2,416,667.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	21.350	1,167,289.90	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	124.200	1,148,725.80	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	284.400	608,616.00	
	NICE LTD	3,251	811.500	2,638,186.50	
イスラエル・シュケル小計		235,967		11,935,942.57 (427,232,741)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	17.040	172,121.04	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	938.500	334,106.00	
	GIVAUDAN-REG	521	3,681.000	1,917,801.00	
	HOLCIM LTD	27,239	50.700	1,381,017.30	
	SIKA AG-REG	7,800	302.800	2,361,840.00	
	ABB LTD-REG	90,836	32.000	2,906,752.00	
	GEBERIT AG-REG	1,986	607.400	1,206,296.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	206.000	193,846.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	210.500	448,786.00	
	VAT GROUP AG	1,436	346.600	497,717.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	47.050	429,001.90	
	SGS SA-REG	308	2,603.000	801,724.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG- REG	2,981	252.300	752,106.30	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	28,358	130.400	3,697,883.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	286.800	492,148.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	55.400	139,386.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	183	2,106.000	385,398.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	59	10,060.000	593,540.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	5	104,100.000	520,500.00	
	NESTLE SA-REG	153,567	117.380	18,025,694.46	
	ALCON INC	26,585	71.340	1,896,573.90	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,660	328.500	873,810.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,468.000	779,508.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	322	511.000	164,542.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,984	613.800	2,445,379.20		
NOVARTIS AG-REG	120,501	79.980	9,637,669.98		
ROCHE HOLDING AG-BR	1,921	374.000	718,454.00		

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	38,499	345.000	13,282,155.00	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	162.050	427,487.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG- REG	145,488	8.364	1,216,861.63	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	58.680	736,434.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,256.500	1,511,569.50	
	UBS GROUP AG-REG	191,189	18.740	3,582,881.86	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	158.400	392,040.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	590.600	1,083,160.40	
	SWISS RE AG	17,411	98.120	1,708,367.32	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,094	434.800	3,519,271.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	89.150	348,219.90	
	TEMENOS AG - REG	3,743	101.150	378,604.45	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	10,426	68.300	712,095.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	545.200	762,734.80	
	スイス・フラン小計	939,518		83,435,487.24 (10,421,092,356)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	486.300	2,679,026.70	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	397.200	4,572,566.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	513	2,687.000	1,378,431.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	54,296	170.950	9,281,901.20	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	168	22,240.000	3,736,320.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	23,370.000	7,268,070.00	
	DSV A/S	10,950	1,236.500	13,539,675.00	
	PANDORA A/S	5,888	726.600	4,278,220.80	
	CARLSBERG AS-B	5,585	1,070.000	5,975,950.00	
	AMBU A/S-B	8,356	113.600	949,241.60	
	COLOPLAST-B	6,399	927.800	5,936,992.20	
	DEMANT A/S	4,455	274.900	1,224,679.50	
	GN STORE NORD A/S	6,484	351.300	2,277,829.20	
	GENMAB A/S	3,688	2,157.000	7,955,016.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	92,387	672.900	62,167,212.30	
	DANSKE BANK A/S	39,103	126.450	4,944,574.35	
TRYG A/S	16,989	152.500	2,590,822.50		
ORSTED A/S	10,423	671.000	6,993,833.00		
	デンマーク・クローネ小計	283,016		147,750,361.75 (2,593,018,849)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	6,316	262.900	1,660,476.40	
	EQUINOR ASA	51,871	267.250	13,862,524.75	
	NORSK HYDRO ASA	83,294	76.960	6,410,306.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	444.900	4,006,324.50	
	MOWI ASA	23,318	232.800	5,428,430.40	

	ORKLA ASA	46,955	83.000	3,897,265.00	
	DNB BANK ASA	45,957	208.800	9,595,821.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	213.400	2,435,320.80	
	TELENOR ASA	34,937	136.750	4,777,634.75	
	ADEVINTA ASA	15,540	84.200	1,308,468.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	205.200	1,124,496.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,338	231.400	772,413.20	
	ノルウェー・クローネ小計	337,423		55,279,481.64	
				(712,552,518)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	8,581	331.400	2,843,743.40	
	BOLIDEN AB	13,086	402.000	5,260,572.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	163.850	5,631,524.50	
	ALFA LAVAL AB	18,697	292.800	5,474,481.60	
	ASSA ABLOY AB-B	52,119	268.500	13,993,951.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,342	502.600	18,768,089.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	22,320	443.900	9,907,848.00	
	EPIROC AB-A	34,230	192.100	6,575,583.00	
	EPIROC AB-B	19,836	165.500	3,282,858.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	119.750	2,226,511.75	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	269.900	2,219,387.70	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	206.900	3,134,328.10	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	73,764	83.400	6,151,917.60	
	SANDVIK AB	61,070	238.800	14,583,516.00	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	238.900	4,105,018.70	
	SKF AB-B SHARES	20,607	184.350	3,798,900.45	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	213.400	2,834,592.20	
	VOLVO AB-B SHS	80,338	209.350	16,818,760.30	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	116.900	1,884,778.70	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	181.300	2,094,921.50	
	EVOLUTION AB	9,021	1,047.200	9,446,791.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	176.580	7,089,333.84	
	SWEDISH MATCH AB	84,640	72.020	6,095,772.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	264.200	9,531,279.20	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	360.600	4,742,250.60	
	NORDEA BANK ABP	184,357	107.700	19,855,248.90	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	88,317	119.200	10,527,386.40	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	95.580	7,423,507.44		
SWEDBANK AB - A SHARES	45,921	167.540	7,693,604.34		
EQT AB	15,443	334.400	5,164,139.20		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	9,851	288.200	2,839,058.20		

	INDUSTRI VARDEN AB-C SHS	10,642	282.800	3,009,557.60	
	INVESTOR AB-A SHS	27,415	211.400	5,795,531.00	
	INVESTOR AB-B SHS	101,275	196.540	19,904,588.50	
	KINNEVIK AB - B	12,465	246.900	3,077,608.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	472.600	1,591,716.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	598.200	3,184,218.60	
	SAGAX AB-B	9,651	262.400	2,532,422.40	
	SINCH AB	27,690	76.160	2,108,870.40	
	ERICSSON LM-B SHS	159,685	98.210	15,682,663.85	
	HEXAGON AB-B SHS	103,110	125.000	12,888,750.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	131.450	3,356,838.65	
	TELIA CO AB	143,404	37.405	5,364,026.62	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	78.760	2,363,745.12	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,840,639		302,860,194.36 (3,725,180,391)	
ユーロ	ENI SPA	136,972	13.334	1,826,384.64	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	9.990	258,940.80	
	NESTE OYJ	24,995	36.920	922,815.40	
	OMV AG	8,389	56.000	469,784.00	
	REPSOL SA	79,358	11.870	941,979.46	
	TENARIS SA	25,963	11.520	299,093.76	
	TOTALENERGIES SE	135,430	50.650	6,859,529.50	
	AIR LIQUIDE SA	26,340	150.320	3,959,428.80	
	AKZO NOBEL N.V.	9,886	91.780	907,337.08	
	ARCELORMITTAL	36,689	27.040	992,070.56	
	ARKEMA	3,250	128.250	416,812.50	
	BASF SE	49,439	67.850	3,354,436.15	
	COVESTRO AG	11,797	54.100	638,217.70	
	CRH PLC	43,426	43.700	1,897,716.20	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	29.380	321,769.76	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	37.860	127,588.20	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	66.180	574,243.86	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,422	163.350	1,539,083.70	
	LANXESS AG	4,409	53.000	233,677.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	48.160	622,275.36	
	SOLVAY SA	3,758	109.750	412,440.50	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	18.320	553,886.88	
	SYMRISE AG	6,785	104.650	710,050.25	
	UMICORE	10,288	36.590	376,437.92	
	UPM-KYMMENE OYJ	28,055	33.070	927,778.85	
	VOESTALPINE AG	7,382	31.100	229,580.20	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,931	22.430	290,042.33	
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	12,931	0.445	5,754.29	
AIRBUS SE	32,094	116.320	3,733,174.08	
ALSTOM	17,665	25.840	456,463.60	
BOUYGUES SA	11,049	32.430	358,319.07	
BRENNTAG SE	7,392	78.680	581,602.56	
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	14.100	772,327.50	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	26,413	61.810	1,632,587.53	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,340	31.500	735,210.00	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	116.900	201,068.00	
EIFFAGE	4,989	97.940	488,622.66	
FERROVIAL SA	24,693	25.290	624,485.97	
GEA GROUP AG	8,178	41.260	337,424.28	
IMCD NV	3,214	141.600	455,102.40	
KINGSPAN GROUP PLC	8,978	91.400	820,589.20	
KION GROUP AG	3,179	79.860	253,874.94	
KNORR-BREMSE AG	3,881	91.300	354,335.30	
KONE OYJ-B	17,618	54.100	953,133.80	
LEGRAND SA	15,079	86.340	1,301,920.86	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	207.500	613,577.50	
PRYSMIAN SPA	12,526	29.260	366,510.76	
RATIONAL AG	350	682.000	238,700.00	
SAFRAN SA	18,212	114.360	2,082,724.32	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,330	146.400	4,293,912.00	
SIEMENS AG-REG	42,221	139.500	5,889,829.50	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	18.965	376,550.07	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	17.000	195,194.00	
THALES SA	5,403	84.360	455,797.08	
VINCI SA	29,309	102.180	2,994,793.62	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	10.280	275,020.84	
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.580	437,941.86	
RANDSTAD NV	6,241	64.940	405,290.54	
TELEPERFORMANCE	3,420	315.000	1,077,300.00	
WOLTERS KLUWER	14,578	86.960	1,267,702.88	
ADP	1,346	139.800	188,170.80	
AENA SME SA	4,377	154.350	675,589.95	
ATLANTIA SPA	26,501	16.795	445,084.29	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	7.672	254,311.45	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,453	49.955	2,720,199.61	
GETLINK SE	22,311	14.415	321,613.06	
INPOST SA	10,902	5.933	64,681.56	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	95.970	1,715,271.81	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,564	80.800	207,171.20	
CONTINENTAL AG	5,578	90.230	503,302.94	
FAURECIA	6,090	41.040	249,933.60	
FERRARI NV	6,949	196.750	1,367,215.75	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	46,680	76.060	3,550,480.80	
MICHELIN (CGDE)	8,746	139.250	1,217,880.50	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PRF	7,765	86.960	675,244.40	
RENAULT SA	8,830	36.340	320,882.20	
STELLANTIS NV	105,516	16.850	1,777,944.60	
VALEO	14,444	26.620	384,499.28	
VOLKSWAGEN AG	1,960	250.000	490,000.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,563	184.000	1,943,592.00	
ADIDAS AG	10,146	230.550	2,339,160.30	
ESSILORLUXOTTICA	15,704	166.240	2,610,632.96	
HERMES INTERNATIONAL	1,777	1,255.000	2,230,135.00	
KERING	4,123	663.900	2,737,259.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,192	684.100	10,392,847.20	
MONCLER SPA	12,209	55.640	679,308.76	
PUMA SE	6,459	90.360	583,635.24	
SEB SA	1,127	135.400	152,595.80	
ACCOR SA	10,451	33.470	349,794.97	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	8,869	131.950	1,170,264.55	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.850	218,962.25	
SODEXO SA	3,900	79.840	311,376.00	
DELIVERY HERO SE	8,530	51.240	437,077.20	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	58,328	25.460	1,485,030.88	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	38.685	360,041.29	
PROSUS NV	51,018	66.940	3,415,144.92	
ZALANDO SE	12,367	62.500	772,937.50	
CARREFOUR SA	35,990	18.015	648,359.85	
COLRUYT SA	2,164	36.240	78,423.36	
HELLOFRESH SE	9,790	50.620	495,569.80	
JERONIMO MARTINS	16,397	20.070	329,087.79	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	26.810	359,307.62	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,657	26.720	1,487,155.04	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,943	55.870	2,287,485.41	
DANONE	37,154	55.440	2,059,817.76	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.495	294,080.39	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	79.250	488,814.00	
HEINEKEN NV	14,659	98.460	1,443,325.14	
JDE PEET'S NV	6,660	26.950	179,487.00	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	110.000	901,230.00	
PERNOD RICARD SA	11,108	193.200	2,146,065.60	
REMY COINTREAU	1,273	176.800	225,066.40	
BEIERSDORF AG	5,138	90.320	464,064.16	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	71.300	425,946.20	
HENKEL AG & CO KGAA VOR- PREF	9,043	73.920	668,458.56	
L'OREAL	13,629	356.600	4,860,101.40	
AMPLIFON SPA	7,567	35.680	269,990.56	
BIOMERIEUX	2,791	102.150	285,100.65	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	136.750	295,516.75	
DIASORIN SPA	1,313	120.750	158,544.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,118	59.200	658,185.60	
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,363	37.075	792,033.22	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	29.820	1,572,319.14	
ORPEA	2,695	38.210	102,975.95	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	411.700	538,503.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	54.240	890,946.24	
ARGENX SE	2,644	255.900	676,599.60	
BAYER AG-REG	55,293	54.080	2,990,245.44	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	86.500	606,365.00	
GRIFOLS SA	15,169	14.475	219,571.27	
IPSEN	1,498	100.100	149,949.80	
MERCK KGAA	6,832	181.000	1,236,592.00	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	36.470	228,338.67	
QIAGEN N.V.	12,543	43.340	543,613.62	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,578	45.810	209,718.18	
SANOFI	61,568	93.630	5,764,611.84	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	353.000	548,915.00	
UCB SA	6,623	86.560	573,286.88	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	12.848	369,855.37	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	352,889	5.748	2,028,405.97	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	927,220	3.340	3,096,914.80	

BNP PARIBAS	61,293	62.020	3,801,391.86	
CAIXABANK SA	277,723	3.234	898,156.18	
COMMERZBANK AG	46,644	8.853	412,939.33	
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	13.144	960,852.68	
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	40.940	793,540.02	
FINECOBANK SPA	32,034	15.820	506,777.88	
ING GROEP NV	205,237	12.728	2,612,256.53	
INTESA SANPAOLO	905,032	2.739	2,478,882.64	
KBC GROUP NV	13,092	74.900	980,590.80	
MEDIOBANCA SPA	31,303	10.135	317,255.90	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,066	25.000	176,650.00	
SOCIETE GENERALE SA	41,025	32.990	1,353,414.75	
UNICREDIT SPA	112,845	14.680	1,656,564.60	
AMUNDI SA	3,955	67.500	266,962.50	
DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED	113,478	13.690	1,553,513.82	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,701	157.750	1,688,082.75	
EURAZEO SE	1,792	71.550	128,217.60	
EURONEXT NV	5,502	81.850	450,338.70	
EXOR NV	6,204	72.840	451,899.36	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	93.760	554,496.64	
SOFINA	804	344.200	276,736.80	
WENDEL	1,082	92.500	100,085.00	
AEGON NV	91,609	4.832	442,654.68	
AGEAS	11,247	43.450	488,682.15	
ALLIANZ SE-REG	22,868	222.500	5,088,130.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	18.610	1,204,606.69	
AXA SA	105,430	27.190	2,866,641.70	
CNP ASSURANCES	8,978	21.790	195,630.62	
HANNOVER RUECK SE	3,058	174.600	533,926.80	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	7,364	263.500	1,940,414.00	
NN GROUP NV	14,069	50.680	713,016.92	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	11.135	295,767.87	
SAMPO OYJ-A SHS	28,454	43.620	1,241,163.48	
AROUNDTOWN SA	52,560	5.602	294,441.12	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	114.300	420,624.00	
VONOVIA SE	40,320	47.000	1,895,040.00	
ADYEN NV	1,069	1,925.000	2,057,825.00	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	61.920	1,521,374.40	
BECHTLE AG	4,305	47.040	202,507.20	
CAPGEMINI SE	8,961	185.700	1,664,057.70	

DASSAULT SYSTEMES SE	35,115	41.570	1,459,730.55	
EDENRED	12,139	38.720	470,022.08	
NEMETSCHKE SE	3,011	77.760	234,135.36	
NEXI SPA	30,853	12.590	388,439.27	
SAP SE	57,251	105.260	6,026,240.26	
WORLDLINE SA	12,774	44.650	570,359.10	
NOKIA OYJ	280,161	5.092	1,426,579.81	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	288.000	707,040.00	
ASML HOLDING NV	22,612	578.200	13,074,258.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,533	32.330	2,312,661.89	
STMICROELECTRONICS NV	37,804	39.130	1,479,270.52	
CELLNEX TELECOM SA	29,081	39.100	1,137,067.10	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	183,030	17.236	3,154,705.08	
ELISA OYJ	8,681	50.680	439,953.08	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	8.874	140,244.69	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	3.081	534,870.84	
ORANGE	106,132	10.934	1,160,447.28	
PROXIMUS	10,895	18.060	196,763.70	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.411	286,201.90	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.648	124,177.96	
TELEFONICA SA	284,827	4.361	1,242,130.54	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	34.560	182,096.64	
E.ON SE	126,998	12.140	1,541,755.72	
EDF	32,658	8.336	272,237.08	
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	18.610	275,260.51	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	145,910	4.187	610,925.17	
ELIA GROUP SA/NV	2,063	117.300	241,989.90	
ENAGAS SA	14,471	18.440	266,845.24	
ENDESA SA	14,104	18.770	264,732.08	
ENEL SPA	431,652	6.482	2,797,968.26	
ENGIE	94,886	14.404	1,366,737.94	
FORTUM OYJ	24,312	23.190	563,795.28	
IBERDROLA SA	317,927	9.408	2,991,057.21	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,930	24.320	314,457.60	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.915	399,735.28	
RWE AG	34,673	38.600	1,338,377.80	
SNAM SPA	106,707	4.806	512,833.84	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	87,142	6.732	586,639.94	
UNIPER SE	4,697	39.000	183,183.00	

VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,122	32.330	1,167,824.26	
VERBUND AG	3,190	96.100	306,559.00	
BOLLORE	39,433	4.864	191,802.11	
PUBLICIS GROUPE	13,301	62.660	833,440.66	
SCOUT24 SE	4,671	52.140	243,545.94	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	44.080	209,159.60	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	38,496	20.355	783,586.08	
VIVENDI SE	38,496	11.520	443,473.92	
ユーロ小計	10,325,107		260,611,771.27 (34,028,078,975)	
合計	58,809,636		331,942,389,153 (331,942,389,153)	

(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	607銘柄	69.7%	72.5%
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.6%	3.8%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	1.9%	1.9%
香港・ドル	株式	28銘柄	0.8%	0.9%
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	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.7%	4.9%
イスラエル・シェケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	41銘柄	3.0%	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	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	1.1%	1.1%
ユーロ	株式	229銘柄	9.9%	10.3%

(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	343,586.32	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,662.00	1,425,208.62	
		AMERICAN TOWER CORP	24,648.00	5,636,258.16	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	637,270.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,344.00	1,734,212.16	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835.00	956,026.70	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	972,436.47	
		CROWN CASTLE INTL CORP	23,210.00	3,791,817.70	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,126.00	2,083,757.76	
	DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,148,567.67	
	EQUINIX INC	4,908.00	3,394,421.88	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664.00	655,518.24	
	EQUITY RESIDENTIAL	18,773.00	1,594,390.89	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,332.00	1,048,247.20	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376.00	1,392,072.48	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	916,166.16	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569.00	725,081.70	
	INVITATION HOMES INC	32,632.00	1,281,784.96	
	IRON MOUNTAIN INC	14,204.00	618,868.28	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	652,451.84	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,369,591.02	
	PROLOGIS INC	40,178.00	5,756,703.84	
	PUBLIC STORAGE	8,778.00	3,037,714.68	
	REALTY INCOME CORP	31,385.00	2,106,561.20	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	553,042.08	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916.00	1,751,017.68	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,517.00	2,660,337.39	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088.00	1,142,961.12	
	UDR INC	16,633.00	902,007.59	
	VENTAS INC	23,363.00	1,213,240.59	
	VICI PROPERTIES INC	36,025.00	1,005,457.75	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	392,466.48	
	WELLTOWER INC	23,388.00	1,921,090.32	
	WEYERHAEUSER CO	38,940.00	1,525,279.80	
	WP CAREY INC	11,067.00	841,866.69	
	アメリカ・ドル小計	700,966.00	57,187,484.22 (6,573,701,310)	
カナ ダ・ド ル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	218,444.71	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	184,164.75	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	402,609.46 (36,399,920)	
オー スト ラリ ア・ド ル	APA GROUP	55,644.00	557,552.88	
	DEXUS/AU	54,256.00	581,624.32	
	GOODMAN GROUP	89,777.00	2,152,852.46	
	GPT GROUP	121,221.00	589,134.06	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	376,772.57	
	MIRVAC GROUP	200,053.00	522,138.33	
	SCENTRE GROUP	275,200.00	875,136.00	
	STOCKLAND	127,393.00	524,859.16	

	TRANSURBAN GROUP	161,485.00	2,112,223.80	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	458,357.90	
	オーストラリア・ドル小計	1,362,533.00	8,750,651.48 (721,753,733)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS	193,500.00	1,530,585.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,139,420.00	
	LINK REIT	110,100.00	7,228,065.00	
	香港・ドル小計	500,600.00	10,898,070.00 (160,637,552)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	480,810.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616.00	552,982.08	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	205,692.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	366,256.00	
	シンガポール・ドル小計	750,616.00	1,605,740.08 (137,451,351)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	44,962.00	242,435.10	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	316,097.73	
	SEGRO PLC	68,623.00	876,658.82	
	イギリス・ポンド小計	153,446.00	1,435,191.65 (224,492,678)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	182,156.64	
	GECINA SA	2,189.00	255,675.20	
	KLEPIERRE	13,600.00	358,632.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	504,604.16	
	ユーロ小計	25,201.00	1,301,068.00 (169,880,449)	
投資証券合計			8,024,316,993 (8,024,316,993)	
合 計			8,024,316,993 (8,024,316,993)	

(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	35銘柄	1.9%	81.9%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	9.0%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.0%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.8%
ユーロ	投資証券	4銘柄	0.0%	2.1%

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。

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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	564,581,811	295,192,543
金銭信託	-	17,377,478
コール・ローン	74,747,376	576,289,998
国債証券	161,033,197,180	157,287,798,602
派生商品評価勘定	1,645,127	-
未収入金	1,858,749,942	-
未収利息	966,326,020	879,152,772
前払費用	13,435,006	40,297,673
流動資産合計	164,512,682,462	159,096,109,066
資産合計	164,512,682,462	159,096,109,066
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,061,835	-
未払金	1,323,659,485	-
未払解約金	188,195,974	75,631,864
未払利息	216	-
その他未払費用	-	1,657
流動負債合計	1,516,917,510	75,633,521
負債合計	1,516,917,510	75,633,521
純資産の部		
元本等		
元本	85,310,011,496	82,333,458,509
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	77,685,753,456	76,687,017,036
元本等合計	162,995,764,952	159,020,475,545
純資産合計	162,995,764,952	159,020,475,545
負債純資産合計	164,512,682,462	159,096,109,066

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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>(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切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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2月18日現在)	(2022年2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	85,310,011,496口	82,333,458,509口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9106円 (1万口当たりの純資産額19,106円)	1口当たり純資産額 1.9314円 (1万口当たりの純資産額19,314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2月19日 至 2022年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
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 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</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、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>
<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。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	665,806,534	-	664,418,628	1,387,906
	イギリス・ポンド	60,047,414	-	59,882,110	165,304
	ユーロ	606,880,090	-	603,683,614	3,196,476
	小計	1,332,734,038	-	1,327,984,352	4,749,686
	売建				
	アメリカ・ドル	257,373,062	-	257,682,112	309,050
	イギリス・ポンド	43,020	-	42,895	125
	ユーロ	267,973,664	-	266,331,761	1,641,903
小計	525,389,746	-	524,056,768	1,332,978	
合計		1,858,123,784	-	1,852,041,120	3,416,708

(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。

(2022年2月18日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年2月19日 至 2022年2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,850,628,728円
同期中における追加設定元本額	12,353,840,879円
同期中における一部解約元本額	19,894,458,111円
2021年2月18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	23,244,502,535円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	710,157,374円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,958,794,306円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,005,548,820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)	142,748,560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)	6,951,183円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,512,688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)	99,066,057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)	170,376,094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)	108,781,695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)	199,736,211円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,233,080円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	127,038,109円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,476,615円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	11,846,262円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,816,122円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,042,933円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	95,085,277円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	29,864,584円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,560,013円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	71,850,656円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	109,843,469円

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	6,805,603円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	17,506,667円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	11,099,081円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,626,248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>	2,043,593,613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>	53,057,364円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,531,760,680円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,860,208,256円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	11,164,801,965円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,450,962円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	95,266,461円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	344,673円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,669,331円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,185,798円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,122,042,188円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,679,976,562円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,316,768,149円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	734,643円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,809,268,355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)	352,953,733円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	156,272,027円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	91,137,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,246,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,901,519円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	110,101,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	452,050,893円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	125,311,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,682,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,169,886円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,120,491,404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>	899,220,307円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,115,496,800円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,187,233,763円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	494,516,397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>	77,084,706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>	57,990,730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>	188,235,066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>	157,799,081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>	1,158,898,055円
合計	85,310,011,496円

(2022年2月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額

85,310,011,496円

同期中における追加設定元本額

11,473,990,193円

同期中における一部解約元本額	14,450,543,180円
2022年2月18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	24,403,685,095円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	783,841,444円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,118,559,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,127,638,898円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	155,967,328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)	30,321,807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)	101,022,148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)	220,516,443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)	150,076,179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)	254,838,761円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,046,133円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	130,124,805円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	160,182,252円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	103,340,335円
イオン・バランス戦略ファンド	374,224,537円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	17,284,763円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,404,701円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,857,305円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	129,364,807円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,477,847円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,531,301円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	127,198,869円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	255,450,964円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,560,303円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	37,237,962円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	24,650,918円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,273,756円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	209,568,844円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	9,114,932円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,822,965,793円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	43,079,590円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	7,067,972,003円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,468,947,996円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,380,262,333円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,879,317円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	91,028,746円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	687,505,196円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	116,879,699円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,043,370,554円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,438,731,860円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,535,320,106円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,784,606,906円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	8,084,567,238円

三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	325,350,941円
S M A M・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	143,270,463円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	81,175,759円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	33,971,193円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	11,926,289円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	96,352,849円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	419,212,344円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A 2 <適格機関投資家専用>	103,325,580円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A 2 <適格機関投資家専用>	40,181,590円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A 2 <適格機関投資家専用>	5,252,180円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L 2 <適格機関投資家専用>	1,025,821,385円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定>	629,786,209円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定>	937,884,754円
S M A M・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	913,843,267円
S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	381,703,472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>	208,293,939円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	179,506,411円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	229,045,007円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,818,626,083円
合 計	82,333,458,509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	T 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,493,024.00	
		T 0.125 07/15/23	4,300,000.00	4,227,072.00	
		T 0.125 08/15/23	8,000,000.00	7,851,840.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,579,274.00	
		T 0.25 04/15/23	5,000,000.00	4,944,500.00	
		T 0.25 06/15/23	7,700,000.00	7,593,509.00	
		T 0.25 06/30/25	2,400,000.00	2,280,000.00	
		T 0.25 07/31/25	3,300,000.00	3,130,743.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,891,320.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,938,350.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,871,780.00	
		T 0.375 07/31/27	4,700,000.00	4,333,541.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,904,600.00	
		T 0.375 09/30/27	7,800,000.00	7,169,838.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,894,520.00	

T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,838,390.00	
T 0.5 03/31/25	1,500,000.00	1,444,335.00	
T 0.5 04/30/27	3,000,000.00	2,799,240.00	
T 0.5 05/31/27	3,000,000.00	2,793,030.00	
T 0.5 06/30/27	4,400,000.00	4,092,000.00	
T 0.625 03/31/27	1,500,000.00	1,410,690.00	
T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,747,000.00	
T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,411,396.00	
T 0.625 08/15/30	8,800,000.00	7,887,000.00	
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,283,796.00	
T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,951,845.00	
T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,681,312.00	
T 0.75 01/31/28	6,700,000.00	6,256,125.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	5,072,184.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	6,392,960.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,562,579.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,415,940.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,915,625.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,473,855.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,930,460.00	
T 1.125 05/15/40	3,200,000.00	2,611,872.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,934,548.00	
T 1.25 07/31/23	3,000,000.00	2,995,530.00	
T 1.25 08/15/31	5,500,000.00	5,159,220.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	4,305,555.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	4,085,130.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,882,178.00	
T 1.375 02/15/23	3,000,000.00	3,009,000.00	
T 1.375 06/30/23	500,000.00	500,230.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	3,583,800.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,498,425.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,950,190.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,998,110.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,783,880.00	
T 1.375 11/15/31	5,400,000.00	5,114,772.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,409,275.00	
T 1.5 01/31/27	2,400,000.00	2,360,616.00	
T 1.5 02/15/30	4,500,000.00	4,355,505.00	
T 1.5 02/28/23	3,000,000.00	3,011,700.00	
T 1.5 03/31/23	3,000,000.00	3,010,650.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,475,910.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	796,432.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,233,139.00	
T 1.625 02/15/26	4,700,000.00	4,661,413.00	

T 1.625 04/30/23	3,000,000.00	3,013,230.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	14,812,161.00	
T 1.625 05/15/31	4,300,000.00	4,177,020.00	
T 1.625 05/31/23	3,000,000.00	3,012,630.00	
T 1.625 08/15/29	4,450,000.00	4,357,173.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,860,688.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	3,008,670.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,712,224.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	197,976.00	
T 1.75 01/31/23	3,000,000.00	3,019,440.00	
T 1.75 05/15/23	2,700,000.00	2,717,280.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,222,258.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	852,847.50	
T 1.75 11/15/29	4,000,000.00	3,952,160.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,484,950.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	5,227,250.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,823,142.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	1,173,146.00	
T 2 02/15/23	3,800,000.00	3,834,580.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,529,785.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,598,512.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	2,018,420.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,330,921.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	4,138,417.00	
T 2 08/15/25	4,300,000.00	4,330,530.00	
T 2 08/15/51	4,700,000.00	4,363,245.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	5,031,250.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	2,024,200.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,577,155.00	
T 2.125 05/15/25	4,900,000.00	4,958,555.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,544,555.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	4,048,400.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,136,301.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,631,278.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,231,790.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,484,216.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	13,510,805.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,856,088.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	4,280,388.00	
T 2.25 08/15/46	3,350,000.00	3,243,972.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	3,432,170.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	812,432.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	5,177,265.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	4,063,280.00	

T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,481,444.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	3,042,180.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,961,542.00	
T 2.375 01/31/23	1,200,000.00	1,214,760.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,763,270.00	
T 2.375 05/15/27	4,900,000.00	5,023,235.00	
T 2.375 05/15/29	4,100,000.00	4,221,360.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,413,230.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,701,024.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,914,250.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,478,336.00	
T 2.5 02/15/45	4,100,000.00	4,152,849.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,941,905.00	
T 2.5 02/28/26	8,500,000.00	8,713,775.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,814,855.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	3,651,444.00	
T 2.5 08/15/23	5,000,000.00	5,083,200.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,780,352.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,881,126.00	
T 2.625 02/28/23	4,000,000.00	4,061,840.00	
T 2.625 03/31/25	2,300,000.00	2,362,882.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,939,482.00	
T 2.625 12/31/25	4,400,000.00	4,533,364.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,223,879.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	5,024,592.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	2,060,000.00	
T 2.75 04/30/23	2,900,000.00	2,951,765.00	
T 2.75 05/31/23	1,000,000.00	1,018,350.00	
T 2.75 06/30/25	4,600,000.00	4,746,234.00	
T 2.75 07/31/23	2,000,000.00	2,040,620.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	2,116,000.00	
T 2.75 08/15/47	3,800,000.00	4,063,910.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,877,178.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,168,250.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,292,526.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	317,484.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,604,295.00	
T 2.875 04/30/25	2,200,000.00	2,277,154.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	9,496,350.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,585,520.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,548,414.00	
T 2.875 05/31/25	1,100,000.00	1,138,665.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,756,275.00	
T 2.875 08/15/45	3,700,000.00	4,004,954.00	

T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	1,023,670.00	
T 2.875 11/15/46	3,600,000.00	3,917,232.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	2,049,520.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,597,250.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,783,000.00	
T 3 02/15/48	3,100,000.00	3,480,463.00	
T 3 02/15/49	3,800,000.00	4,293,696.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	881,432.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	3,308,670.00	
T 3 05/15/47	2,200,000.00	2,454,870.00	
T 3 08/15/48	5,400,000.00	6,075,000.00	
T 3 09/30/25	4,000,000.00	4,169,360.00	
T 3 10/31/25	3,100,000.00	3,231,502.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,852,170.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,986,227.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	1,122,730.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,575,448.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,760,000.00	
T 3.125 08/15/44	3,300,000.00	3,704,481.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	3,115,673.00	
T 3.375 05/15/44	3,000,000.00	3,497,100.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	3,732,338.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	235,764.00	
T 3.625 02/15/44	3,600,000.00	4,346,712.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,891,040.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,827,765.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	859,138.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	616,875.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	128,921.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	775,170.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	1,182,303.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	394,875.00	
T 4.375 11/15/39	700,000.00	916,671.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	398,436.00	
T 4.625 02/15/40	1,300,000.00	1,753,271.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,236,438.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	604,685.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	411,148.80	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,161,870.00	
T 6.25 08/15/23	800,000.00	857,872.00	
T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,229,680.00	
アメリカ・ドル小計	652,520,000.00	653,888,095.80 (75,164,436,612)	
カナダ・	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,591,676.00

ドル	CAN 1 06/01/27	600,000.00	577,560.00	
	CAN 1.25 06/01/30	6,200,000.00	5,921,186.00	
	CAN 1.5 06/01/23	2,000,000.00	2,004,480.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,400,000.00	3,371,678.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,000,000.00	1,995,840.00	
	CAN 1.75 03/01/23	900,000.00	904,617.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	709,618.00	
	CAN 2 09/01/23	1,200,000.00	1,211,268.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	1,014,630.00	
	CAN 2.25 06/01/25	1,000,000.00	1,019,460.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,900,000.00	1,959,128.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,144,415.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,400,000.00	1,560,580.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,300,000.00	1,614,639.00	
	CAN 4 06/01/41	2,000,000.00	2,567,740.00	
	CAN 5 06/01/37	1,450,000.00	1,985,079.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	317,107.50	
	CAN 5.75 06/01/33	700,000.00	959,931.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	796,019.00	
	カナダ・ドル小計		33,500,000.00	35,226,651.50 (3,184,841,562)
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	756,488.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	3,500,000.00	3,300,395.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	398,645.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	2,600,000.00	2,634,398.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	1,850,000.00	1,900,505.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,583,675.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	835,736.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,100,000.00	1,146,134.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	208,736.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	3,100,000.00	3,240,492.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,252,092.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,365,156.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	862,224.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,550,000.00	2,785,951.50	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,395,828.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,650,000.00	2,909,435.00	
ACGB 4.5 04/21/33	1,100,000.00	1,347,060.00		
ACGB 5.5 04/21/23	900,000.00	950,049.00		
オーストラリア・ドル小計		28,650,000.00	29,872,999.50 (2,463,924,999)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	97,842.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	200,000.00	194,876.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,200,000.00	1,220,832.00	

	SIGB 2.625 05/01/28	900,000.00	938,880.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	700,000.00	777,210.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	400,000.00	442,476.00	
	SIGB 2.75 07/01/23	1,200,000.00	1,227,336.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	214,200.00	
	SIGB 3 09/01/24	700,000.00	728,000.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	750,000.00	849,375.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,622,250.00	
	シンガポール・ドル小計	7,850,000.00	8,313,277.00 (711,616,511)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT	600,000.00	554,844.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,433,460.00	
	UKT 0.125 01/31/23	500,000.00	495,280.00	
	UKT 0.25 01/31/25	300,000.00	290,580.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,600,000.00	1,429,968.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,650,366.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	72,766.00	
	UKT 0.625 06/07/25	800,000.00	783,144.00	
	UKT 0.625 07/31/35	600,000.00	528,354.00	
	UKT 0.75 07/22/23	2,650,000.00	2,632,775.00	
	UKT 0.875 10/22/29	1,000,000.00	965,210.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	795,032.00	
	UKT 1.25 07/22/27	1,200,000.00	1,197,636.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,300,000.00	1,312,259.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,200,000.00	2,155,912.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	918,252.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	512,330.00	
	UKT 1.75 01/22/49	850,000.00	882,410.50	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	101,656.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,126,378.00	
	UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,739,339.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	2,180,640.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	931,896.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	2,080,592.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,699,737.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,450,000.00	2,501,032.50	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,836,600.00	
	UKT 4 01/22/60	1,700,000.00	2,969,900.00	
UKT 4.25 03/07/36	1,050,000.00	1,401,099.00		
UKT 4.25 06/07/32	700,000.00	883,456.00		
UKT 4.25 09/07/39	1,250,000.00	1,757,312.50		
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	1,046,952.00		
UKT 4.25 12/07/40	700,000.00	999,075.00		
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	2,305,350.00		

	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,440,360.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,925,700.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,465,640.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,250,000.00	1,886,875.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,469,872.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,200,000.00	1,758,360.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,442,376.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	847,047.50	
	イギリス・ポンド小計	48,150,000.00	58,407,825.00 (9,136,151,987)	
イスラエル・シユケル	ILGOV 0.15 07/31/23	5,800,000.00	5,771,812.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,900,000.00	2,944,892.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,500,000.00	1,592,970.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	4,100,000.00	4,921,886.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	4,096,554.00	
	イスラエル・シユケル小計	17,600,000.00	19,328,114.00 (691,826,647)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	2,000,000.00	1,791,040.00	
	DGB 0.5 11/15/27	9,800,000.00	9,939,160.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,300,000.00	4,349,751.00	
	DGB 1.5 11/15/23	3,000,000.00	3,098,430.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,100,000.00	3,296,881.00	
	DGB 4.5 11/15/39	9,800,000.00	16,266,628.00	
	デンマーク・クローネ小計	32,000,000.00	38,741,890.00 (679,920,170)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	2,000,000.00	1,889,700.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,500,000.00	3,437,140.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,985,900.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,200,000.00	4,105,332.00	
	NGB 2 04/26/28	9,000,000.00	8,982,360.00	
	NGB 2 05/24/23	4,000,000.00	4,031,400.00	
	NGB 3 03/14/24	4,300,000.00	4,411,026.00	
	ノルウェー・クローネ小計	30,000,000.00	29,842,858.00 (384,674,440)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.75 05/12/28	4,000,000.00	4,062,640.00	
	SGB 0.75 11/12/29	6,400,000.00	6,504,960.00	
	SGB 1 11/12/26	6,400,000.00	6,576,256.00	
	SGB 1.5 11/13/23	7,000,000.00	7,188,300.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,359,850.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	6,646,724.00	
	スウェーデン・クローナ小計	33,400,000.00	36,338,730.00 (446,966,379)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	33,780,160.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,693,750.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	25,000,000.00	24,745,250.00	

	MBONO 7.75 05/29/31	5,000,000.00	4,987,000.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	17,853,840.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,960,450.00	
	MBONO 8 12/07/23	34,000,000.00	34,137,700.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	23,985,090.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	41,930,800.00	
	メキシコ・ペソ小計	201,000,000.00	204,074,040.00 (1,155,283,548)	
オフショ ア・人民 元	CGB 2.47 09/02/24	22,000,000.00	22,107,140.00	
	CGB 2.56 10/21/23	8,000,000.00	8,047,920.00	
	CGB 2.69 08/12/26	19,000,000.00	19,166,630.00	
	CGB 2.91 10/14/28	9,000,000.00	9,093,060.00	
	CGB 3.02 05/27/31	13,000,000.00	13,202,410.00	
	CGB 3.72 04/12/51	7,000,000.00	7,440,510.00	
	オフショア・人民元小計	78,000,000.00	79,057,670.00 (1,434,952,051)	
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	2,500,000.00	2,540,525.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	718,249.00	
	MGS 3.502 05/31/27	7,900,000.00	7,930,652.00	
	MGS 3.955 09/15/25	5,300,000.00	5,464,194.00	
	MGS 4.498 04/15/30	5,000,000.00	5,274,550.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,900,732.00	
	マレーシア・リングット小計	28,100,000.00	28,828,902.00 (791,759,847)	
ポーラン ド・ズロ チ	POLGB 0 04/25/23	700,000.00	672,525.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	2,800,000.00	2,561,328.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	1,800,000.00	1,461,456.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	6,500,000.00	6,286,540.00	
	POLGB 2.5 04/25/24	4,500,000.00	4,402,125.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	6,000,000.00	5,636,400.00	
	POLGB 5.75 04/25/29	4,300,000.00	4,813,205.00	
	ポーランド・ズロチ小計	26,600,000.00	25,833,579.00 (745,570,007)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,221,467.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	678,104.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	268,536.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,326,286.00	
	BGB 0.65 06/22/71	200,000.00	145,224.00	
	BGB 0.8 06/22/25	800,000.00	823,920.00	
	BGB 0.8 06/22/27	1,000,000.00	1,032,820.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,653,648.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	934,065.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,872,594.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,350,869.00	

BGB 1.25 04/22/33	1,000,000.00	1,065,970.00	
BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	430,424.00	
BGB 1.6 06/22/47	850,000.00	926,899.50	
BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	555,050.00	
BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	1,148,050.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	632,605.00	
BGB 2.25 06/22/23	1,300,000.00	1,347,736.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	632,170.00	
BGB 2.6 06/22/24	800,000.00	854,400.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	252,646.00	
BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	1,234,720.00	
BGB 4 03/28/32	500,000.00	667,490.00	
BGB 4.25 03/28/41	1,200,000.00	1,866,132.00	
BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	830,935.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,523,660.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,457,665.00	
BTPS 0 12/15/24	600,000.00	591,156.00	
BTPS 0.35 02/01/25	2,700,000.00	2,687,580.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	989,150.00	
BTPS 0.65 10/15/23	2,000,000.00	2,022,940.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,687,998.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,861,260.00	
BTPS 0.95 03/01/23	600,000.00	608,130.00	
BTPS 0.95 03/15/23	2,000,000.00	2,027,700.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,703,826.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	792,224.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	811,560.00	
BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.00	1,025,178.00	
BTPS 1.45 05/15/25	1,000,000.00	1,027,770.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,847,916.00	
BTPS 1.5 06/01/25	2,700,000.00	2,779,623.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,237,764.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	2,195,160.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	1,270,710.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	3,106,200.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	1,040,480.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	4,080,375.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,362,335.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,574,400.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	1,052,530.00	
BTPS 2.2 06/01/27	2,300,000.00	2,434,067.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	513,590.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	1,166,539.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	899,343.00	

BTPS 2.5 11/15/25	2,100,000.00	2,238,894.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,373,515.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,648,905.50	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	609,402.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.00	1,095,510.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,300,000.00	1,449,578.00	
BTPS 3 08/01/29	3,000,000.00	3,332,280.00	
BTPS 3.1 03/01/40	900,000.00	1,020,888.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,750,140.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	983,526.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,400,000.00	1,686,202.00	
BTPS 3.5 03/01/30	4,400,000.00	5,067,744.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,495,684.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,412,708.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	3,250,260.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,087,710.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	2,066,670.00	
BTPS 4.5 05/01/23	2,300,000.00	2,431,951.00	
BTPS 4.75 08/01/23	2,500,000.00	2,677,225.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,432,080.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,600,000.00	2,291,040.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,134,390.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,778,726.60	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,541,924.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	2,426,240.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,367,811.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	3,021,172.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	2,203,608.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	516,844.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	345,684.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,289,340.00	
DBR 0 05/15/35	4,800,000.00	4,588,848.00	
DBR 0 08/15/29	3,500,000.00	3,479,210.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,734,692.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,475,685.00	
DBR 0 08/15/50	2,700,000.00	2,363,310.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,335,558.00	
DBR 0.25 02/15/29	800,000.00	811,016.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,521,210.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,561,000.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,179,980.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	2,160,669.00	
DBR 0.5 08/15/27	3,400,000.00	3,495,608.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,344,239.00	

DBR 1 08/15/25	2,050,000.00	2,136,612.50	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,986,385.50	
DBR 1.5 02/15/23	1,100,000.00	1,123,716.00	
DBR 1.5 05/15/23	1,300,000.00	1,334,476.00	
DBR 1.5 05/15/24	3,600,000.00	3,755,268.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,299,132.00	
DBR 2 08/15/23	2,000,000.00	2,078,160.00	
DBR 2.5 07/04/44	2,200,000.00	3,222,824.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,500,000.00	3,744,900.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	1,103,193.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,780,262.00	
DBR 4.25 07/04/39	950,000.00	1,583,612.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	2,088,176.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	934,392.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,650,000.00	2,956,470.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,333,800.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,335,090.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,354,224.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	745,220.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,354,230.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,913,889.00	
FRTR 0 02/25/26	3,100,000.00	3,093,583.00	
FRTR 0 03/25/23	2,000,000.00	2,013,400.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,833,648.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,906,783.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	4,343,265.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,713,346.00	
FRTR 0 11/25/31	3,800,000.00	3,566,794.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,216,672.00	
FRTR 0.5 05/25/25	2,900,000.00	2,957,130.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,562,650.00	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	201,526.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	68,169.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,394,776.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,300,000.00	2,901,426.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,595,620.00	
FRTR 1 05/25/27	3,300,000.00	3,440,514.00	
FRTR 1 11/25/25	2,050,000.00	2,127,162.00	
FRTR 1.25 05/25/34	3,300,000.00	3,473,514.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,887,775.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,762,109.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	2,584,008.00	
FRTR 1.75 05/25/23	4,200,000.00	4,323,018.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	911,272.00	

FRTR 1.75 06/25/39	2,500,000.00	2,856,775.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,742,428.00	
FRTR 2 05/25/48	2,200,000.00	2,637,756.00	
FRTR 2.25 05/25/24	3,400,000.00	3,597,676.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	4,080,860.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,406,902.50	
FRTR 3.25 05/25/45	1,700,000.00	2,461,328.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,862,350.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	2,403,158.10	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	2,556,428.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,973,200.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,079,470.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,300,000.00	3,725,333.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	3,297,778.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	3,209,489.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	611,508.00	
FRTR 6 10/25/25	3,000,000.00	3,675,330.00	
FRTR 8.5 04/25/23	600,000.00	664,026.00	
IRISH 0.9 05/15/28	700,000.00	727,265.00	
IRISH 1 05/15/26	1,000,000.00	1,039,400.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,600,000.00	1,673,776.00	
IRISH 1.3 05/15/33	1,000,000.00	1,052,720.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	535,245.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	533,160.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	332,313.00	
IRISH 2 02/18/45	1,000,000.00	1,190,770.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	693,780.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	538,465.00	
IRISH 3.9 03/20/23	500,000.00	523,685.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	935,736.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	1,008,350.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,533,544.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,700,000.00	1,722,610.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	500,255.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,689,647.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,738,539.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	414,396.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,556,490.00	
NETHER 1.75 07/15/23	1,600,000.00	1,652,864.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,056,350.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	731,028.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,600,000.00	2,419,168.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	2,085,746.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	2,096,360.00	

NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	921,823.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,312,090.00	
OBL 0 04/11/25	3,500,000.00	3,528,140.00	
OBL 0 04/14/23	1,900,000.00	1,914,212.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,104,455.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,812,636.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,615,584.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	605,232.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	866,682.00	
RAGB 0 02/20/31	800,000.00	761,024.00	
RAGB 0 07/15/23	600,000.00	604,176.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	555,263.50	
RAGB 0.5 04/20/27	800,000.00	815,456.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	720,622.00	
RAGB 0.75 03/20/51	1,100,000.00	1,037,300.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	927,855.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	107,979.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	1,046,530.00	
RAGB 1.5 02/20/47	900,000.00	1,021,329.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	220,832.00	
RAGB 1.65 10/21/24	1,200,000.00	1,262,112.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,036,430.00	
RAGB 2.4 05/23/34	300,000.00	361,575.00	
RAGB 3.15 06/20/44	700,000.00	1,032,829.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	1,320,529.00	
RAGB 4.15 03/15/37	900,000.00	1,342,881.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	600,830.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,333,580.00	
RFGB 0.25 09/15/40	300,000.00	270,699.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	405,104.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	808,064.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	511,225.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	340,032.00	
RFGB 1.5 04/15/23	1,000,000.00	1,023,780.00	
RFGB 2 04/15/24	1,000,000.00	1,052,120.00	
RFGB 2.625 07/04/42	1,000,000.00	1,353,860.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	464,312.00	
RFGB 4 07/04/25	600,000.00	684,372.00	
SPGB 0 01/31/25	1,300,000.00	1,297,647.00	
SPGB 0.25 07/30/24	700,000.00	705,600.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	968,360.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,317,918.00	
SPGB 0.8 07/30/27	400,000.00	403,900.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	243,762.00	

SPGB 1.2 10/31/40	700,000.00	651,133.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	3,066,270.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,227,379.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,200,000.00	2,296,624.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,600,000.00	1,669,376.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,900,000.00	3,031,022.00	
SPGB 1.45 10/31/27	2,600,000.00	2,719,340.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	302,864.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,200,000.00	1,258,248.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,700,000.00	1,781,617.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,700,000.00	2,851,389.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	2,131,500.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,839,043.00	
SPGB 2.15 10/31/25	2,400,000.00	2,566,704.00	
SPGB 2.35 07/30/33	500,000.00	558,885.00	
SPGB 2.7 10/31/48	1,250,000.00	1,494,175.00	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,257,857.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,400,000.00	1,728,748.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,748,045.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,521,464.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,650,000.00	2,273,106.00	
SPGB 4.4 10/31/23	2,000,000.00	2,158,960.00	
SPGB 4.65 07/30/25	1,800,000.00	2,072,088.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	2,287,440.00	
SPGB 4.8 01/31/24	3,000,000.00	3,291,210.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,500,000.00	2,319,195.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,932,465.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,663,540.00	
SPGB 5.4 01/31/23	1,500,000.00	1,584,000.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,500,000.00	2,182,320.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	621,645.00	
SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,985,334.00	
ユーロ小計	413,890,000.00	461,789,644.20 (60,295,873,843)	
国債証券合計		157,287,798,602 (157,287,798,602)	
合計		157,287,798,602 (157,287,798,602)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	188銘柄	47.3%	47.8%
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	18銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.4%	0.5%
イギリス・ポンド	国債証券	42銘柄	5.7%	5.8%
イスラエル・シケル	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
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	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	6銘柄	0.9%	0.9%
マレーシア・リンギット	国債証券	6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	263銘柄	37.9%	38.3%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

2022年2月28日現在

資産総額	245,529,295円
負債総額	10,764円
純資産総額（ - ）	245,518,531円
発行済口数	223,024,596口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1009円 (11,009円)

三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

2022年2月28日現在

資産総額	716,395,161円
負債総額	227,021円
純資産総額（ - ）	716,168,140円
発行済口数	608,224,050口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1775円 (11,775円)

三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

2022年2月28日現在

資産総額	476,180,271円
負債総額	20,890円
純資産総額（ - ）	476,159,381円
発行済口数	379,523,802口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.2546円 (12,546円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

八 受益者に対する特典

ありません。

二 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2022年2月28日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

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

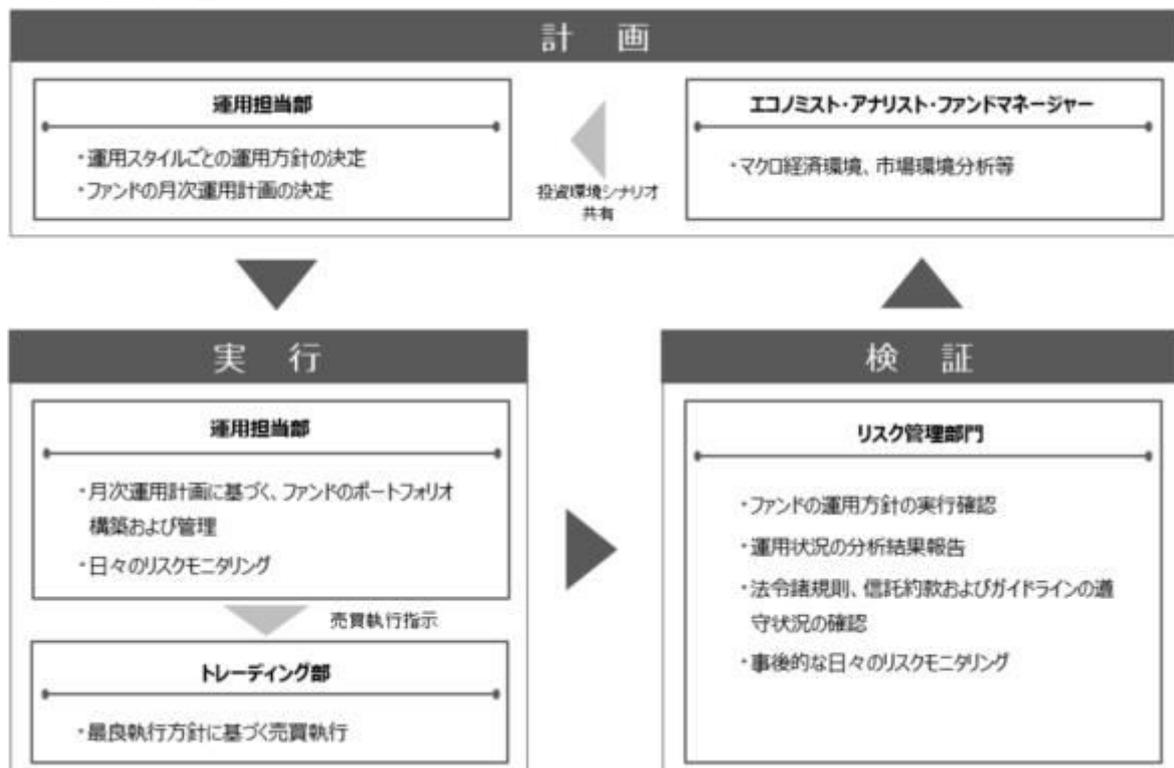
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年2月28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	721	9,035,223
単位型株式投資信託	101	512,730
追加型公社債投資信託	1	26,284
単位型公社債投資信託	189	392,358
合計	1,012	9,966,596

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間(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							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
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	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
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。

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	当事業年度
	(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)	(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	当事業年度
	(2020年 3月 31日)	(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業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

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	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	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

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	㈱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㈱	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おりません。

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おりません。

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)。

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

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。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

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(2019年4月1日付)に伴って発生したのれんについて、2021年3月期決算において28,097,346千円の減損損失を計上しました。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円(2021年3月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2021年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2021年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）
該当ありません。

第3【その他】

- 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
 - (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
 - (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
 - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
 - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
 - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
 - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
 - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

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。

独立監査人の監査報告書

2022年3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 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・年金バランス30（債券重点型）の2021年2月19日から2022年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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・年金バランス30（債券重点型）の2022年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

独立監査人の監査報告書

2022年3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	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・年金バランス50（標準型）の2021年2月19日から2022年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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・年金バランス50（標準型）の2022年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

独立監査人の監査報告書

2022年3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 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・年金バランス70（株式重点型）の2021年2月19日から2022年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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・年金バランス70（株式重点型）の2022年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。

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。